

投資信託説明書
(請求目論見書)

使用開始日 2024.3.26

ダイナミックアロケーション ファンド(ラップ向け)

追加型投信／内外／資産複合

この目論見書により行う「ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)」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2023年9月25日に関東財務局長に提出しており、2023年9月26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】	1
(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】	49
第3【ファンドの経理状況】	55
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	302
第三部【委託会社等の情報】	303
第1【委託会社等の概況】	303
約款	347

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）（「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/>

（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1万口当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】

ありません。

(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】

2023年9月26日から2024年9月24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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額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】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約*に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。

※同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

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、値上がり益の獲得および利子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 不動産投信	MR F	
追加型	内外	その他資産 ()	E T F	特殊型 ()
		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 一般	年1回 年2回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり (部分ヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 不動産投信 その他資産 (投資信託証 券(資産複合 (株式、債 券))) 資産複合	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX その他 ()	条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()

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

※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・特色]

ファンドの目的

日本を含む先進国の株式および公社債等を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子収益の確保をめざします。

ファンドの特色

特色 1

日本を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

※実際の運用は各マザーファンドへの投資を通じて行います。

<投資対象とするマザーファンドと運用目標>

各マザーファンド	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	日本の株式	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	先進国の株式(日本の株式を除く)	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。
日本超長期国債インデックスマザーファンドII	日本の国債	NOMURA-BPI国債 超長期(11-)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
国内債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。
日本短期債券マザーファンド	日本の公社債・金融商品	NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、同指数を上回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	先進国債券(国内債券を除く)	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。
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド*	先進国債券(国内債券を除く)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
新マネー・マーケット・マザーファンド	日本の短期公社債等	主として安定した利子収益の確保をめざして運用を行います。

*為替ヘッジを行うマザーファンドです。

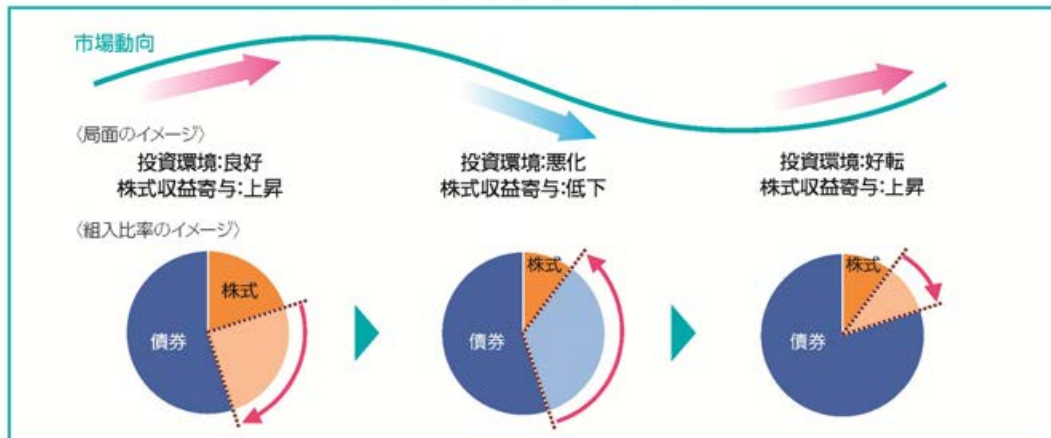
1 上記の他、短期金融資産に投資することがあります。

特色 2

三菱UFJ信託銀行からの投資助言・情報提供に基づき、投資環境等に応じて、各資産の組入比率を決定し運用を行います。

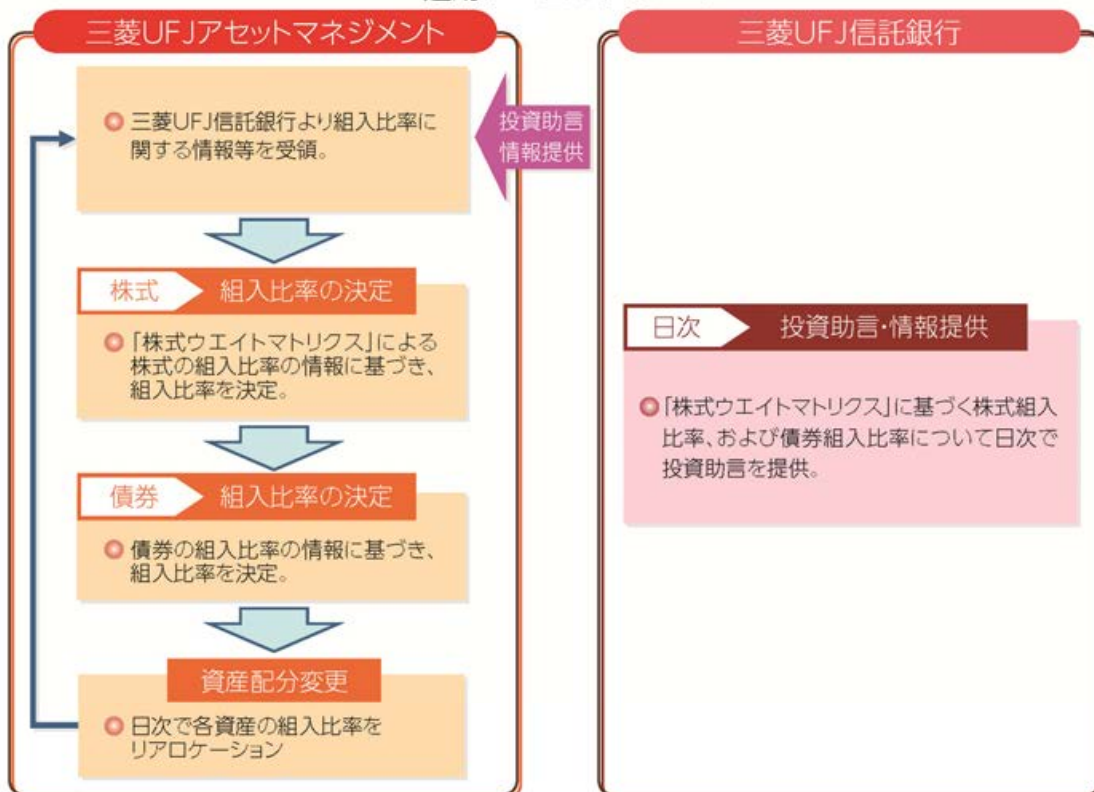
■運用方法・運用プロセス

<組入比率変更のイメージ>



❗ 上記はファンドの組入比率の変更をご理解いただくためにイメージとして示したもので、実際とは異なる場合があります。

<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を行わない場合があります。

❗ 投資助言者、投資助言・情報提供の内容、投資助言・情報提供の有無等については、変更する場合があります。

- 日本株式と先進国株式(日本株式を除く)の組入比率の決定にあたっては、投資環境と株式部分の収益寄与から比率を決定する「株式ウエイトマトリクス」を活用します。
 - ・「投資環境」は、株式市場や景気の方向性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。
 - 「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。
 - ・「株式部分の収益寄与」は、過去の株式の収益率に組入比率を勘案して算出します。

<株式ウエイトマトリクスのイメージ>



1 上記の株式ウエイトマトリクスはイメージであり、実際のものとは異なります。なお、日本株式と先進国株式(日本株式を除く)の組入比率の決定に用いられる株式ウエイトマトリクスの設計は異なります。

- 公社債等の組入比率については、株式部分の組入比率を決定した後、原則として相場局面判断および投資環境等に基づき決定します。

☞ 「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でご覧いただけます。
(<https://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>)

特色3

実質組入外貨建資産について為替ヘッジを行う場合があります。

- 投資対象とするマザーファンドによっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。
 - ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
 - 為替ヘッジを行わない場合は、為替相場の変動による影響を受けます。
- 1 為替ヘッジ(為替取引)を行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコスト(為替取引によるコスト)がかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコスト(為替取引によるコスト)となる場合があります。

特色 4

年1回の決算時(6月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

- 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。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。

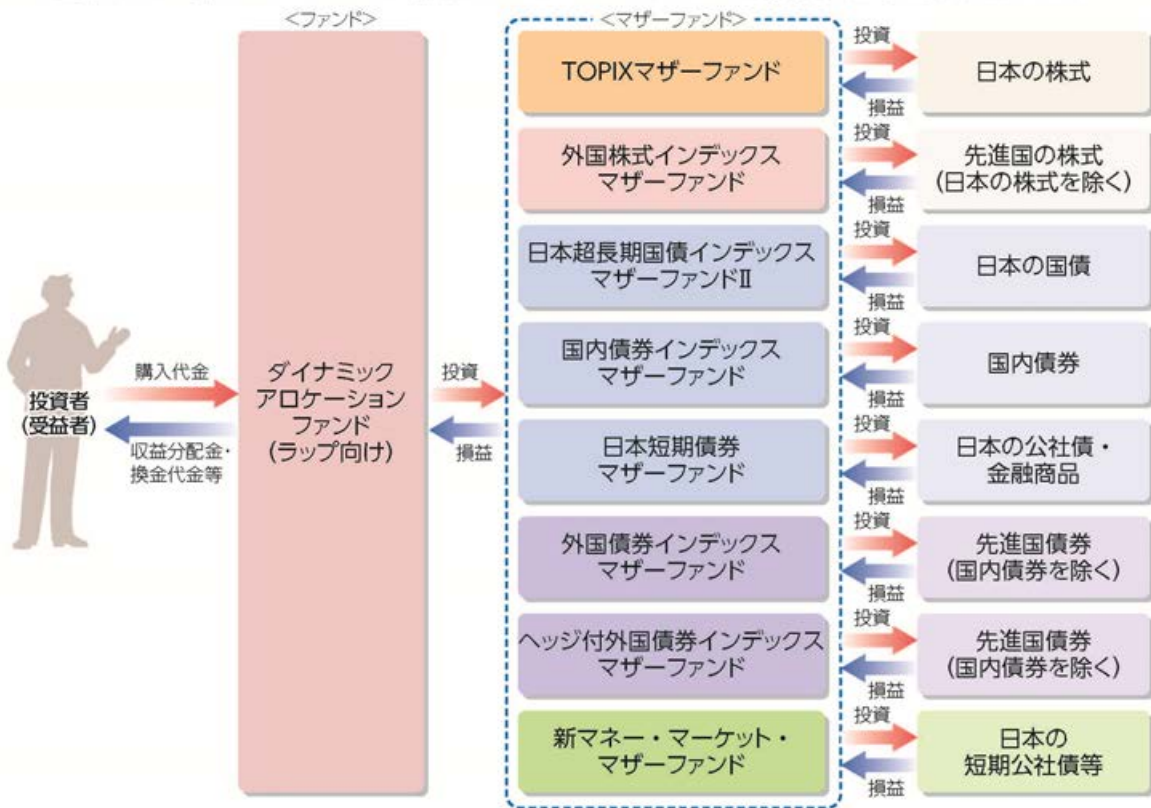
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式により、運用を行います。

ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。



■ 主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
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。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。



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に係る標準又は商標は、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に係る標準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。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国債 超長期(11-)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日本国が発行した固定利付債(個人向けは対象外)の残存期間11年以上の債券のパフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI国債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。
- ・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。
- ・NOMURA-BPI短期インデックスとは、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残存期間1年から3年の債券で構成されている債券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。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本)およびFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)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。

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】

2021年11月30日	設定日、信託契約締結、運用開始
2022年10月6日	主要投資対象変更の重大な約款変更の適用 ファンドの投資対象に「国内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」、「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」を追加
2023年10月30日	主要投資対象変更の重大な約款変更の適用 ファンドの投資対象に「日本短期債券マザーファンド」を追加

(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

投資家 (受益者)	お申込金 ↓ ↑ 収益分配金、解約代金等
販売会社	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等を行います。

お申込金 ↓ ↑ 収益分配金、解約代金等

<p>受託会社（受託者） 三菱UFJ信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)</p> <p>信託財産の保管・管理等を行います。</p> <p>投資 ↓ ↑ 損益</p> <p>マザーファンド</p> <p>投資 ↓ ↑ 損益</p> <p>有価証券等</p>	<p>委託会社（委託者） 三菱UFJアセットマネジメント株式会社</p> <p>信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。</p>
--	--

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（2023年12月末現在）

- ・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
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5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、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券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、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

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、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券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、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

株式の実質組入比率は、原則として相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

公社債等の実質組入比率については、株式部分の組入比率を決定した後、原則として相場局面判断および投資環境等に基づき決定します。

実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。

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。

(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. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 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する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、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ、国内債券インデックスマザーファンド、日本短期債券マザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよび新マネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの

23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの
7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から6. に該当するものを除きます。）
8. 外国の者に対する権利で7. の権利の性質を有するもの
9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
10. 外国法人の社員権で9. の権利の性質を有するもの
11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
12. 外国の法令に基づく権利であって、11. の権利に類するもの

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。

日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ

(基本方針)

この投資信託は、NOMURA-BPI国債 超長期（11-）に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

わが国の国債を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の国債に投資を行います。

国債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し債券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

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（上場投資信託証券を除きます。）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10%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10%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スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

国内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総合に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

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。

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（上場投資信託証券を除きます。）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スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

日本短期債券マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、信託財産の安定的な成長をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。

②投資態度

ポートフォリオのデュレーション調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。

ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。

銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。

NOMURA-BPI短期インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

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。
- ②外貨建資産への投資は行いません。
- ③有価証券先物取引等を行うことができます。
- ④スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

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、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。

(運用方法)

①投資対象

FTSE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。

ヘッジ付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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

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（上場投資信託証券を除きます。）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スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑩金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑫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減じ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。

新マネー・マーケット・マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、主として安定した利子収益の確保をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の短期公社債等に投資を行います。

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株式への投資は行いません。

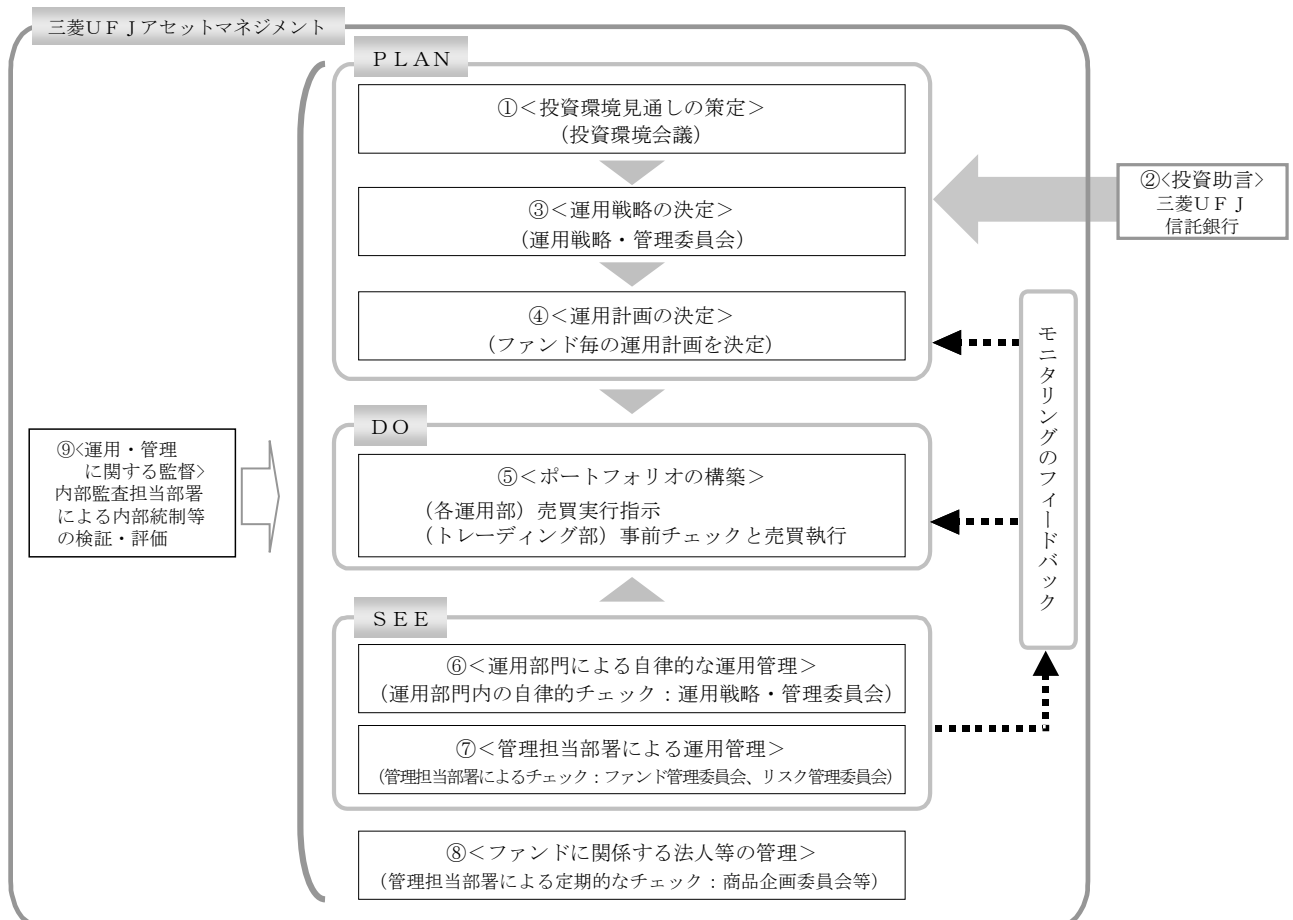
②外貨建資産への投資は行いません。

③有価証券先物取引等を行うことができます。

④スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑤金利先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

(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投資助言

当ファンドは、三菱UFJ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

③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、および②の投資助言に沿って運

用戦略を決定します。

④運用計画の決定

③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。

⑤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。

⑥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。

⑦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、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、(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における審議を経て運用担当部・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。

⑧ファンドに関係する法人等の管理

助言元、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。

⑨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、経費等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いて運用を行います。

(5) 【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権

証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

②投資信託証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下 a. および b. において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

③同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する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（新株予約権付社債のうち、会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第 341 条の 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

④スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑤信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（③に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑥外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する

外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑦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り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。

⑧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を図るため、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り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。

⑨投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑪有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価

合計額を超えないものとします。

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

- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑫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、制限されることがあります。

⑬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。

⑭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。)

価格変動 リスク

- ・株式の価格は、株式市場全体の動向のほか、発行企業の業績や業績に対する市場の見通しなどの影響を受けて変動します。組入株式の価格の下落は、基準価額の下落要因となります。
- ・債券の価格は、市場金利の変動の影響を受けて変動します。一般に市場金利が上がると、債券の価格は下落し、組入債券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。市場金利の変動による債券価格の変動は、一般にその債券の残存期間が長いほど大きくなる傾向があります。

為替変動 リスク

投資対象とするマザーファンドによっては、組入外貨建資産について為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図っている場合があります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分がヘッジコストとなります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。また、為替ヘッジを行わない場合は、為替変動の影響を受けます。

信用リスク

有価証券等の発行企業の経営、財務状況が悪化したり、市場においてその懸念が高まった場合には、有価証券等の価格が下落（債券の場合は利回りが上昇）すること、配当金が減額あるいは支払いが停止、または利払いや償還金の支払いが滞ること、倒産等によりその価値がなくなること等があります。

流動性 リスク

有価証券等を売買しようとする際に、その有価証券等の取引量が十分でない場合や規制等により取引が制限されている場合には、売買が成立しなかったり、十分な数量の売買が出来なかったり、ファンドの売買自体によって市場価格が動き、結果として不利な価格での取引となる場合があります。

※留意事項

- ・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、ファンドが損失を被る可能性があります。
- ・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がある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。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかつた場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・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、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、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・投資環境によっては、マイナス利回りの公社債や金融商品等での運用となることがあり、この場合、基準価額の下落要因となります。

(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審議して

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。

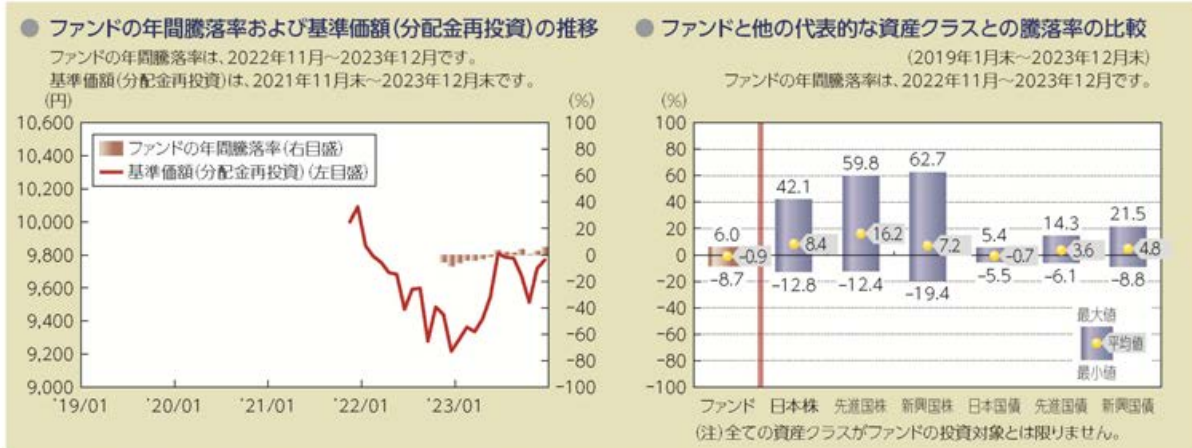
③内部監査担当部署

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。
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】

ありません。

※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 0.176%（税抜 0.160%）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、毎計算期間の 6 ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき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	0.105%	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	0.030%	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	0.025%	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。

(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。

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と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 2023 年 12 月末現在のもので、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。

5 【運用状況】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

(1) 【投資状況】

2023 年 12 月 29 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	73,297,270,295	81.14
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	17,035,015,983	18.86
純資産総額		90,332,286,278	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

2023 年 12 月 29 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	外国株式インデックスマザーファンド	3,212,468,918	5.7625	18,511,852,140	5.9177	19,010,427,316	21.04
日本	親投資信託受益証券	日本短期債券マザーファンド	16,031,537,190	1.1220	17,987,400,000	1.1229	18,001,813,110	19.93
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	3,846,127,133	2.7844	10,709,156,390	2.8722	11,046,846,351	12.23
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	4,021,839,748	2.4709	9,937,802,135	2.5343	10,192,548,473	11.28
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	7,308,971,051	1.1354	8,298,605,732	1.1422	8,348,306,734	9.24
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックスマザーファンド	4,826,156,130	0.9499	4,584,776,833	0.9321	4,498,460,128	4.98
日本	親投資信託受益証券	新マネー・マーケット・マザーファンド	2,222,650,544	0.9894	2,199,090,449	0.9893	2,198,868,183	2.43

(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

2023 年 12 月 29 日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	81.14
合計	81.14

(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2023年12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1計算期間末日 (2022年6月27日)	136,166,805,951	136,166,805,951	9,479	9,479
第2計算期間末日 (2023年6月26日)	106,790,857,557	106,790,857,557	9,759	9,759
2022年12月末日	130,805,396,903	—	9,217	—
2023年1月末日	121,200,821,708	—	9,288	—
2月末日	118,501,585,920	—	9,363	—
3月末日	112,040,892,870	—	9,336	—
4月末日	108,809,752,643	—	9,412	—
5月末日	106,503,020,212	—	9,544	—
6月末日	106,863,298,414	—	9,807	—
7月末日	103,318,487,096	—	9,786	—
8月末日	101,446,668,178	—	9,780	—
9月末日	98,197,196,817	—	9,675	—
10月末日	93,589,076,809	—	9,514	—
11月末日	92,891,646,618	—	9,717	—
12月末日	90,332,286,278	—	9,770	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	△5.21
第2計算期間	2.95

第3中間計算期間	△0.16
----------	-------

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）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1計算期間	182,050,778,220	38,393,864,258	143,656,913,962
第2計算期間	59,952,533,967	94,184,085,425	109,425,362,504
第3中間計算期間	191,130,193	16,794,805,397	92,821,687,300

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

2023年12月29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	1,175,357,990,550	99.87
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	1,476,177,007	0.13
純資産総額		1,176,834,167,557	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

2023年12月29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	4,116,840,000	0.35

(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

2023年12月29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	19,225,200	1,913.65	36,790,371,738	2,590.50	49,802,880,600	4.23
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,476,700	11,750.57	29,102,659,475	13,410.00	33,212,547,000	2.82
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	21,000,000	884.21	18,568,617,005	1,211.50	25,441,500,000	2.16

日本	株式	キーエンス	電気機器	350,300	62,227.10	21,798,153,706	62,120.00	21,760,636,000	1.85
日本	株式	信越化学工業	化学	3,180,200	4,310.22	13,707,370,518	5,917.00	18,817,243,400	1.60
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	741,000	17,110.78	12,679,089,405	25,255.00	18,713,955,000	1.59
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	104,452,600	161.38	16,857,590,336	172.30	17,997,182,980	1.53
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,699,500	7,427.21	12,622,559,202	10,170.00	17,283,915,000	1.47
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,451,700	5,422.65	13,294,718,742	6,880.00	16,867,696,000	1.43
日本	株式	三菱商事	卸売業	7,340,300	1,729.41	12,694,398,984	2,253.50	16,541,366,050	1.41
日本	株式	任天堂	その他製品	2,210,500	5,342.87	11,810,418,057	7,359.00	16,267,069,500	1.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,664,600	3,920.78	10,447,313,378	5,963.00	15,889,009,800	1.35
日本	株式	三井物産	卸売業	2,791,100	4,152.99	11,591,432,688	5,298.00	14,787,247,800	1.26
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,490,100	4,513.42	11,238,879,715	5,767.00	14,360,406,700	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,107,800	4,317.34	13,417,451,708	4,054.00	12,599,021,200	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	8,538,200	1,201.68	10,260,189,327	1,466.00	12,517,001,200	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,713,500	4,155.52	11,276,019,031	4,486.00	12,172,761,000	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	689,300	14,390.99	9,919,715,161	17,625.00	12,148,912,500	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,408,500	2,675.68	9,120,075,785	3,529.00	12,028,596,500	1.02
日本	株式	第一三共	医薬品	3,059,100	4,618.75	14,129,242,682	3,872.00	11,844,835,200	1.01
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,654,500	1,942.11	9,039,578,360	2,412.50	11,228,981,250	0.95
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,732,200	5,215.20	9,033,785,420	6,293.00	10,900,734,600	0.93
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,904,700	4,536.83	8,641,308,396	5,251.00	10,001,579,700	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	5,650,500	1,568.88	8,864,987,867	1,759.50	9,942,054,750	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	422,200	23,492.30	9,918,449,061	22,985.00	9,704,267,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,185,500	2,627.83	8,370,960,759	2,993.00	9,534,201,500	0.81
日本	株式	SMC	機械	105,800	69,513.53	7,354,532,460	75,760.00	8,015,408,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	3,935,900	1,624.78	6,394,984,008	1,999.00	7,867,864,100	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,094,900	2,849.43	5,969,272,309	3,645.00	7,635,910,500	0.65
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,276,700	5,856.31	7,476,751,853	5,595.00	7,143,136,500	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

2023年12月29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	2.11
	食料品	3.37
	繊維製品	0.40
	パルプ・紙	0.17
	化学	6.18

	医薬品	4.62
	石油・石炭製品	0.46
	ゴム製品	0.69
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.96
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.52
	機械	5.33
	電気機器	17.53
	輸送用機器	8.18
	精密機器	2.36
	その他製品	2.38
	電気・ガス業	1.40
	陸運業	2.84
	海運業	0.84
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.73
	卸売業	6.99
	小売業	4.29
	銀行業	6.87
	証券、商品先物取引業	0.81
	保険業	2.38
	その他金融業	1.15
	不動産業	1.95
	サービス業	4.98
	小計	99.87
合計		99.87

(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

2023年12月29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	174	円	4,108,655,200	4,116,840,000	0.35

(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

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	アメリカ	2,497,856,094,039	68.93
	イギリス	142,695,506,928	3.94
	カナダ	116,109,846,130	3.20
	フランス	107,204,079,227	2.96
	スイス	98,049,374,988	2.71
	ドイツ	83,165,186,951	2.29
	オーストラリア	70,486,505,990	1.95
	オランダ	59,526,328,339	1.64
	デンマーク	32,672,740,744	0.90
	スウェーデン	31,653,566,717	0.87
	スペイン	25,360,864,724	0.70
	香港	19,526,785,856	0.54
	イタリア	19,243,340,714	0.53
	フィンランド	10,700,680,366	0.30
	シンガポール	10,662,726,931	0.29
	ベルギー	7,485,841,048	0.21
	ノルウェー	6,525,878,569	0.18
	アイルランド	5,103,589,366	0.14
	イスラエル	3,707,299,444	0.10
	ニュージーランド	1,997,377,213	0.06
	ルクセンブルグ	1,868,952,895	0.05
ポルトガル	1,854,411,097	0.05	
オーストリア	1,852,612,215	0.05	
バミューダ	580,517,546	0.02	
	小計	3,355,890,108,037	92.60
投資証券	アメリカ	61,423,737,797	1.69
	オーストラリア	4,272,865,140	0.12
	シンガポール	1,505,938,053	0.04
	フランス	1,347,474,330	0.04
	イギリス	1,218,905,627	0.03
	香港	908,892,105	0.03
	ベルギー	319,520,137	0.01
	カナダ	305,389,600	0.01
	小計	71,302,722,789	1.97
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	196,784,656,923	5.43
純資産総額		3,623,977,487,749	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

2023年12月29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	148,242,939,185	4.09
	買建	カナダ	6,639,502,934	0.18
	買建	ドイツ	23,415,680,016	0.65
	買建	オーストラリア	6,397,140,881	0.18
	買建	イギリス	8,242,801,376	0.23
	買建	スイス	5,449,784,860	0.15

(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

2023年12月29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	6,666,960	24,897.21	165,988,755,042	27,455.45	183,044,396,266	5.05
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3,010,119	44,643.17	134,381,264,582	53,225.96	160,216,480,714	4.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	3,960,792	16,469.20	65,231,113,389	21,753.88	86,162,615,261	2.38
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,053,576	44,466.39	46,848,721,692	70,237.05	74,000,072,930	2.04
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,162,102	17,434.82	55,130,687,035	19,888.82	62,890,480,346	1.74
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	948,299	35,217.90	33,397,105,477	50,820.52	48,193,053,606	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,219,019	26,664.36	32,504,364,735	35,908.51	43,773,167,410	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,599,297	16,848.71	26,946,106,865	20,037.74	32,046,301,307	0.88
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	188,923	98,137.71	18,540,470,843	159,191.41	30,074,918,808	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,238,730	19,574.39	24,247,386,443	24,153.64	29,919,849,626	0.83
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	395,096	69,670.45	27,526,517,433	74,446.56	29,413,540,835	0.81

アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	344,420	64,058.72	22,063,106,960	82,381.95	28,373,993,113	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	557,283	46,496.05	25,911,458,938	50,714.15	28,262,135,382	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	685,153	32,956.82	22,580,467,166	36,932.53	25,304,435,097	0.70
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1,709,675	15,078.25	25,778,920,953	14,209.94	24,294,392,334	0.67
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	1,027,864	22,828.31	23,464,399,950	22,207.74	22,826,537,906	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	358,808	54,677.85	19,618,852,208	60,464.96	21,695,313,377	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	427,629	41,429.82	17,716,596,699	49,266.06	21,067,599,735	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,004,805	21,842.56	21,947,515,695	20,668.88	20,768,199,897	0.57
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	1,395,214	12,337.12	17,212,928,575	14,718.05	20,534,837,784	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	172,178	93,831.22	16,155,671,952	107,768.60	18,555,383,388	0.51
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,139,094	19,039.06	21,687,285,879	16,283.94	18,548,949,286	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	188,957	72,558.63	13,710,462,886	94,047.47	17,770,928,356	0.49
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	1,083,709	16,384.68	17,756,226,517	15,426.84	16,718,215,211	0.46
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	753,713	20,739.68	15,631,768,480	21,948.19	16,542,638,014	0.46
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	774,876	22,240.09	17,233,312,709	21,241.87	16,459,822,310	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	194,382	53,236.28	10,348,175,465	84,462.60	16,418,009,424	0.45
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	415,796	29,228.99	12,153,299,726	37,667.21	15,661,875,831	0.43
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	3,054,263	3,924.21	11,985,590,141	4,805.20	14,676,345,789	0.40
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	1,751,098	8,932.19	15,641,141,915	8,332.51	14,591,045,974	0.40

(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

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	4.44
	素材	3.86
	資本財	6.57
	商業・専門サービス	1.50
	運輸	1.74
	自動車・自動車部品	1.97
	耐久消費財・アパレル	1.47
	消費者サービス	2.00
	メディア・娯楽	5.69
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.38
	生活必需品流通・小売り	1.62
	食品・飲料・タバコ	3.34
	家庭用品・パーソナル用品	1.54
	ヘルスケア機器・サービス	4.14
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.53
	銀行	5.21
	金融サービス	6.42
	保険	2.88
	ソフトウェア・サービス	9.59
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.41
電気通信サービス	1.11	
公益事業	2.55	
半導体・半導体製造装置	6.30	
不動産管理・開発	0.34	
	小計	92.60
投資証券	—	1.97
合計		94.57

(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

2023年12月29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	4,326	アメリカドル	1,021,907,138.08	144,937,089,394	1,045,215,675	148,242,939,185	4.09
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602403	買建	244	カナダドル	60,678,101	6,507,119,551	61,912,560	6,639,502,934	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2403	買建	3,279	ユーロ	150,357,168.97	23,624,118,389	149,030,550	23,415,680,016	0.65
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2403	買建	347	オーストラリアドル	64,537,054.25	6,256,222,038	65,990,725	6,397,140,881	0.18
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2403	買建	589	イギリスポンド	45,048,191.25	8,139,307,194	45,620,995	8,242,801,376	0.23
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2403	買建	294	スイスフラン	32,678,623.9	5,497,851,684	32,392,920	5,449,784,860	0.15

(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。

国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

2023年12月29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	158,679,027,930	82.74
地方債証券	日本	10,214,603,620	5.33
特殊債券	日本	9,165,379,807	4.78
社債券	日本	12,879,246,200	6.72
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	840,683,563	0.43
純資産総額		191,778,941,120	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

2023年12月29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	293,420,000	0.15

(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

2023年12月29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 (%)
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	2,940,000,000	99.87	2,936,425,000	99.98	2,939,441,400	0.100000	2027/9/20	1.53
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	2,700,000,000	99.75	2,693,470,000	99.89	2,697,057,000	0.005000	2026/9/20	1.41
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	2,680,000,000	99.76	2,673,728,700	99.94	2,678,499,200	0.005000	2026/3/20	1.40
日本	国債証券	第163回利付国債(5年)	2,600,000,000	100.67	2,617,460,000	100.86	2,622,412,000	0.400000	2028/9/20	1.37
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	2,540,000,000	100.22	2,545,592,900	101.69	2,583,053,000	0.800000	2033/9/20	1.35
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	2,470,000,000	99.94	2,468,518,000	99.92	2,468,172,200	0.005000	2026/6/20	1.29
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	2,200,000,000	100.24	2,205,414,700	100.15	2,203,432,000	0.100000	2025/12/20	1.15
日本	国債証券	第161回利付国債(5年)	1,950,000,000	100.14	1,952,905,500	100.50	1,959,906,000	0.300000	2028/6/20	1.02
日本	国債証券	第156回利付国債(5年)	1,930,000,000	99.64	1,923,228,200	100.27	1,935,307,500	0.200000	2027/12/20	1.01
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,890,000,000	98.92	1,869,752,500	99.03	1,871,704,800	0.100000	2029/12/20	0.98
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	1,880,000,000	98.01	1,842,672,300	98.23	1,846,799,200	0.100000	2030/12/20	0.96
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	1,840,000,000	100.34	1,846,256,000	100.14	1,842,668,000	0.100000	2025/6/20	0.96
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	1,800,000,000	100.32	1,805,814,000	100.14	1,802,592,000	0.100000	2025/3/20	0.94
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	1,800,000,000	99.01	1,782,227,500	99.30	1,787,490,000	0.100000	2029/3/20	0.93
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	1,690,000,000	99.29	1,678,023,300	99.72	1,685,335,600	0.005000	2027/6/20	0.88
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	1,650,000,000	97.94	1,616,095,900	99.48	1,641,552,000	0.500000	2032/12/20	0.86
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	1,670,000,000	96.47	1,611,049,000	97.68	1,631,356,200	0.100000	2031/6/20	0.85
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	1,600,000,000	99.41	1,590,706,600	99.46	1,591,408,000	0.100000	2028/9/20	0.83
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	1,570,000,000	97.39	1,529,053,200	98.49	1,546,293,000	0.100000	2030/9/20	0.81
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	1,580,000,000	96.19	1,519,940,800	97.67	1,543,233,400	0.200000	2032/3/20	0.80
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	1,570,000,000	96.01	1,507,360,800	97.39	1,529,054,400	0.100000	2031/9/20	0.80
日本	国債証券	第453回利付国債(2年)	1,470,000,000	99.80	1,467,081,300	99.97	1,469,603,100	0.005000	2025/10/1	0.77
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	1,450,000,000	97.61	1,415,404,000	97.96	1,420,521,500	0.100000	2031/3/20	0.74
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,400,000,000	100.02	1,400,296,000	99.74	1,396,486,000	0.100000	2028/3/20	0.73
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	1,240,000,000	96.16	1,192,458,500	97.40	1,207,846,800	0.200000	2032/6/20	0.63
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	1,200,000,000	100.16	1,201,920,000	99.92	1,199,052,000	0.100000	2027/12/20	0.63
日本	国債証券	第143回利付国債(20年)	1,080,000,000	111.68	1,206,156,500	109.15	1,178,841,600	1.600000	2033/3/20	0.61
日本	国債証券	第116回利付国債(20年)	1,050,000,000	113.85	1,195,467,000	111.81	1,174,036,500	2.200000	2030/3/20	0.61
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	1,050,000,000	109.04	1,144,962,000	109.19	1,146,516,000	1.600000	2033/12/20	0.60

日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	1,160,000,000	96.91	1,124,156,000	97.12	1,126,638,400	0.100000	2031/12/20	0.59
----	------	----------------	---------------	-------	---------------	-------	---------------	----------	------------	------

(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

2023年12月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	82.74
地方債証券	5.33
特殊債券	4.78
社債券	6.72
合計	99.56

(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

2023年12月29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	2	円	291,201,870	293,420,000	0.15

(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。

日本短期債券マザーファンド

投資状況

2023年12月29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	11,997,598,000	59.28
地方債証券	日本	99,908,000	0.49
特殊債券	日本	700,529,000	3.46
社債券	日本	6,699,832,150	33.11
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	739,448,839	3.66
純資産総額		20,237,315,989	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

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452回利付国債(2年)	2,700,000,000	99.96	2,699,015,000	99.99	2,699,757,000	0.005000	2025/9/1	13.34
日本	国債証券	第449回利付国債(2年)	2,000,000,000	99.96	1,999,240,000	100.02	2,000,420,000	0.005000	2025/6/1	9.88
日本	国債証券	第453回利付国債(2年)	2,000,000,000	99.94	1,998,880,000	99.97	1,999,460,000	0.005000	2025/10/1	9.88
日本	国債証券	第456回利付国債(2年)	1,500,000,000	100.10	1,501,605,000	100.10	1,501,635,000	0.100000	2026/1/1	7.42
日本	国債証券	第455回利付国債(2年)	1,400,000,000	99.82	1,397,493,000	99.96	1,399,454,000	0.005000	2025/12/1	6.92
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	1,000,000,000	99.83	998,320,000	99.85	998,520,000	0.005000	2026/12/20	4.93
日本	国債証券	第151回利付国債(5年)	500,000,000	99.79	498,955,000	99.80	499,040,000	0.005000	2027/3/20	2.47
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	500,000,000	99.43	497,190,000	99.72	498,620,000	0.005000	2027/6/20	2.46
日本	国債証券	第454回利付国債(2年)	400,000,000	100.12	400,480,000	100.17	400,692,000	0.100000	2025/11/1	1.98
日本	特殊債券	第72回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	200,000,000	100.65	201,308,000	100.54	201,094,000	0.529000	2025/5/28	0.99
日本	社債券	第24回ルノー	200,000,000	100.54	201,089,000	100.38	200,766,000	1.540000	2024/7/5	0.99
日本	社債券	第12回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	200,000,000	100.00	200,000,000	100.05	200,100,000	1.377000	2027/12/1	0.99
日本	社債券	第184回東日本旅客鉄道	200,000,000	99.87	199,746,000	99.91	199,838,000	0.210000	2025/10/14	0.99
日本	特殊債券	第99回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	200,000,000	99.73	199,464,000	99.87	199,744,000	0.225000	2027/8/27	0.99
日本	社債券	第483回東北電力	200,000,000	99.94	199,880,000	99.86	199,736,000	0.300000	2026/5/25	0.99
日本	社債券	第22回大和ハウス工業(グリーン)	200,000,000	99.69	199,384,000	99.83	199,666,000	0.130000	2025/9/12	0.99
日本	社債券	第12回アサヒグループホールディングス	200,000,000	99.47	198,948,000	99.75	199,518,000	0.330000	2027/6/11	0.99
日本	社債券	第1回サントアンデル銀行(2019)	200,000,000	99.88	199,774,000	99.75	199,512,000	0.463000	2024/12/5	0.99
日本	特殊債券	第287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	99.78	199,566,000	99.71	199,438,000	0.091000	2026/9/11	0.99
日本	社債券	第81回ホンダファイナンス	200,000,000	99.29	198,586,000	99.53	199,062,000	0.389000	2028/6/20	0.98
日本	社債券	第18回デンソー	200,000,000	99.44	198,882,000	99.44	198,884,000	0.315000	2028/3/17	0.98
日本	社債券	第19回三井住友信託銀行	200,000,000	99.52	199,042,000	99.44	198,882,000	0.140000	2026/4/28	0.98
日本	社債券	第17回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	99.18	198,364,000	99.43	198,864,000	0.340000	2026/7/31	0.98
日本	社債券	第15回セブン&アイ・ホールディングス	200,000,000	99.23	198,476,000	99.36	198,720,000	0.280000	2027/12/20	0.98
日本	社債券	第19回日立製作	200,000,000	99.09	198,184,000	99.25	198,514,000	0.160000	2027/3/12	0.98

		所								
日本	社債券	第508回関西電力	105,000,000	99.56	104,539,050	99.98	104,982,150	0.455000	2027/4/23	0.52
日本	社債券	第27回野村ホールディングス	100,000,000	103.46	103,466,000	102.58	102,585,000	2.107000	2025/9/24	0.51
日本	社債券	第12回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	100.90	100,904,000	100.80	100,801,000	0.781000	2025/6/20	0.50
日本	社債券	第63回神戸製鋼所	100,000,000	100.80	100,804,000	100.69	100,697,000	0.924000	2025/5/21	0.50
日本	社債券	第69回アコム	100,000,000	100.89	100,890,000	100.68	100,684,000	1.210000	2024/9/26	0.50

(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

2023年12月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	59.28
地方債証券	0.49
特殊債券	3.46
社債券	33.11
合計	96.35

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2023年12月29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	237,782,196,021	46.03
	フランス	43,375,040,388	8.40
	イタリア	38,830,566,166	7.52
	中国	38,210,120,427	7.40
	ドイツ	31,940,165,030	6.18
	イギリス	27,016,042,469	5.23
	スペイン	26,745,460,579	5.18
	カナダ	10,224,741,278	1.98
	ベルギー	9,204,104,483	1.78

	オランダ	7,739,240,986	1.50
	オーストラリア	7,145,760,117	1.38
	オーストリア	6,208,254,548	1.20
	メキシコ	4,591,132,739	0.89
	アイルランド	2,996,457,556	0.58
	フィンランド	2,660,232,772	0.51
	ポーランド	2,583,303,147	0.50
	マレーシア	2,573,047,033	0.50
	シンガポール	2,187,594,873	0.42
	イスラエル	1,522,502,924	0.29
	デンマーク	1,393,288,661	0.27
	ニュージーランド	1,227,864,889	0.24
	スウェーデン	995,943,860	0.19
	ノルウェー	857,734,147	0.17
	小計	508,010,795,093	98.34
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	8,587,312,206	1.66
純資産総額		516,598,107,299	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

2023年12月29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	13,479.48	2,242,987,114	14,216.24	2,365,582,565	3.875000	2033/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	16,100,000	13,652.64	2,198,075,166	13,657.78	2,198,903,510	3.375000	2033/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	15,100,000	15,009.16	2,266,383,172	14,462.78	2,183,880,051	4.125000	2032/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	18,100,000	12,103.67	2,190,766,078	11,810.39	2,137,681,416	1.375000	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	17,720,000	12,064.96	2,137,912,394	11,768.56	2,085,389,857	1.250000	2031/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	15,100,000	14,308.20	2,160,539,592	13,799.33	2,083,700,157	3.500000	2033/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	16,860,000	12,506.66	2,108,623,770	12,229.51	2,061,895,940	1.875000	2032/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	15,480,000	13,612.42	2,107,204,070	13,182.71	2,040,683,621	2.875000	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	16,640,000	12,478.79	2,076,471,644	12,192.94	2,028,906,516	1.625000	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	15,460,000	13,362.73	2,065,879,142	13,029.52	2,014,364,298	2.750000	2032/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	16,730,000	11,920.81	1,994,351,764	11,675.21	1,953,263,111	0.875000	2030/11/15	0.38

アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	16,360,000	11,982.91	1,960,404,754	11,860.53	1,940,383,322	1.125000	2031/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	16,160,000	11,684.17	1,888,162,187	11,521.74	1,861,914,541	0.625000	2030/8/15	0.36
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	10,320,000	15,862.45	1,637,005,498	16,038.65	1,655,188,936	2.750000	2027/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	11,490,000	13,635.62	1,566,733,294	13,642.82	1,567,560,834	2.000000	2025/8/15	0.30
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	9,590,000	15,644.31	1,500,289,588	15,994.70	1,533,892,307	2.500000	2030/5/25	0.30
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	11,540,000	13,212.35	1,524,705,298	13,154.45	1,518,024,165	1.500000	2027/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	4.125 T-BOND 530815	10,020,000	13,095.69	1,312,188,592	14,478.84	1,450,780,626	4.125000	2053/8/15	0.28
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	9,750,000	14,378.21	1,401,876,019	14,793.94	1,442,409,915	0.750000	2028/5/25	0.28
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	9,560,000	14,445.52	1,380,992,030	14,924.56	1,426,788,098	1.500000	2031/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	10,290,000	13,687.14	1,408,407,630	13,655.29	1,405,129,618	2.250000	2025/11/15	0.27
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	12,090,000	11,787.95	1,425,163,956	11,607.62	1,403,361,507	0.625000	2030/5/15	0.27
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	10,310,000	13,762.25	1,418,888,388	13,570.80	1,399,149,905	2.875000	2028/8/15	0.27
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	10,090,000	13,823.95	1,394,837,386	13,600.72	1,372,312,781	2.875000	2028/5/15	0.27
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 261031	10,450,000	13,053.70	1,364,112,276	13,080.77	1,366,940,507	1.125000	2026/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	5 T-NOTE 251031	9,500,000	14,212.82	1,350,218,055	14,339.23	1,362,227,282	5.000000	2025/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 251031	10,300,000	13,034.23	1,342,525,942	13,164.42	1,355,936,068	0.250000	2025/10/31	0.26
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	9,990,000	13,786.87	1,377,308,632	13,558.89	1,354,533,364	2.750000	2028/2/15	0.26
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280930	10,700,000	12,690.94	1,357,931,479	12,568.02	1,344,778,315	1.250000	2028/9/30	0.26
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 251130	10,150,000	13,050.02	1,324,577,243	13,161.38	1,335,880,149	0.375000	2025/11/30	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

2023年12月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.34
合計	98.34

(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。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2023年12月29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	146,280,365,642	45.03
	フランス	26,482,204,383	8.15
	イタリア	23,764,579,225	7.32
	中国	23,460,463,734	7.22
	ドイツ	20,824,139,491	6.41
	イギリス	16,421,298,544	5.05
	スペイン	15,400,115,531	4.74
	カナダ	6,179,887,592	1.90
	ベルギー	5,639,731,988	1.74
	オランダ	4,806,283,838	1.48
	オーストラリア	4,519,770,191	1.39
	オーストリア	3,758,249,509	1.16
	メキシコ	2,773,115,349	0.85
	アイルランド	1,846,012,339	0.57
	フィンランド	1,692,844,939	0.52
	ポーランド	1,627,068,620	0.50
	マレーシア	1,592,577,017	0.49
	シンガポール	1,303,221,208	0.40
	イスラエル	934,988,809	0.29
	デンマーク	909,580,046	0.28
ニュージーランド	712,646,874	0.22	
スウェーデン	651,375,131	0.20	
ノルウェー	545,890,141	0.17	
	小計	312,126,410,141	96.08
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	12,728,998,783	3.92
純資産総額		324,855,408,924	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

2023年12月29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	4.125 T-NOTE 321115	10,640,000	15,004.19	1,596,446,422	14,462.78	1,538,839,982	4.125000	2032/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	10,600,000	13,326.71	1,412,631,693	13,029.52	1,381,129,466	2.750000	2032/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	9,650,000	13,990.75	1,350,107,569	13,799.33	1,331,636,193	3.500000	2033/2/15	0.41

アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	9,730,000	13,673.21	1,330,403,545	13,657.78	1,328,902,555	3.375000	2033/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	11,260,000	11,937.83	1,344,199,782	11,768.56	1,325,140,508	1.250000	2031/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	9,900,000	13,594.40	1,345,846,144	13,182.71	1,305,088,362	2.875000	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	11,200,000	11,623.24	1,301,803,675	11,521.74	1,290,435,820	0.625000	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	10,400,000	12,452.67	1,295,078,096	12,229.51	1,271,869,381	1.875000	2032/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	10,280,000	12,300.86	1,264,528,481	12,192.94	1,253,435,035	1.625000	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	10,390,000	12,030.02	1,249,919,140	11,810.39	1,227,099,995	1.375000	2031/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	10,300,000	12,011.58	1,237,193,018	11,860.53	1,221,634,976	1.125000	2031/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	10,300,000	11,625.23	1,197,399,066	11,675.21	1,202,546,923	0.875000	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	8,010,000	13,432.45	1,075,939,573	14,216.24	1,138,720,932	3.875000	2033/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280630	8,170,000	12,408.23	1,013,752,759	12,645.86	1,033,166,918	1.250000	2028/6/30	0.32
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 250131	7,200,000	14,225.54	1,024,239,528	14,090.20	1,014,494,475	4.125000	2025/1/31	0.31
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 250815	7,300,000	13,967.49	1,019,627,217	13,894.63	1,014,308,050	3.125000	2025/8/15	0.31
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	6,300,000	15,688.43	988,371,216	15,994.70	1,007,666,479	2.500000	2030/5/25	0.31
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280531	7,950,000	12,702.29	1,009,832,437	12,666.63	1,006,997,712	1.250000	2028/5/31	0.31
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 250228	7,000,000	14,235.47	996,483,397	14,176.35	992,344,620	4.625000	2025/2/28	0.31
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	8,200,000	11,574.37	949,099,130	11,607.62	951,825,010	0.625000	2030/5/15	0.29
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	7,200,000	13,102.25	943,362,389	13,154.45	947,120,796	1.500000	2027/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280930	7,300,000	12,519.82	913,946,985	12,568.02	917,465,580	1.250000	2028/9/30	0.28
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	6,650,000	13,649.47	907,690,113	13,558.89	901,666,353	2.750000	2028/2/15	0.28
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	6,070,000	14,370.08	872,263,898	14,793.94	897,992,634	0.750000	2028/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	6,600,000	13,669.48	902,186,303	13,600.72	897,647,607	2.875000	2028/5/15	0.28
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	5,870,000	14,516.31	852,107,797	14,924.56	876,071,772	1.500000	2031/5/25	0.27
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	6,400,000	13,570.80	868,531,464	13,655.29	873,938,731	2.250000	2025/11/15	0.27
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 260731	6,700,000	12,830.56	859,647,540	12,984.37	869,952,808	0.625000	2026/7/31	0.27
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 260131	6,600,000	12,797.66	844,645,851	13,093.51	864,171,848	0.375000	2026/1/31	0.27
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 280831	6,900,000	12,531.62	864,682,128	12,520.65	863,925,035	1.125000	2028/8/31	0.27

(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

2023年12月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.08

合計	96.08
----	-------

(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。

新マネー・マーケット・マザーファンド

投資状況

2023年12月29日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,399,261,971	100.00
純資産総額		2,399,261,971	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

該当事項はありません。

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

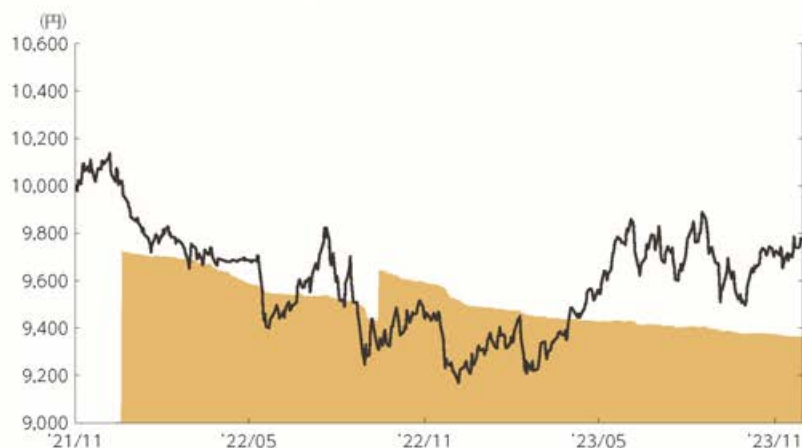
《参考情報》



運用実績

2023年12月29日現在

■基準価額・純資産の推移 2021年11月30日(設定日)～2023年12月29日



- 基準価額は10,000を起点として表示
- 基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	9,770円
純資産総額	903.3億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2023年 6月	0円
2022年 6月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

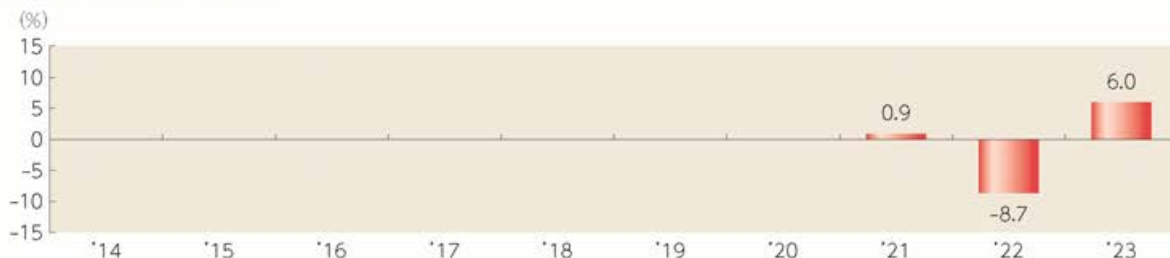
■主要な資産の状況

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	12.2%	1 円	67.6%	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	1.1%
国内債券	24.2%	2 アメリカドル	21.0%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
外国株式	19.9%	3 ユーロ	5.8%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.5%
外国債券	20.0%	4 イギリスポンド	1.5%	AMAZON.COM INC	株式	一般消費財・サービス流通・小売り	アメリカ	0.5%
		5 カナダドル	0.9%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	0.4%
		6 中国元	0.8%	第452回利付国債(2年)	債券	国債	日本	2.7%
		7 オーストラリアドル	0.6%	第453回利付国債(2年)	債券	国債	日本	2.0%
		8 スイスフラン	0.6%	第449回利付国債(2年)	債券	国債	日本	2.0%
コールローン他 (負債控除後)	23.7%	9 デンマーククローネ	0.2%	第456回利付国債(2年)	債券	国債	日本	1.5%
合計	100.0%	10 スウェーデンクローネ	0.2%	第455回利付国債(2年)	債券	国債	日本	1.4%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.2%
債券先物取引 (買建)	0.0%

- 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)
- 投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示
- 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



- 収益率は基準価額で計算
- 2021年は設定日から年末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。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

ありません。

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に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

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、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、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。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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/>

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6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およびすでに受け付けた解約請求の受付を取り消すことがあります。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す。

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）

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2031年6月25日まで(2021年11月30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6月26日から翌年6月25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10億口を下回るようになった場合
- ・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信託約款の変更等

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または受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容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(信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。)、信託約款の変更または併合

(変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。)をしようとする場合には、書面による決議(「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

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違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、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。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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 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（2022 年 6 月 28 日から 2023 年 6 月 26 日まで）の財務諸表について、PwC あらた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

2023年8月30日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

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」に掲げられているダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2022年6月28日から2023年6月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2023年6月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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国際投信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国際投信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】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 [2022年6月27日現在]	第2期 [2023年6月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,998,568,618	2,505,520,767
親投資信託受益証券	70,353,622,910	104,869,592,625
流動資産合計	137,352,191,528	107,375,113,392
資産合計	137,352,191,528	107,375,113,392
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,056,322,916	482,223,909
未払受託者報酬	19,770,084	15,638,525
未払委託者報酬	106,758,315	84,447,980
未払利息	82,857	6,297
その他未払費用	2,451,405	1,939,124
流動負債合計	1,185,385,577	584,255,835
負債合計	1,185,385,577	584,255,835
純資産の部		
元本等		
元本	143,656,913,962	109,425,362,504
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△7,490,108,011	△2,634,504,947
(分配準備積立金)	253,557,476	1,420,806,813
元本等合計	136,166,805,951	106,790,857,557
純資産合計	136,166,805,951	106,790,857,557
負債純資産合計	137,352,191,528	107,375,113,392

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年6月27日	第2期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26日
営業収益		
受取利息	22,668	182,690
有価証券売買等損益	△8,943,819,913	3,242,197,890
営業収益合計	△8,943,797,245	3,242,380,580
営業費用		
支払利息	3,932,228	6,560,433
受託者報酬	19,770,084	34,591,555
委託者報酬	106,758,315	186,794,273

その他費用	2,451,405	4,289,236
営業費用合計	132,912,032	232,235,497
営業利益又は営業損失(△)	△9,076,709,277	3,010,145,083
経常利益又は経常損失(△)	△9,076,709,277	3,010,145,083
当期純利益又は当期純損失(△)	△9,076,709,277	3,010,145,083
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	△1,305,651,306	△672,155,645
期首剰余金又は期首欠損金(△)	-	△7,490,108,011
剰余金増加額又は欠損金減少額	358,123,200	5,262,893,581
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	5,262,893,581
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	358,123,200	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	77,173,240	4,089,591,245
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	77,173,240	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,089,591,245
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△7,490,108,011	△2,634,504,947

(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。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年6月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間および当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2022年6月28日から2023年6月26日までとなっております。

(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計算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)

	第1期 [2022年6月27日現在]	第2期 [2023年6月26日現在]
1. 期首元本額	10,000,000円	143,656,913,962円
期中追加設定元本額	182,040,778,220円	59,952,533,967円
期中一部解約元本額	38,393,864,258円	94,184,085,425円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	7,490,108,011円	2,634,504,947円
3. 受益権の総数	143,656,913,962口	109,425,362,504口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自2021年11月30日 至2022年6月27日	第2期 自2022年6月28日 至2023年6月26日													
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程													
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>253,557,476円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	253,557,476円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,294,518,713円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,294,518,713円	
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	253,557,476円												
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	1,294,518,713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	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	77,614,098円	収益調整金額	C	169,320,161円
分配準備積立金額	D	—円	分配準備積立金額	D	126,288,100円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	331,171,574円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,590,126,974円
当ファンドの期末残存口数	F	143,656,913,962口	当ファンドの期末残存口数	F	109,425,362,504口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	23円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	145円
1万口当たり分配金額	H	—円	1万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—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	第1期 自 2021年 11月 30日 至 2022年 6月 27日	第2期 自 2022年 6月 28日 至 2023年 6月 26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。 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、この結果は運用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。	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	第1期 [2022年 6月 27日現在]	第2期 [2023年 6月 26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	同左

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	第1期 [2022年6月27日現在]	第2期 [2023年6月26日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当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	△2,046,335,476	4,822,215,132
合計	△2,046,335,476	4,822,215,132

(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)

	第1期 [2022年6月27日現在]	第2期 [2023年6月26日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9479円 (9,479円)	0.9759円 (9,759円)

(追加情報)

第1期 自2021年11月30日 至2022年6月27日	第2期 自2022年6月28日 至2023年6月26日
—	当ファンドは、主要投資対象の変更を行うことを2022年8月30日付で社内規定に基づき決裁しました。 当ファンドは、2022年10月6日付で「国内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」および「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」を新たな主要投資対象として追加し、マザーファンドへの投資を通じて、わが国の社債および先進国の公社債にも投資を行います。

(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	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	15,947,260,113	18,108,113,858	
	国内債券インデックスマザーファンド	31,446,440,263	30,056,507,603	

	TOPIXマザーファンド	9,294,727,093	25,183,133,585	
	外国株式インデックスマザーファンド	4,165,374,904	22,581,746,967	
	外国債券インデックスマザーファンド	3,628,136,282	8,940,090,612	
	合計	64,481,938,655	104,869,592,625	

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)

[2023年6月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	76,083,545,376
株式	1,075,163,359,280
派生商品評価勘定	186,735,800
未収配当金	3,924,695,891
未収利息	2,914,911
その他未収収益	26,006,039
差入委託証拠金	547,170,000
流動資産合計	1,155,934,427,297
資産合計	1,155,934,427,297
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,518,750
前受金	152,295,000
未払金	959,708,729
未払解約金	648,830,914
未払利息	191,230
受入担保金	64,837,099,702
流動負債合計	66,657,644,325
負債合計	66,657,644,325
純資産の部	
元本等	

元本	402,039,788,052
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	687,236,994,920
元本等合計	1,089,276,782,972
純資産合計	1,089,276,782,972
負債純資産合計	1,155,934,427,297

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)

	[2023年6月26日現在]
1. 期首	2022年6月28日
期首元本額	347,366,412,983円
期中追加設定元本額	201,639,880,314円
期中一部解約元本額	146,966,505,245円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,638,957,425円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	903,072,880円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,817,730,531円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,568,146,782円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,390,239,232円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	6,966,612,738円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	37,297,943,860円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	41,738,955,360円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	96,533,572円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	264,842,858円
ファンド・マネジャー(国内株式)	731,452,099円
eMAXIS TOPIXインデックス	6,893,871,434円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,087,680,777円
eMAXIS バランス(波乗り型)	476,402,217円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,851,822,132円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	921,638,863円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	1,077,044,161円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	945,863,188円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	29,203,961,086円
国内株式セレクション(ラップ向け)	4,580,365,191円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	9,472,912,978円
つみたて日本株式(TOPIX)	7,471,977,362円
つみたて8資産均等バランス	4,587,666,454円
つみたて4資産均等バランス	1,543,106,837円

eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,457,401円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,022,003円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,885,695円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	725,643,736円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	834,897,786円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	548,550,481円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	471,464,480円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,617,301,987円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	3,356,335,116円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	975,321,409円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	2,981,362,734円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	471,229,727円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	155,431,077円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	18,124,722,587円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	197,951,134円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,524,204,414円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	117,389,601円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,400,648,128円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	905,888,916円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	18,684,961円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	9,294,727,093円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	103,429,692円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	15,914,348円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	36,370,060円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	1,176,815,908円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,655,638,690円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	455,981,398円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1,225,964,506円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	434,359,021円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	19,645,360円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	120,038,676円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	641,959,754円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	132,676,246円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	157,119,720円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	561,966,552円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	468,740,090円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	903,137,813円
三菱UFJ トピックスオープン	966,827,474円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,973,654,894円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	55,822,356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)	5,044,006,202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)	53,369円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	8,695,523円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,488,571,417円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	85,873,164円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,456,769,602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)	42,698,733,597 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	222,985,190 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	247,176 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	123,683 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	230,252,036 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	416,123,045 円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,542,034,313 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)	3,416,494,428 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)	1,057,868,144 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)	492,024,380 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	86,023,427 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)	3,633,047,430 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)	153,013,021 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)	3,150,169,956 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)	338,542,601 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)	16,687,264,139 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)	91,744,324 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)	200,445 円
日米コアバランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	141,205,962 円
日本株式インデックスファンドS	1,170,240,235 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)	111,824,554 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)	378,945,330 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)	787,168,405 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

格機関投資家限定)	
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)	34,833,616 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)	34,841,898 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)	35,903,993 円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	4,954,349,501 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	3,002,365 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	8,108,872 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	2,157,702 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	6,216,082 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	549,851,272 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	98,813,930 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,259,273 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	34,173,377 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,805,103 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	24,413,890 円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,575,922,222 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)	361,378,540 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)	1,529,185,224 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)	1,436,173,022 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)	1,312,774,769 円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	57,216,556,538 円
合計	402,039,788,052 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 す。 株式	60,760,821,670 円
3. 受益権の総数	402,039,788,052 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 2022 年 6 月 28 日 至 2023 年 6 月 26 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

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
-------------------	--

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年 6月 26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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
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	[2023年 6月 26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	133,875,950,722
合計	133,875,950,722

(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

[2023年 6月 26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	14,958,365,000	—	15,085,950,000	127,585,000
合計		14,958,365,000	—	15,085,950,000	127,585,000

(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)

	[2023年6月26日現在]
1口当たり純資産額	2,7094円
(1万口当たり純資産額)	(27,094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	17,700	3,605.00	63,808,500	
1332	ニッスイ	466,700	659.00	307,555,300	
1333	マルハニチロ	69,300	2,450.00	169,785,000	
1375	雪国まいたけ	39,700	989.00	39,263,300	貸付有価証券 3,700株
1376	カネコ種苗	14,300	1,465.00	20,949,500	
1377	サカタのタネ	53,100	4,150.00	220,365,000	
1379	ホクト	41,500	1,838.00	76,277,000	
1384	ホクリョウ	3,900	857.00	3,342,300	貸付有価証券 200株
1514	住石ホールディングス	51,000	351.00	17,901,000	貸付有価証券 23,200株
1515	日鉄鉱業	18,700	4,185.00	78,259,500	
1518	三井松島ホールディングス	21,100	2,555.00	53,910,500	貸付有価証券 3,000株
1605	I N P E X	1,726,000	1,606.00	2,771,956,000	
1662	石油資源開発	54,100	4,265.00	230,736,500	貸付有価証券 7,900株
1663	K&Oエナジーグループ	21,200	2,295.00	48,654,000	
1414	ショーボンドホールディングス	63,600	5,722.00	363,919,200	
1417	ミライト・ワン	154,300	1,808.00	278,974,400	
1419	タマホーム	29,300	3,280.00	96,104,000	貸付有価証券 2,900株
1420	サンヨーホームズ	3,300	724.00	2,389,200	
1429	日本アクア	11,600	851.00	9,871,600	貸付有価証券 2,400株
1430	ファーストコーポレーション	7,100	770.00	5,467,000	

1433	ベステラ	6,000	1,132.00	6,792,000	
1435	Robot Home	79,400	195.00	15,483,000	
1446	キャンディル	4,300	579.00	2,489,700	
1712	ダイセキ環境ソリューション	5,600	1,030.00	5,768,000	
1716	第一カッター興業	11,900	1,419.00	16,886,100	
1719	安藤・間	270,400	1,043.00	282,027,200	貸付有価証券 13,700株
1720	東急建設	132,900	729.00	96,884,100	
1721	コムシスホールディングス	158,000	2,790.50	440,899,000	貸付有価証券 21,300株
1726	ビーアールホールディングス	74,100	394.00	29,195,400	貸付有価証券 6,500株
1762	高松コンストラクショングループ	30,300	2,489.00	75,416,700	
1766	東建コーポレーション	13,400	7,450.00	99,830,000	貸付有価証券 1,800株
1768	ソネック	3,000	968.00	2,904,000	
1780	ヤマウラ	23,600	1,161.00	27,399,600	
1786	オリエンタル白石	167,700	312.00	52,322,400	
1801	大成建設	305,500	4,891.00	1,494,200,500	貸付有価証券 46,400株
1802	大林組	1,167,500	1,206.00	1,408,005,000	
1803	清水建設	981,500	893.20	876,675,800	
1805	飛島建設	36,100	1,226.00	44,258,600	
1808	長谷工コーポレーション	337,000	1,729.50	582,841,500	
1810	松井建設	30,500	683.00	20,831,500	貸付有価証券 5,500株
1811	銭高組	2,500	3,100.00	7,750,000	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	723,800	2,095.50	1,516,722,900	
1813	不動テトラ	22,600	1,808.00	40,860,800	
1814	大末建設	7,100	1,327.00	9,421,700	貸付有価証券 1,600株
1815	鉄建建設	23,400	2,032.00	47,548,800	
1820	西松建設	55,400	3,487.00	193,179,800	貸付有価証券 16,300株
1821	三井住友建設	263,200	365.00	96,068,000	
1822	大豊建設	13,500	3,870.00	52,245,000	貸付有価証券 400株
1826	佐田建設	14,500	453.00	6,568,500	
1827	ナカノフドー建設	16,100	377.00	6,069,700	貸付有価証券 3,800株
1833	奥村組	52,900	4,035.00	213,451,500	

1835	東鉄工業	44,900	2,647.00	118,850,300	
1847	イチケン	4,900	1,924.00	9,427,600	貸付有価証券 1,000株
1848	富士ピー・エス	8,700	446.00	3,880,200	
1852	浅沼組	26,100	3,200.00	83,520,000	
1860	戸田建設	401,600	798.90	320,838,240	貸付有価証券 57,600株
1861	熊谷組	54,600	3,070.00	167,622,000	
1866	北野建設	4,100	3,020.00	12,382,000	貸付有価証券 800株
1867	植木組	5,500	1,384.00	7,612,000	
1870	矢作建設工業	44,400	1,204.00	53,457,600	
1871	ピーエス三菱	41,400	751.00	31,091,400	貸付有価証券 2,700株
1873	日本ハウスホールディングス	64,700	373.00	24,133,100	貸付有価証券 13,700株
1879	新日本建設	45,800	1,224.00	56,059,200	貸付有価証券 5,900株
1882	東亜道路工業	13,000	4,500.00	58,500,000	
1884	日本道路	6,600	9,070.00	59,862,000	
1885	東亜建設工業	28,000	3,055.00	85,540,000	
1887	日本国土開発	97,800	574.00	56,137,200	
1888	若築建設	14,500	3,225.00	46,762,500	貸付有価証券 2,500株
1890	東洋建設	105,700	1,061.00	112,147,700	
1893	五洋建設	462,800	765.00	354,042,000	
1898	世紀東急工業	41,900	1,377.00	57,696,300	
1899	福田組	12,300	4,795.00	58,978,500	
1911	住友林業	250,500	3,452.00	864,726,000	
1914	日本基礎技術	14,800	498.00	7,370,400	貸付有価証券 4,700株
1921	巴コーポレーション	24,500	476.00	11,662,000	貸付有価証券 6,200株
1925	大和ハウス工業	912,300	3,800.00	3,466,740,000	貸付有価証券 137,400株
1926	ライト工業	60,400	1,938.00	117,055,200	
1928	積水ハウス	989,700	2,842.00	2,812,727,400	
1929	日特建設	31,100	1,017.00	31,628,700	
1930	北陸電気工事	22,400	936.00	20,966,400	
1934	ユアテック	71,900	842.00	60,539,800	貸付有価証券 7,900株
1938	日本リーテック	28,700	1,385.00	39,749,500	貸付有価証券

					2,900株
1939	四電工	13,700	2,130.00	29,181,000	
1941	中電工	50,700	2,276.00	115,393,200	
1942	関電工	178,900	1,123.00	200,904,700	貸付有価証券 6,600株
1944	きんでん	229,800	1,936.00	444,892,800	貸付有価証券 33,000株
1945	東京エネシス	32,500	971.00	31,557,500	
1946	トーエネック	10,800	3,590.00	38,772,000	
1949	住友電設	31,000	3,015.00	93,465,000	貸付有価証券 3,900株
1950	日本電設工業	53,600	1,944.00	104,198,400	
1951	エクシオグループ	150,400	2,820.00	424,128,000	貸付有価証券 21,000株
1952	新日本空調	18,100	2,242.00	40,580,200	貸付有価証券 6,500株
1959	九電工	79,400	3,837.00	304,657,800	貸付有価証券 9,700株
1961	三機工業	72,400	1,511.00	109,396,400	
1963	日揮ホールディングス	322,900	1,802.50	582,027,250	
1964	中外炉工業	10,700	2,043.00	21,860,100	
1967	ヤマト	16,100	939.00	15,117,900	貸付有価証券 2,500株
1968	太平電業	20,300	4,255.00	86,376,500	貸付有価証券 400株
1969	高砂熱学工業	78,700	2,428.00	191,083,600	
1972	三晃金属工業	2,700	4,220.00	11,394,000	
1975	朝日工業社	13,500	2,316.00	31,266,000	
1976	明星工業	56,100	947.00	53,126,700	
1979	大気社	37,600	3,935.00	147,956,000	
1980	ダイダン	21,500	2,675.00	57,512,500	貸付有価証券 3,300株
1982	日比谷総合設備	28,000	2,173.00	60,844,000	
3267	フィル・カンパニー	5,800	933.00	5,411,400	
5074	テスホールディングス	35,200	1,143.00	40,233,600	
5076	インフロニア・ホールディングス	342,100	1,329.00	454,650,900	
6330	東洋エンジニアリング	43,200	574.00	24,796,800	
6379	レイズネクスト	47,200	1,440.00	67,968,000	
2001	ニッポン	88,300	1,838.00	162,295,400	
2002	日清製粉グループ本社	303,100	1,825.00	553,157,500	貸付有価証券 50,200株

2003	日東富士製粉	5,800	4,700.00	27,260,000	
2004	昭和産業	28,600	2,665.00	76,219,000	
2009	鳥越製粉	15,600	611.00	9,531,600	貸付有価証券 4,000株
2053	中部飼料	45,400	1,060.00	48,124,000	
2060	フィード・ワン	47,900	722.00	34,583,800	
2107	東洋精糖	3,700	1,576.00	5,831,200	貸付有価証券 800株
2108	日本甜菜製糖	19,100	1,828.00	34,914,800	
2109	DM三井製糖ホールディングス	32,500	2,687.00	87,327,500	
2112	塩水港精糖	25,700	207.00	5,319,900	貸付有価証券 4,800株
2117	ウェルネオシュガー	16,900	1,987.00	33,580,300	
2201	森永製菓	59,900	4,536.00	271,706,400	
2204	中村屋	8,200	3,070.00	25,174,000	
2206	江崎グリコ	93,700	3,863.00	361,963,100	
2207	名糖産業	12,900	1,628.00	21,001,200	
2209	井村屋グループ	17,900	2,238.00	40,060,200	貸付有価証券 600株
2211	不二家	22,500	2,456.00	55,260,000	貸付有価証券 2,500株
2212	山崎製パン	219,300	1,993.00	437,064,900	貸付有価証券 25,900株
2215	第一屋製パン	3,700	389.00	1,439,300	貸付有価証券 800株
2217	モロゾフ	10,600	3,635.00	38,531,000	
2220	亀田製菓	20,800	4,245.00	88,296,000	貸付有価証券 2,500株
2222	寿スピリッツ	34,900	10,660.00	372,034,000	貸付有価証券 1,500株
2229	カルビー	150,000	2,712.50	406,875,000	貸付有価証券 20,300株
2264	森永乳業	59,600	4,803.00	286,258,800	
2266	六甲バター	24,000	1,305.00	31,320,000	
2267	ヤクルト本社	234,200	9,287.00	2,175,015,400	
2269	明治ホールディングス	401,800	3,254.00	1,307,457,200	貸付有価証券 59,000株
2270	雪印メグミルク	79,300	1,908.00	151,304,400	
2281	プリマハム	44,000	2,166.00	95,304,000	貸付有価証券 6,900株
2282	日本ハム	128,200	3,899.00	499,851,800	貸付有価証券 17,100株
2286	林兼産業	6,500	484.00	3,146,000	貸付有価証券

					1,500株
2288	丸大食品	33,000	1,469.00	48,477,000	
2292	S F o o d s	36,100	3,160.00	114,076,000	
2294	柿安本店	12,800	2,316.00	29,644,800	貸付有価証券 700株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	250,400	721.00	180,538,400	
2501	サッポロホールディングス	107,900	3,763.00	406,027,700	貸付有価証券 26,800株
2502	アサヒグループホールディングス	757,300	5,641.00	4,271,929,300	
2503	キリンホールディングス	1,479,000	2,179.00	3,222,741,000	
2531	宝ホールディングス	223,700	1,114.00	249,201,800	貸付有価証券 33,300株
2533	オエノンホールディングス	98,000	341.00	33,418,000	
2540	養命酒製造	10,800	1,837.00	19,839,600	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	256,700	1,559.00	400,195,300	
2585	ライフドリンク カンパニー	4,800	3,445.00	16,536,000	
2587	サントリー食品インターナショナル	230,800	5,321.00	1,228,086,800	
2590	ダイドーグループホールディングス	18,600	5,030.00	93,558,000	貸付有価証券 1,200株
2593	伊藤園	111,000	4,039.00	448,329,000	貸付有価証券 13,500株
2594	キーコーヒー	36,700	2,057.00	75,491,900	
2597	ユニカフェ	6,500	909.00	5,908,500	貸付有価証券 1,100株
2599	ジャパンフーズ	3,100	1,086.00	3,366,600	
2602	日清オイリオグループ	46,200	3,425.00	158,235,000	
2607	不二製油グループ本社	76,300	2,010.00	153,363,000	貸付有価証券 10,200株
2612	かどや製油	1,900	3,470.00	6,593,000	
2613	Jーオイルミルズ	33,400	1,584.00	52,905,600	
2801	キッコーマン	217,200	8,404.00	1,825,348,800	貸付有価証券 31,800株
2802	味の素	791,300	5,774.00	4,568,966,200	貸付有価証券 98,100株
2804	ブルドックソース	17,400	1,991.00	34,643,400	
2809	キューピー	176,100	2,363.50	416,212,350	貸付有価証券 39,700株
2810	ハウス食品グループ本社	100,300	3,188.00	319,756,400	
2811	カゴメ	152,700	3,238.00	494,442,600	貸付有価証券 28,200株
2812	焼津水産化学工業	8,700	832.00	7,238,400	

2815	アリアケジャパン	28,600	5,285.00	151,151,000	
2818	ピエトロ	2,800	1,816.00	5,084,800	貸付有価証券 200株
2819	エバラ食品工業	8,800	2,931.00	25,792,800	
2820	やまみ	1,900	1,338.00	2,542,200	貸付有価証券 200株
2871	ニチレイ	150,200	3,126.00	469,525,200	
2875	東洋水産	165,600	6,565.00	1,087,164,000	
2882	イートアンドホールディングス	13,900	2,186.00	30,385,400	
2883	大冷	2,400	1,974.00	4,737,600	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	20,800	899.00	18,699,200	貸付有価証券 2,400株
2897	日清食品ホールディングス	115,200	12,065.00	1,389,888,000	
2899	永谷園ホールディングス	16,100	2,115.00	34,051,500	
2904	一正蒲鉾	8,300	785.00	6,515,500	
2908	フジッコ	33,700	1,893.00	63,794,100	貸付有価証券 4,800株
2910	ロック・フィールド	36,700	1,482.00	54,389,400	貸付有価証券 4,800株
2914	日本たばこ産業	2,157,500	3,239.00	6,988,142,500	
2915	ケンコーマヨネーズ	22,600	1,338.00	30,238,800	貸付有価証券 2,500株
2918	わらべや日洋ホールディングス	24,100	2,193.00	52,851,300	
2922	なとり	20,600	1,945.00	40,067,000	
2924	イフジ産業	3,700	1,081.00	3,999,700	
2929	ファーマフーズ	47,100	2,212.00	104,185,200	
2931	ユーグレナ	211,900	888.00	188,167,200	貸付有価証券 19,000株
2933	紀文食品	25,600	1,004.00	25,702,400	貸付有価証券 2,800株
2935	ピククルスホールディングス	19,200	1,227.00	23,558,400	
4404	ミヨシ油脂	6,900	1,027.00	7,086,300	貸付有価証券 1,700株
4526	理研ビタミン	28,300	2,156.00	61,014,800	貸付有価証券 400株
3001	片倉工業	30,700	1,640.00	50,348,000	
3002	グンゼ	23,700	4,430.00	104,991,000	
3101	東洋紡	144,100	1,015.50	146,333,550	貸付有価証券 21,800株
3103	ユニチカ	100,600	230.00	23,138,000	貸付有価証券 8,100株
3104	富士紡ホールディングス	13,100	3,130.00	41,003,000	

3106	倉敷紡績	24,900	2,237.00	55,701,300	
3109	シキボウ	11,000	996.00	10,956,000	貸付有価証券 4,300株
3201	日本毛織	87,900	1,024.00	90,009,600	貸付有価証券 14,300株
3202	ダイトウボウ	34,200	91.00	3,112,200	貸付有価証券 7,000株
3204	トーア紡コーポレーション	7,700	410.00	3,157,000	貸付有価証券 1,600株
3205	ダイドーリミテッド	30,100	274.00	8,247,400	貸付有価証券 5,700株
3302	帝国繊維	37,600	1,628.00	61,212,800	
3401	帝人	320,300	1,382.00	442,654,600	貸付有価証券 35,300株
3402	東レ	2,233,800	789.10	1,762,691,580	貸付有価証券 315,000株
3501	住江織物	3,600	2,140.00	7,704,000	
3512	日本フェルト	11,900	418.00	4,974,200	貸付有価証券 1,100株
3513	イチカワ	2,500	1,359.00	3,397,500	
3524	日東製網	2,300	1,397.00	3,213,100	貸付有価証券 500株
3529	アツギ	14,600	416.00	6,073,600	貸付有価証券 3,600株
3551	ダイニック	6,400	727.00	4,652,800	貸付有価証券 1,400株
3569	セーレン	64,400	2,443.00	157,329,200	貸付有価証券 6,900株
3571	ソトー	7,700	792.00	6,098,400	貸付有価証券 1,700株
3577	東海染工	2,400	1,108.00	2,659,200	
3580	小松マテーレ	48,300	670.00	32,361,000	貸付有価証券 1,300株
3591	ワコールホールディングス	64,200	2,824.00	181,300,800	
3593	ホギメディカル	44,700	3,200.00	143,040,000	
3607	クラウドディアホールディングス	4,500	746.00	3,357,000	貸付有価証券 1,100株
3608	T S Iホールディングス	112,200	744.00	83,476,800	
3611	マツオカコーポレーション	6,100	1,142.00	6,966,200	貸付有価証券 1,200株
3612	ワールド	42,800	1,566.00	67,024,800	
8011	三陽商会	9,300	1,735.00	16,135,500	貸付有価証券 2,300株
8013	ナイガイ	7,100	302.00	2,144,200	貸付有価証券 2,800株
8016	オンワードホールディングス	216,200	385.00	83,237,000	貸付有価証券

					26,100株
8029	ルックホールディングス	5,700	2,344.00	13,360,800	貸付有価証券 1,400株
8107	キムラタン	120,700	20.00	2,414,000	貸付有価証券 33,000株
8111	ゴールドウイン	59,100	12,125.00	716,587,500	貸付有価証券 1,700株
8114	デサント	57,400	4,015.00	230,461,000	貸付有価証券 8,600株
8118	キング	9,900	644.00	6,375,600	貸付有価証券 2,100株
8127	ヤマトインターナショナル	15,600	284.00	4,430,400	
3708	特種東海製紙	14,900	3,245.00	48,350,500	
3861	王子ホールディングス	1,388,900	556.30	772,645,070	
3863	日本製紙	173,600	1,205.00	209,188,000	
3864	三菱製紙	26,900	558.00	15,010,200	貸付有価証券 5,000株
3865	北越コーポレーション	210,700	906.00	190,894,200	貸付有価証券 28,800株
3877	中越パルプ工業	8,000	1,324.00	10,592,000	貸付有価証券 1,900株
3878	巴川製紙所	6,200	673.00	4,172,600	
3880	大王製紙	147,300	1,101.50	162,250,950	
3896	阿波製紙	4,700	568.00	2,669,600	貸付有価証券 1,100株
3941	レンゴー	303,600	866.80	263,160,480	
3946	トーモク	19,300	2,029.00	39,159,700	貸付有価証券 2,700株
3950	ザ・パック	24,800	3,060.00	75,888,000	貸付有価証券 3,300株
2930	北の達人コーポレーション	140,500	288.00	40,464,000	貸付有価証券 20,400株
3405	クラレ	530,000	1,392.00	737,760,000	
3407	旭化成	2,082,000	957.90	1,994,347,800	貸付有価証券 123,000株
3553	共和レザー	11,400	550.00	6,270,000	貸付有価証券 2,400株
4004	レゾナック・ホールディングス	322,200	2,287.00	736,871,400	貸付有価証券 30,900株
4005	住友化学	2,473,300	440.10	1,088,499,330	
4008	住友精化	13,900	4,320.00	60,048,000	
4021	日産化学	158,300	6,092.00	964,363,600	貸付有価証券 8,400株
4022	ラサ工業	12,900	2,114.00	27,270,600	
4023	クレハ	28,500	8,330.00	237,405,000	

4025	多木化学	13,000	4,310.00	56,030,000	貸付有価証券 1,300株
4027	テイカ	22,400	1,363.00	30,531,200	貸付有価証券 1,900株
4028	石原産業	60,300	1,284.00	77,425,200	
4031	片倉コープアグリ	4,700	1,255.00	5,898,500	貸付有価証券 1,100株
4041	日本曹達	35,800	5,020.00	179,716,000	
4042	東ソー	445,100	1,703.50	758,227,850	
4043	トクヤマ	107,700	2,340.50	252,071,850	
4044	セントラル硝子	53,500	3,125.00	167,187,500	貸付有価証券 8,900株
4045	東亜合成	167,200	1,297.00	216,858,400	
4046	大阪ソーダ	20,000	5,310.00	106,200,000	貸付有価証券 7,000株
4047	関東電化工業	64,500	970.00	62,565,000	
4061	デンカ	121,200	2,636.50	319,543,800	
4063	信越化学工業	2,771,400	4,636.00	12,848,210,400	貸付有価証券 445,100株
4064	日本カーバイド工業	7,500	1,344.00	10,080,000	貸付有価証券 1,500株
4078	堺化学工業	25,400	1,838.00	46,685,200	貸付有価証券 2,800株
4082	第一稀元素化学工業	30,400	969.00	29,457,600	貸付有価証券 1,900株
4088	エア・ウォーター	314,600	1,939.00	610,009,400	
4091	日本酸素ホールディングス	323,400	3,108.00	1,005,127,200	貸付有価証券 41,400株
4092	日本化学工業	11,100	1,869.00	20,745,900	
4093	東邦アセチレン	4,200	1,399.00	5,875,800	貸付有価証券 600株
4095	日本パーカライジング	165,100	1,062.00	175,336,200	貸付有価証券 21,900株
4097	高圧ガス工業	48,400	749.00	36,251,600	
4098	チタン工業	2,400	1,399.00	3,357,600	貸付有価証券 500株
4099	四国化成ホールディングス	39,600	1,473.00	58,330,800	
4100	戸田工業	7,600	2,347.00	17,837,200	貸付有価証券 1,000株
4109	ステラ ケミファ	19,700	3,080.00	60,676,000	
4112	保土谷化学工業	9,400	3,505.00	32,947,000	
4114	日本触媒	50,800	5,340.00	271,272,000	
4116	大日精化工業	23,200	2,057.00	47,722,400	貸付有価証券 3,800株

4118	カネカ	76,200	3,928.00	299,313,600	
4182	三菱瓦斯化学	249,000	2,100.50	523,024,500	
4183	三井化学	274,900	4,164.00	1,144,683,600	貸付有価証券 40,200株
4185	J S R	311,300	3,934.00	1,224,654,200	
4186	東京応化工業	58,300	8,761.00	510,766,300	
4187	大阪有機化学工業	25,100	2,573.00	64,582,300	
4188	三菱ケミカルグループ	2,249,900	847.00	1,905,665,300	貸付有価証券 289,900株
4189	K Hネオケム	55,500	2,385.00	132,367,500	
4202	ダイセル	490,200	1,290.00	632,358,000	貸付有価証券 59,500株
4203	住友ベークライト	49,400	5,775.00	285,285,000	
4204	積水化学工業	681,900	2,052.50	1,399,599,750	
4205	日本ゼオン	200,000	1,375.50	275,100,000	
4206	アイカ工業	84,100	3,138.00	263,905,800	貸付有価証券 1,700株
4208	U B E	171,800	2,441.00	419,363,800	
4212	積水樹脂	48,500	2,255.00	109,367,500	貸付有価証券 7,800株
4215	タキロンシーアイ	72,900	557.00	40,605,300	
4216	旭有機材	22,200	4,130.00	91,686,000	貸付有価証券 400株
4218	ニチバン	20,700	1,906.00	39,454,200	
4220	リケンテクノス	71,800	639.00	45,880,200	
4221	大倉工業	15,500	2,163.00	33,526,500	
4228	積水化成成品工業	46,800	429.00	20,077,200	
4229	群栄化学工業	7,800	2,722.00	21,231,600	
4231	タイガースポリマー	10,100	578.00	5,837,800	貸付有価証券 2,200株
4238	ミライアル	6,700	1,537.00	10,297,900	貸付有価証券 1,500株
4245	ダイキアクシス	7,300	723.00	5,277,900	貸付有価証券 1,500株
4246	ダイキョーニシカワ	73,600	771.00	56,745,600	
4248	竹本容器	6,700	853.00	5,715,100	
4249	森六ホールディングス	16,900	2,045.00	34,560,500	貸付有価証券 1,600株
4251	恵和	21,600	1,122.00	24,235,200	
4272	日本化薬	254,700	1,233.50	314,172,450	
4275	カーリットホールディングス	29,900	827.00	24,727,300	

4362	日本精化	18,900	2,836.00	53,600,400	
4368	扶桑化学工業	30,900	4,375.00	135,187,500	
4369	トリケミカル研究所	44,500	2,640.00	117,480,000	貸付有価証券 4,000株
4401	ADEKA	116,200	2,631.00	305,722,200	
4403	日油	103,100	6,039.00	622,620,900	
4406	新日本理化	29,800	240.00	7,152,000	貸付有価証券 7,200株
4410	ハリマ化成グループ	13,900	867.00	12,051,300	貸付有価証券 3,600株
4452	花王	811,900	5,338.00	4,333,922,200	
4461	第一工業製薬	12,000	1,766.00	21,192,000	
4462	石原ケミカル	15,200	1,689.00	25,672,800	
4463	日華化学	8,000	856.00	6,848,000	
4465	ニイタカ	3,900	2,092.00	8,158,800	貸付有価証券 700株
4471	三洋化成工業	20,500	4,225.00	86,612,500	
4531	有機合成薬品工業	14,700	307.00	4,512,900	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	40,700	911.00	37,077,700	
4612	日本ペイントホールディングス	1,475,300	1,181.00	1,742,329,300	貸付有価証券 95,300株
4613	関西ペイント	305,400	2,162.50	660,427,500	
4615	神東塗料	16,500	124.00	2,046,000	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	54,800	1,188.00	65,102,400	
4619	日本特殊塗料	12,600	1,046.00	13,179,600	
4620	藤倉化成	44,800	456.00	20,428,800	
4626	太陽ホールディングス	50,700	2,677.00	135,723,900	
4631	D I C	130,300	2,633.00	343,079,900	
4633	サカティンクス	74,200	1,236.00	91,711,200	
4634	東洋インキSCホールディングス	65,300	2,219.00	144,900,700	
4636	T&K TOKA	29,600	1,179.00	34,898,400	貸付有価証券 4,700株
4901	富士フイルムホールディングス	640,600	8,542.00	5,472,005,200	
4911	資生堂	697,000	6,646.00	4,632,262,000	
4912	ライオン	400,500	1,392.00	557,496,000	
4914	高砂香料工業	22,600	2,605.00	58,873,000	
4917	マンダム	72,100	1,463.00	105,482,300	
4919	ミルボン	49,500	5,040.00	249,480,000	

4921	ファンケル	146,000	2,406.00	351,276,000	貸付有価証券 5,900株
4922	コーセー	67,900	14,620.00	992,698,000	
4923	コタ	30,700	1,618.00	49,672,600	
4926	シーボン	2,800	1,552.00	4,345,600	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	171,100	2,089.50	357,513,450	
4928	ノエビアホールディングス	29,800	5,480.00	163,304,000	
4929	アジュバンホールディングス	4,800	939.00	4,507,200	
4931	新日本製薬	19,000	1,412.00	26,828,000	
4936	アクシージア	16,900	1,353.00	22,865,700	
4951	エステー	25,800	1,517.00	39,138,600	
4955	アグロ カネショウ	13,300	1,684.00	22,397,200	
4956	コニシ	55,700	2,300.00	128,110,000	貸付有価証券 7,300株
4958	長谷川香料	63,800	3,435.00	219,153,000	
4963	星光PMC	10,100	595.00	6,009,500	
4967	小林製薬	97,100	8,009.00	777,673,900	
4968	荒川化学工業	28,300	995.00	28,158,500	
4971	メック	27,500	3,340.00	91,850,000	
4973	日本高純度化学	8,300	2,605.00	21,621,500	
4974	タカラバイオ	89,900	1,631.00	146,626,900	
4975	JCU	37,300	3,425.00	127,752,500	
4977	新田ゼラチン	12,300	725.00	8,917,500	貸付有価証券 2,800株
4979	OATアグリオ	8,100	2,024.00	16,394,400	
4980	デクセリアルズ	96,500	2,920.00	281,780,000	貸付有価証券 11,400株
4985	アース製薬	30,200	5,060.00	152,812,000	貸付有価証券 3,300株
4992	北興化学工業	33,600	976.00	32,793,600	貸付有価証券 4,600株
4994	大成ラミック	10,500	2,885.00	30,292,500	
4996	クミアイ化学工業	132,600	1,107.00	146,788,200	
4997	日本農薬	61,200	702.00	42,962,400	貸付有価証券 7,900株
5142	アキレス	21,000	1,440.00	30,240,000	
5208	有沢製作所	54,300	1,100.00	59,730,000	貸付有価証券 4,100株
6988	日東電工	242,300	10,535.00	2,552,630,500	
7874	レック	47,500	850.00	40,375,000	貸付有価証券 4,700株

7888	三光合成	42,000	621.00	26,082,000	
7908	きもと	32,900	196.00	6,448,400	貸付有価証券 7,500株
7917	藤森工業	26,400	3,430.00	90,552,000	
7925	前澤化成工業	21,500	1,612.00	34,658,000	
7931	未来工業	12,000	2,629.00	31,548,000	
7940	ウェーブロックホールディングス	7,500	586.00	4,395,000	
7942	J S P	23,500	1,830.00	43,005,000	貸付有価証券 2,400株
7947	エフピコ	63,200	2,973.00	187,893,600	
7958	天馬	28,400	2,541.00	72,164,400	貸付有価証券 3,000株
7970	信越ポリマー	61,700	1,455.00	89,773,500	
7971	東リ	49,000	330.00	16,170,000	貸付有価証券 11,000株
7988	ニフコ	120,400	3,888.00	468,115,200	
7995	バルカー	27,900	3,760.00	104,904,000	
8113	ユニ・チャーム	695,500	5,388.00	3,747,354,000	
9385	ショーエイコーポレーション	5,700	589.00	3,357,300	貸付有価証券 500株
4151	協和キリン	403,300	2,731.50	1,101,613,950	
4502	武田薬品工業	2,954,200	4,548.00	13,435,701,600	貸付有価証券 369,200株
4503	アステラス製薬	3,153,500	2,189.00	6,903,011,500	
4506	住友ファーマ	247,600	656.60	162,574,160	
4507	塩野義製薬	420,900	6,224.00	2,619,681,600	貸付有価証券 54,600株
4512	わかもと製薬	20,900	228.00	4,765,200	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	78,700	6,208.00	488,569,600	
4519	中外製薬	1,045,000	4,200.00	4,389,000,000	
4521	科研製薬	57,200	3,646.00	208,551,200	貸付有価証券 7,600株
4523	エーザイ	406,100	9,550.00	3,878,255,000	
4527	ロート製薬	323,400	3,316.00	1,072,394,400	
4528	小野薬品工業	644,000	2,700.00	1,738,800,000	貸付有価証券 104,500株
4530	久光製薬	74,200	3,738.00	277,359,600	
4534	持田製薬	38,300	3,275.00	125,432,500	
4536	参天製薬	608,200	1,239.50	753,863,900	
4538	扶桑薬品工業	10,600	1,995.00	21,147,000	貸付有価証券 1,600株

4539	日本ケミファ	2,300	1,899.00	4,367,700	貸付有価証券 800株
4540	ツムラ	105,100	2,687.00	282,403,700	貸付有価証券 1,700株
4547	キッセイ薬品工業	51,600	2,911.00	150,207,600	貸付有価証券 7,800株
4548	生化学工業	63,600	750.00	47,700,000	貸付有価証券 8,600株
4549	栄研化学	54,200	1,510.00	81,842,000	
4551	鳥居薬品	17,900	3,670.00	65,693,000	
4552	JCRファーマ	113,000	1,257.00	142,041,000	貸付有価証券 12,400株
4553	東和薬品	51,300	1,829.00	93,827,700	貸付有価証券 4,400株
4554	富士製薬工業	24,600	1,153.00	28,363,800	
4559	ゼリア新薬工業	46,300	2,466.00	114,175,800	貸付有価証券 4,800株
4565	そーせいグループ	114,700	3,160.00	362,452,000	
4568	第一三共	2,908,200	4,595.00	13,363,179,000	
4569	杏林製薬	72,400	1,768.00	128,003,200	貸付有価証券 9,800株
4574	大幸薬品	64,100	338.00	21,665,800	貸付有価証券 5,100株
4577	ダイト	23,300	2,319.00	54,032,700	
4578	大塚ホールディングス	763,800	5,381.00	4,110,007,800	
4581	大正製薬ホールディングス	74,200	5,440.00	403,648,000	貸付有価証券 9,800株
4587	ペプチドリーム	161,800	2,203.00	356,445,400	貸付有価証券 22,400株
4886	あすか製薬ホールディングス	34,200	1,400.00	47,880,000	
4887	サワイグループホールディングス	76,300	3,650.00	278,495,000	貸付有価証券 9,100株
3315	日本コークス工業	301,100	107.00	32,217,700	
5011	ニチレキ	39,400	1,769.00	69,698,600	
5013	ユシロ化学工業	17,300	1,088.00	18,822,400	
5015	ビーピー・カストロール	7,700	888.00	6,837,600	貸付有価証券 1,600株
5017	富士石油	68,100	265.00	18,046,500	
5018	MORESCO	7,100	1,167.00	8,285,700	貸付有価証券 1,600株
5019	出光興産	370,800	2,857.00	1,059,375,600	
5020	ENEOSホールディングス	5,662,500	485.30	2,748,011,250	
5021	コスモエネルギーホールディングス	132,000	3,839.00	506,748,000	

5101	横浜ゴム	189,900	3,116.00	591,728,400	
5105	TOYO TIRE	191,800	1,881.00	360,775,800	
5108	ブリヂストン	1,066,000	5,931.00	6,322,446,000	
5110	住友ゴム工業	327,400	1,350.50	442,153,700	
5121	藤倉コンポジット	17,200	930.00	15,996,000	貸付有価証券 3,400株
5122	オカモト	18,500	3,895.00	72,057,500	
5185	フコク	17,500	1,329.00	23,257,500	
5186	ニッタ	33,900	3,080.00	104,412,000	
5191	住友理工	64,800	834.00	54,043,200	
5192	三ツ星ベルト	48,700	4,330.00	210,871,000	貸付有価証券 5,800株
5195	バンドー化学	52,900	1,425.00	75,382,500	貸付有価証券 4,700株
3110	日東紡績	37,600	2,397.00	90,127,200	
5201	A G C	339,700	5,234.00	1,777,989,800	
5202	日本板硝子	170,200	630.00	107,226,000	
5204	石塚硝子	3,400	1,559.00	5,300,600	
5210	日本山村硝子	7,400	1,090.00	8,066,000	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	136,300	2,573.00	350,699,900	
5218	オハラ	15,800	1,498.00	23,668,400	貸付有価証券 1,700株
5232	住友大阪セメント	47,000	3,607.00	169,529,000	
5233	太平洋セメント	212,600	2,751.50	584,968,900	
5262	日本ヒューム	29,200	783.00	22,863,600	
5269	日本コンクリート工業	64,700	330.00	21,351,000	貸付有価証券 17,100株
5273	三谷セキサン	14,000	4,925.00	68,950,000	
5288	アジアパイルホールディングス	52,200	607.00	31,685,400	貸付有価証券 6,300株
5301	東海カーボン	280,000	1,279.00	358,120,000	
5302	日本カーボン	19,100	4,490.00	85,759,000	
5310	東洋炭素	20,900	5,130.00	107,217,000	貸付有価証券 1,400株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	16,600	5,400.00	89,640,000	
5332	TOTO	220,300	4,332.00	954,339,600	貸付有価証券 15,000株
5333	日本碍子	388,100	1,754.00	680,727,400	
5334	日本特殊陶業	254,100	2,803.50	712,369,350	
5337	ダントーホールディングス	14,000	748.00	10,472,000	貸付有価証券

					3,300株
5344	MARUWA	12,300	20,710.00	254,733,000	
5351	品川リフラクトリーズ	9,400	5,240.00	49,256,000	
5352	黒崎播磨	6,800	8,460.00	57,528,000	
5357	ヨータイ	18,000	1,412.00	25,416,000	
5363	東京窯業	21,200	334.00	7,080,800	貸付有価証券 5,600株
5367	ニッカトー	8,900	657.00	5,847,300	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	26,600	10,010.00	266,266,000	
5388	クニミネ工業	6,700	973.00	6,519,100	
5391	エーアンドエーマテリアル	3,600	1,061.00	3,819,600	貸付有価証券 800株
5393	ニチアス	84,400	2,913.00	245,857,200	
7943	ニチハ	41,800	3,085.00	128,953,000	貸付有価証券 4,800株
5401	日本製鉄	1,537,700	2,923.50	4,495,465,950	貸付有価証券 85,200株
5406	神戸製鋼所	690,700	1,295.50	894,801,850	
5408	中山製鋼所	70,700	809.00	57,196,300	貸付有価証券 6,100株
5410	合同製鉄	17,100	3,535.00	60,448,500	
5411	JFEホールディングス	917,700	1,985.50	1,822,093,350	
5423	東京製鉄	96,500	1,368.00	132,012,000	
5440	共英製鋼	39,100	2,006.00	78,434,600	貸付有価証券 4,900株
5444	大和工業	56,600	5,906.00	334,279,600	
5445	東京鐵鋼	16,300	3,070.00	50,041,000	
5449	大阪製鐵	15,800	1,380.00	21,804,000	貸付有価証券 2,400株
5451	淀川製鋼所	39,000	3,365.00	131,235,000	
5461	中部鋼板	28,200	1,889.00	53,269,800	貸付有価証券 3,700株
5463	丸一鋼管	104,600	3,244.00	339,322,400	貸付有価証券 6,900株
5464	モリ工業	5,200	3,355.00	17,446,000	貸付有価証券 1,300株
5471	大同特殊鋼	43,300	5,881.00	254,647,300	
5476	日本高周波鋼業	7,800	340.00	2,652,000	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	25,100	4,045.00	101,529,500	
5481	山陽特殊製鋼	33,900	2,768.00	93,835,200	

5482	愛知製鋼	19,800	2,844.00	56,311,200	
5491	日本金属	5,300	914.00	4,844,200	貸付有価証券 1,000株
5541	大平洋金属	24,400	1,514.00	36,941,600	貸付有価証券 2,900株
5563	新日本電工	204,900	279.00	57,167,100	
5602	栗本鐵工所	16,300	2,116.00	34,490,800	
5603	虹技	2,700	1,260.00	3,402,000	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	2,200	1,061.00	2,334,200	貸付有価証券 500株
5632	三菱製鋼	21,500	1,315.00	28,272,500	
5658	日亜鋼業	24,100	303.00	7,302,300	貸付有価証券 6,400株
5659	日本精線	4,700	4,910.00	23,077,000	貸付有価証券 700株
5698	エンビプロ・ホールディングス	14,100	554.00	7,811,400	
6319	シンニッタン	25,700	245.00	6,296,500	貸付有価証券 6,800株
7305	新家工業	4,400	2,303.00	10,133,200	貸付有価証券 1,000株
5702	大紀アルミニウム工業所	48,900	1,352.00	66,112,800	
5703	日本軽金属ホールディングス	92,600	1,422.00	131,677,200	
5706	三井金属鉱業	99,900	3,297.00	329,370,300	
5707	東邦亜鉛	20,300	1,663.00	33,758,900	
5711	三菱マテリアル	229,100	2,599.00	595,430,900	
5713	住友金属鉱山	398,200	4,571.00	1,820,172,200	貸付有価証券 56,200株
5714	DOWAホールディングス	77,200	4,415.00	340,838,000	貸付有価証券 11,100株
5715	古河機械金属	50,300	1,520.00	76,456,000	
5721	エス・サイエンス	94,300	25.00	2,357,500	貸付有価証券 19,300株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	50,400	2,813.00	141,775,200	
5727	東邦チタニウム	62,100	1,750.00	108,675,000	貸付有価証券 11,100株
5741	UACJ	48,100	2,662.00	128,042,200	貸付有価証券 6,600株
5757	CKサンエツ	8,300	4,270.00	35,441,000	
5801	古河電気工業	114,300	2,488.00	284,378,400	貸付有価証券 13,600株
5802	住友電気工業	1,185,900	1,704.50	2,021,366,550	
5803	フジクラ	368,300	1,191.50	438,829,450	

5805	SWCC	38,400	1,843.00	70,771,200	
5809	タツタ電線	69,900	714.00	49,908,600	貸付有価証券 8,700株
5819	カナレ電気	3,100	1,367.00	4,237,700	
5821	平河ヒューテック	19,700	1,520.00	29,944,000	
5851	リョービ	36,600	1,958.00	71,662,800	
5852	アーレスティ	22,600	661.00	14,938,600	
5857	アサヒホールディングス	138,900	1,927.00	267,660,300	
3421	稲葉製作所	17,800	1,592.00	28,337,600	貸付有価証券 2,000株
3431	宮地エンジニアリンググループ	9,500	3,950.00	37,525,000	
3433	トーカロ	94,400	1,443.00	136,219,200	
3434	アルファCo	7,500	1,202.00	9,015,000	貸付有価証券 1,600株
3436	SUMCO	653,800	2,095.00	1,369,711,000	
3443	川田テクノロジーズ	8,100	5,320.00	43,092,000	
3445	RS Technologies	22,900	3,175.00	72,707,500	
3446	ジェイテックコーポレーション	2,700	2,301.00	6,212,700	貸付有価証券 500株
3447	信和	13,100	743.00	9,733,300	
5901	東洋製罐グループホールディングス	204,800	2,078.50	425,676,800	貸付有価証券 27,900株
5902	ホッカンホールディングス	18,400	1,366.00	25,134,400	
5909	コロナ	19,200	907.00	17,414,400	
5911	横河ブリッジホールディングス	43,000	2,468.00	106,124,000	
5915	駒井ハルテック	3,300	1,862.00	6,144,600	貸付有価証券 200株
5923	高田機工	1,800	2,902.00	5,223,600	
5929	三和ホールディングス	316,300	1,800.00	569,340,000	
5930	文化シャッター	98,800	1,092.00	107,889,600	貸付有価証券 20,000株
5932	三協立山	39,300	688.00	27,038,400	
5933	アルインコ	26,200	991.00	25,964,200	
5936	東洋シャッター	4,700	608.00	2,857,600	貸付有価証券 1,600株
5938	LIXIL	500,300	1,851.00	926,055,300	貸付有価証券 64,600株
5942	日本フィルコン	13,300	472.00	6,277,600	
5943	ノーリツ	50,600	1,805.00	91,333,000	
5946	長府製作所	34,600	2,481.00	85,842,600	
5947	リンナイ	186,800	3,012.00	562,641,600	

5951	ダイニチ工業	10,100	737.00	7,443,700	貸付有価証券 2,400株
5957	日東精工	49,800	578.00	28,784,400	
5958	三洋工業	2,600	1,952.00	5,075,200	
5959	岡部	55,200	762.00	42,062,400	
5970	ジーテクト	38,300	1,654.00	63,348,200	
5975	東プレ	60,500	1,518.00	91,839,000	貸付有価証券 8,200株
5976	高周波熱錬	53,000	972.00	51,516,000	貸付有価証券 4,400株
5981	東京製綱	20,200	1,137.00	22,967,400	貸付有価証券 4,300株
5985	サンコール	18,100	524.00	9,484,400	貸付有価証券 3,000株
5986	モリテック スチール	16,500	275.00	4,537,500	貸付有価証券 3,400株
5988	パイオラックス	47,400	2,081.00	98,639,400	
5989	エイチワン	35,300	715.00	25,239,500	
5991	日本発條	303,800	1,025.50	311,546,900	貸付有価証券 46,800株
5992	中央発條	25,400	702.00	17,830,800	貸付有価証券 800株
5998	アドバネクス	2,800	981.00	2,746,800	貸付有価証券 600株
7989	立川ブラインド工業	15,500	1,268.00	19,654,000	
8155	三益半導体工業	26,500	2,981.00	78,996,500	
1909	日本ドライケミカル	4,800	1,721.00	8,260,800	
5631	日本製鋼所	92,600	3,080.00	285,208,000	
6005	三浦工業	140,400	3,706.00	520,322,400	
6013	タクマ	103,300	1,474.00	152,264,200	
6101	ツガミ	74,700	1,373.00	102,563,100	貸付有価証券 6,400株
6103	オークマ	33,600	7,389.00	248,270,400	貸付有価証券 5,100株
6104	芝浦機械	33,600	4,670.00	156,912,000	
6113	アマダ	536,400	1,391.50	746,400,600	
6118	アイダエンジニアリング	69,200	928.00	64,217,600	
6121	TAKI SAWA	6,100	1,216.00	7,417,600	貸付有価証券 1,400株
6134	FUJ I	146,100	2,528.00	369,340,800	
6135	牧野フライス製作所	37,200	5,480.00	203,856,000	
6136	オーエスジー	160,500	1,982.50	318,191,250	

6138	ダイジェット工業	2,200	868.00	1,909,600	
6140	旭ダイヤモンド工業	93,900	813.00	76,340,700	
6141	DMG森精機	203,800	2,485.00	506,443,000	
6143	ソディック	92,700	714.00	66,187,800	
6146	ディスコ	161,800	21,830.00	3,532,094,000	貸付有価証券 22,800株
6151	日東工器	16,300	1,940.00	31,622,000	
6157	日進工具	28,000	1,128.00	31,584,000	
6165	パンチ工業	18,200	510.00	9,282,000	貸付有価証券 3,900株
6167	富士ダイス	10,700	648.00	6,933,600	貸付有価証券 3,500株
6203	豊和工業	10,900	817.00	8,905,300	貸付有価証券 3,400株
6208	石川製作所	5,500	1,403.00	7,716,500	貸付有価証券 1,000株
6210	東洋機械金属	13,800	667.00	9,204,600	貸付有価証券 3,100株
6217	津田駒工業	3,600	450.00	1,620,000	貸付有価証券 800株
6218	エンシュウ	4,700	768.00	3,609,600	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	53,500	1,866.00	99,831,000	貸付有価証券 7,000株
6235	オプトラン	49,700	2,399.00	119,230,300	
6236	NCホールディングス	5,100	2,200.00	11,220,000	貸付有価証券 1,300株
6237	イワキポンプ	22,400	1,372.00	30,732,800	
6238	フリー	35,200	1,103.00	38,825,600	貸付有価証券 4,300株
6240	ヤマシンフィルタ	80,200	295.00	23,659,000	貸付有価証券 9,400株
6247	日阪製作所	32,600	894.00	29,144,400	
6250	やまびこ	54,900	1,545.00	84,820,500	
6254	野村マイクロ・サイエンス	11,400	6,440.00	73,416,000	貸付有価証券 1,000株
6258	平田機工	16,100	8,250.00	132,825,000	貸付有価証券 2,100株
6262	PEGASUS	37,100	567.00	21,035,700	
6264	マルマエ	14,600	1,676.00	24,469,600	
6266	タツモ	18,400	2,397.00	44,104,800	
6268	ナブテスコ	211,000	3,193.00	673,723,000	
6269	三井海洋開発	42,100	1,395.00	58,729,500	

6272	レオン自動機	35,300	1,418.00	50,055,400	
6273	SMC	109,000	79,210.00	8,633,890,000	貸付有価証券 13,800株
6277	ホソカワミクロン	23,600	3,250.00	76,700,000	
6278	ユニオンツール	14,800	3,275.00	48,470,000	
6279	瑞光	18,700	1,296.00	24,235,200	
6282	オイレス工業	47,000	1,959.00	92,073,000	
6284	日精エー・エス・ビー機械	13,400	4,060.00	54,404,000	
6287	サトーホールディングス	47,800	1,982.00	94,739,600	
6289	技研製作所	31,600	2,011.00	63,547,600	
6291	日本エアージェット	17,000	1,214.00	20,638,000	貸付有価証券 300株
6292	カワタ	6,300	1,121.00	7,062,300	貸付有価証券 1,300株
6293	日精樹脂工業	24,900	990.00	24,651,000	貸付有価証券 3,600株
6294	オカダアイヨン	6,700	2,326.00	15,584,200	
6298	ワイエイシーホールディングス	8,500	3,130.00	26,605,000	貸付有価証券 1,900株
6301	小松製作所	1,575,200	3,787.00	5,965,282,400	貸付有価証券 43,400株
6302	住友重機械工業	198,900	3,405.00	677,254,500	
6305	日立建機	133,900	3,916.00	524,352,400	貸付有価証券 4,100株
6306	日工	49,800	650.00	32,370,000	
6309	巴工業	14,400	2,902.00	41,788,800	貸付有価証券 1,900株
6310	井関農機	31,500	1,252.00	39,438,000	
6315	TOWA	34,300	2,477.00	84,961,100	
6316	丸山製作所	3,300	1,845.00	6,088,500	貸付有価証券 1,000株
6317	北川鉄工所	13,200	1,159.00	15,298,800	貸付有価証券 1,300株
6323	ローツェ	17,600	11,230.00	197,648,000	貸付有価証券 1,900株
6325	タカキタ	6,500	448.00	2,912,000	貸付有価証券 1,600株
6326	クボタ	1,778,900	2,108.00	3,749,921,200	
6328	荏原実業	16,100	3,040.00	48,944,000	
6331	三菱化工機	10,800	2,768.00	29,894,400	
6332	月島ホールディングス	45,400	1,189.00	53,980,600	貸付有価証券 8,200株
6333	帝国電機製作所	23,600	2,617.00	61,761,200	貸付有価証券

					300 株
6335	東京機械製作所	5,900	475.00	2,802,500	貸付有価証券 1,000 株
6339	新東工業	67,900	1,052.00	71,430,800	
6340	澁谷工業	31,500	2,677.00	84,325,500	
6345	アイチ コーポレーション	46,800	863.00	40,388,400	
6349	小森コーポレーション	77,900	933.00	72,680,700	貸付有価証券 6,600 株
6351	鶴見製作所	25,700	2,513.00	64,584,100	
6356	日本ギア工業	7,600	371.00	2,819,600	貸付有価証券 1,300 株
6358	酒井重工業	3,500	5,100.00	17,850,000	貸付有価証券 700 株
6361	荏原製作所	137,600	6,881.00	946,825,600	
6362	石井鐵工所	2,500	2,442.00	6,105,000	
6363	西島製作所	28,900	1,742.00	50,343,800	
6364	北越工業	33,800	1,394.00	47,117,200	
6367	ダイキン工業	401,300	28,565.00	11,463,134,500	貸付有価証券 56,600 株
6368	オルガノ	46,200	4,060.00	187,572,000	
6369	トーヨーカネツ	12,800	3,300.00	42,240,000	
6370	栗田工業	188,000	5,504.00	1,034,752,000	
6371	椿本チエイン	47,600	3,650.00	173,740,000	
6373	大同工業	8,700	733.00	6,377,100	貸付有価証券 2,100 株
6378	木村化工機	25,600	725.00	18,560,000	
6381	アネスト岩田	57,200	1,137.00	65,036,400	貸付有価証券 11,100 株
6383	ダイフク	520,100	2,915.00	1,516,091,500	貸付有価証券 30,300 株
6387	サムコ	9,000	5,960.00	53,640,000	貸付有価証券 1,200 株
6390	加藤製作所	10,200	1,158.00	11,811,600	貸付有価証券 2,400 株
6393	油研工業	3,300	2,020.00	6,666,000	貸付有価証券 800 株
6395	タダノ	177,300	1,124.50	199,373,850	
6406	フジテック	117,800	3,650.00	429,970,000	貸付有価証券 16,100 株
6407	CKD	93,000	2,335.00	217,155,000	
6412	平和	111,800	2,498.00	279,276,400	
6413	理想科学工業	29,900	2,285.00	68,321,500	

6417	SANKYO	66,100	5,860.00	387,346,000	
6418	日本金銭機械	36,900	1,141.00	42,102,900	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	19,800	2,657.00	52,608,600	貸付有価証券 2,800株
6420	フクシマガリレイ	24,700	5,250.00	129,675,000	貸付有価証券 2,700株
6428	オーイズミ	7,500	486.00	3,645,000	貸付有価証券 1,900株
6430	ダイコク電機	18,400	3,630.00	66,792,000	貸付有価証券 900株
6432	竹内製作所	61,000	4,350.00	265,350,000	
6436	アマノ	95,400	2,981.00	284,387,400	
6440	JUKI	52,100	583.00	30,374,300	貸付有価証券 6,200株
6444	サンデン	29,800	196.00	5,840,800	貸付有価証券 9,500株
6445	ジャノメ	34,000	606.00	20,604,000	貸付有価証券 2,600株
6454	マックス	41,400	2,571.00	106,439,400	
6457	グローリー	80,700	2,798.50	225,838,950	
6458	新晃工業	33,900	2,090.00	70,851,000	
6459	大和冷機工業	51,500	1,370.00	70,555,000	
6460	セガサミーホールディングス	270,200	3,001.00	810,870,200	
6461	日本ピストンリング	7,800	1,515.00	11,817,000	貸付有価証券 1,600株
6462	リケン	13,300	3,000.00	39,900,000	貸付有価証券 2,000株
6463	T P R	38,400	1,591.00	61,094,400	
6464	ツバキ・ナカシマ	82,800	811.00	67,150,800	
6465	ホシザキ	216,400	5,142.00	1,112,728,800	
6470	大豊工業	29,000	838.00	24,302,000	貸付有価証券 3,000株
6471	日本精工	617,500	881.90	544,573,250	
6472	N T N	662,800	296.90	196,785,320	
6473	ジェイテクト	299,100	1,276.50	381,801,150	貸付有価証券 42,400株
6474	不二越	24,800	4,055.00	100,564,000	
6480	日本トムソン	82,300	594.00	48,886,200	
6481	T H K	194,000	2,958.00	573,852,000	
6482	ユーシン精機	26,600	702.00	18,673,200	
6485	前澤給装工業	23,600	1,098.00	25,912,800	

6486	イーグル工業	37,200	1,720.00	63,984,000	
6489	前澤工業	12,900	813.00	10,487,700	貸付有価証券 3,000株
6490	日本ビラー工業	31,200	4,500.00	140,400,000	貸付有価証券 4,400株
6498	キッツ	123,800	1,078.00	133,456,400	
6586	マキタ	418,200	3,953.00	1,653,144,600	貸付有価証券 57,600株
7003	三井E&S	157,600	479.00	75,490,400	貸付有価証券 16,000株
7004	日立造船	275,400	912.00	251,164,800	貸付有価証券 15,500株
7011	三菱重工業	587,900	6,667.00	3,919,529,300	
7013	I H I	211,800	3,819.00	808,864,200	
7022	サノヤスホールディングス	24,300	136.00	3,304,800	貸付有価証券 5,400株
7718	スター精密	63,400	1,788.00	113,359,200	
3105	日清紡ホールディングス	273,600	1,122.00	306,979,200	
4062	イビデン	192,900	7,760.00	1,496,904,000	貸付有価証券 40,500株
4902	コニカミノルタ	750,800	480.50	360,759,400	
6448	ブラザー工業	449,200	2,173.50	976,336,200	貸付有価証券 54,200株
6479	ミネベアミツミ	584,700	2,675.00	1,564,072,500	貸付有価証券 82,200株
6501	日立製作所	1,634,700	8,692.00	14,208,812,400	
6502	東芝	647,000	4,535.00	2,934,145,000	貸付有価証券 93,800株
6503	三菱電機	3,474,400	1,972.50	6,853,254,000	貸付有価証券 442,700株
6504	富士電機	204,400	6,251.00	1,277,704,400	
6505	東洋電機製造	7,100	957.00	6,794,700	貸付有価証券 1,700株
6506	安川電機	398,300	6,564.00	2,614,441,200	貸付有価証券 73,400株
6507	シンフォニアテクノロジー	37,100	1,697.00	62,958,700	
6508	明電舎	51,000	1,996.00	101,796,000	
6513	オリジン	4,900	1,254.00	6,144,600	貸付有価証券 1,200株
6516	山洋電気	14,500	7,740.00	112,230,000	貸付有価証券 2,200株
6517	デンヨー	25,600	2,051.00	52,505,600	貸付有価証券 3,800株
6523	PHCホールディングス	46,900	1,527.00	71,616,300	貸付有価証券 9,400株

6526	ソシオネクスト	46,100	20,190.00	930,759,000	貸付有価証券 4,400株
6588	東芝テック	50,200	4,075.00	204,565,000	
6590	芝浦メカトロニクス	6,500	21,410.00	139,165,000	貸付有価証券 400株
6592	マブチモーター	83,500	3,971.00	331,578,500	
6594	ニデック	817,900	7,672.00	6,274,928,800	貸付有価証券 106,600株
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	24,600	563.00	13,849,800	貸付有価証券 2,500株
6616	トレックス・セミコンダクター	15,800	2,211.00	34,933,800	貸付有価証券 2,500株
6617	東光高岳	20,300	2,156.00	43,766,800	
6619	ダブル・スコープ	110,000	1,209.00	132,990,000	貸付有価証券 7,600株
6622	ダイヘン	30,400	5,360.00	162,944,000	
6630	ヤーマン	58,100	1,008.00	58,564,800	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	306,200	494.00	151,262,800	
6638	ミマキエンジニアリング	31,900	818.00	26,094,200	
6640	I-PEX	18,600	1,354.00	25,184,400	
6644	大崎電気工業	79,700	545.00	43,436,500	貸付有価証券 3,900株
6645	オムロン	308,100	8,588.00	2,645,962,800	
6651	日東工業	45,300	3,480.00	157,644,000	
6652	I D E C	49,600	3,235.00	160,456,000	貸付有価証券 6,300株
6653	正興電機製作所	7,500	1,019.00	7,642,500	貸付有価証券 1,100株
6654	不二電機工業	4,000	1,142.00	4,568,000	貸付有価証券 600株
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	110,400	2,747.50	303,324,000	貸付有価証券 5,000株
6675	サクサホールディングス	5,000	2,080.00	10,400,000	貸付有価証券 200株
6676	メルコホールディングス	8,400	3,135.00	26,334,000	
6678	テクノメディア	8,200	1,862.00	15,268,400	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	11,400	828.00	9,439,200	貸付有価証券 700株
6701	日本電気	475,500	6,748.00	3,208,674,000	
6702	富士通	335,000	18,285.00	6,125,475,000	
6703	沖電気工業	152,000	880.00	133,760,000	
6704	岩崎通信機	8,700	827.00	7,194,900	

6706	電気興業	13,600	2,218.00	30,164,800	
6707	サンケン電気	31,200	11,480.00	358,176,000	
6715	ナカヨ	3,500	1,146.00	4,011,000	貸付有価証券 800株
6718	アイホン	20,400	2,378.00	48,511,200	
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,193,400	2,512.50	5,510,917,500	貸付有価証券 210,900株
6724	セイコーエプソン	431,300	2,214.50	955,113,850	貸付有価証券 54,900株
6727	ワコム	255,700	585.00	149,584,500	
6728	アルバック	79,900	5,921.00	473,087,900	
6730	アクセル	8,200	1,561.00	12,800,200	貸付有価証券 1,800株
6737	E I Z O	24,600	4,695.00	115,497,000	
6740	ジャパンディスプレイ	1,290,600	43.00	55,495,800	貸付有価証券 126,800株
6741	日本信号	76,600	1,058.00	81,042,800	貸付有価証券 8,900株
6742	京三製作所	70,400	475.00	33,440,000	
6744	能美防災	45,400	1,817.00	82,491,800	貸付有価証券 5,900株
6745	ホーチキ	25,100	1,761.00	44,201,100	
6748	星和電機	7,900	505.00	3,989,500	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	80,400	1,476.00	118,670,400	
6752	パナソニック ホールディングス	3,970,900	1,689.00	6,706,850,100	
6753	シャープ	404,800	784.80	317,687,040	貸付有価証券 50,900株
6754	アンリツ	236,800	1,205.50	285,462,400	
6755	富士通ゼネラル	95,300	3,114.00	296,764,200	
6758	ソニーグループ	2,354,500	12,990.00	30,584,955,000	
6762	T D K	532,300	5,385.00	2,866,435,500	
6763	帝国通信工業	15,100	1,648.00	24,884,800	貸付有価証券 600株
6768	タムラ製作所	144,200	661.00	95,316,200	貸付有価証券 14,900株
6770	アルプスアルパイン	300,200	1,224.00	367,444,800	貸付有価証券 28,600株
6771	池上通信機	6,300	643.00	4,050,900	貸付有価証券 1,400株
6779	日本電波工業	40,300	1,250.00	50,375,000	
6785	鈴木	17,900	1,004.00	17,971,600	
6787	メイコー	36,700	2,585.00	94,869,500	

6788	日本トリム	7,500	2,977.00	22,327,500	
6789	ローランド ディー. ジー.	18,400	3,600.00	66,240,000	
6794	フォスター電機	31,100	891.00	27,710,100	
6798	SMK	8,100	2,361.00	19,124,100	貸付有価証券 1,900株
6800	ヨコオ	26,700	1,720.00	45,924,000	
6803	ティアック	32,800	123.00	4,034,400	貸付有価証券 3,200株
6804	ホシデン	78,400	1,784.00	139,865,600	貸付有価証券 3,900株
6806	ヒロセ電機	55,600	19,035.00	1,058,346,000	貸付有価証券 6,800株
6807	日本航空電子工業	68,900	2,999.00	206,631,100	
6809	TOA	38,200	905.00	34,571,000	貸付有価証券 4,800株
6810	マクセル	68,000	1,568.00	106,624,000	
6814	古野電気	43,700	1,047.00	45,753,900	
6817	スミダコーポレーション	36,000	1,405.00	50,580,000	
6820	アイコム	12,900	2,977.00	38,403,300	貸付有価証券 1,500株
6823	リオン	13,800	1,948.00	26,882,400	
6841	横河電機	367,800	2,664.50	980,003,100	
6844	新電元工業	12,900	3,305.00	42,634,500	貸付有価証券 1,600株
6845	アズビル	232,500	4,445.00	1,033,462,500	貸付有価証券 27,900株
6848	東亜ディーケーケー	10,600	848.00	8,988,800	貸付有価証券 2,200株
6849	日本光電工業	153,700	3,858.00	592,974,600	
6850	チノー	13,800	2,341.00	32,305,800	
6853	共和電業	18,700	358.00	6,694,600	貸付有価証券 4,600株
6855	日本電子材料	22,000	1,631.00	35,882,000	
6856	堀場製作所	74,100	8,016.00	593,985,600	
6857	アドバンテスト	262,300	18,285.00	4,796,155,500	貸付有価証券 32,800株
6858	小野測器	7,300	442.00	3,226,600	貸付有価証券 1,800株
6859	エスペック	26,600	2,282.00	60,701,200	
6861	キーエンス	333,000	67,860.00	22,597,380,000	
6866	日置電機	17,500	8,900.00	155,750,000	
6869	シスメックス	287,100	10,000.00	2,871,000,000	

6871	日本マイクロニクス	54,800	1,892.00	103,681,600	貸付有価証券 1,400株
6875	メガチップス	27,300	3,660.00	99,918,000	
6877	OBARA GROUP	18,200	4,180.00	76,076,000	貸付有価証券 2,300株
6901	澤藤電機	2,600	1,328.00	3,452,800	貸付有価証券 500株
6904	原田工業	10,100	802.00	8,100,200	貸付有価証券 2,100株
6905	コーセル	40,000	1,292.00	51,680,000	
6908	イリソ電子工業	30,600	4,055.00	124,083,000	
6914	オプテックスグループ	61,100	1,996.00	121,955,600	
6915	千代田インテグレ	11,600	2,388.00	27,700,800	
6920	レーザーテック	152,600	20,775.00	3,170,265,000	
6923	スタンレー電気	236,900	2,873.00	680,613,700	
6925	ウシオ電機	169,100	1,905.50	322,220,050	
6926	岡谷電機産業	15,300	271.00	4,146,300	貸付有価証券 3,500株
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	18,300	1,100.00	20,130,000	貸付有価証券 6,500株
6928	エノモト	5,900	1,659.00	9,788,100	貸付有価証券 1,300株
6929	日本セラミック	33,900	2,638.00	89,428,200	
6932	遠藤照明	9,900	1,242.00	12,295,800	貸付有価証券 2,200株
6937	古河電池	24,500	1,037.00	25,406,500	貸付有価証券 800株
6938	双信電機	10,100	370.00	3,737,000	貸付有価証券 2,200株
6941	山一電機	29,000	2,299.00	66,671,000	
6947	図研	29,000	4,015.00	116,435,000	
6951	日本電子	83,400	5,099.00	425,256,600	
6952	カシオ計算機	248,000	1,165.00	288,920,000	
6954	ファナック	1,633,600	5,016.00	8,194,137,600	貸付有価証券 210,500株
6958	日本シイエムケイ	70,700	517.00	36,551,900	
6961	エンプラス	9,700	5,580.00	54,126,000	貸付有価証券 600株
6962	大真空	40,500	638.00	25,839,000	貸付有価証券 6,400株
6963	ローム	153,800	13,165.00	2,024,777,000	貸付有価証券 13,500株
6965	浜松ホトニクス	267,100	6,957.00	1,858,214,700	

6966	三井ハイテック	34,400	9,430.00	324,392,000	
6967	新光電気工業	117,800	5,546.00	653,318,800	
6971	京セラ	517,000	7,809.00	4,037,253,000	貸付有価証券 62,500株
6976	太陽誘電	162,100	4,115.00	667,041,500	貸付有価証券 19,600株
6981	村田製作所	1,009,400	8,091.00	8,167,055,400	
6986	双葉電子工業	63,400	478.00	30,305,200	
6989	北陸電気工業	8,000	1,193.00	9,544,000	貸付有価証券 1,800株
6996	ニチコン	68,000	1,473.00	100,164,000	貸付有価証券 6,200株
6997	日本ケミコン	32,900	1,270.00	41,783,000	
6999	KOA	50,400	1,757.00	88,552,800	
7244	市光工業	47,900	562.00	26,919,800	
7276	小糸製作所	400,300	2,645.50	1,058,993,650	貸付有価証券 53,000株
7280	ミツバ	62,400	794.00	49,545,600	
7735	SCREENホールディングス	56,900	15,465.00	879,958,500	貸付有価証券 12,500株
7739	キャノン電子	36,800	1,991.00	73,268,800	
7751	キャノン	1,826,100	3,807.00	6,951,962,700	
7752	リコー	834,500	1,210.50	1,010,162,250	貸付有価証券 113,600株
7965	象印マホービン	99,400	1,758.00	174,745,200	貸付有価証券 13,000株
7999	MUTOHホールディングス	2,700	1,715.00	4,630,500	貸付有価証券 600株
8035	東京エレクトロン	704,400	19,610.00	13,813,284,000	貸付有価証券 8,200株
9880	イノテック	22,200	1,579.00	35,053,800	
3116	トヨタ紡織	140,200	2,465.00	345,593,000	
3526	芦森工業	4,100	1,885.00	7,728,500	貸付有価証券 900株
5949	ユニプレス	59,700	1,083.00	64,655,100	
6201	豊田自動織機	243,300	10,010.00	2,435,433,000	貸付有価証券 35,800株
6455	モリタホールディングス	58,400	1,545.00	90,228,000	貸付有価証券 7,800株
6584	三櫻工業	50,800	823.00	41,808,400	貸付有価証券 5,600株
6902	デンソー	686,500	9,264.00	6,359,736,000	貸付有価証券 97,500株
6995	東海理化電機製作所	93,800	2,070.00	194,166,000	

7012	川崎重工業	250,800	3,531.00	885,574,800	
7014	名村造船所	55,400	573.00	31,744,200	貸付有価証券 14,200株
7102	日本車輛製造	12,800	2,006.00	25,676,800	
7105	三菱ロジスネクスト	53,100	1,256.00	66,693,600	貸付有価証券 9,900株
7122	近畿車輛	3,200	1,660.00	5,312,000	貸付有価証券 700株
7201	日産自動車	4,728,200	535.70	2,532,896,740	
7202	いすゞ自動車	967,700	1,720.00	1,664,444,000	
7203	トヨタ自動車	18,276,500	2,221.00	40,592,106,500	貸付有価証券 2,301,800株
7205	日野自動車	429,100	608.30	261,021,530	
7211	三菱自動車工業	1,298,500	475.90	617,956,150	
7212	エフテック	13,700	916.00	12,549,200	貸付有価証券 3,100株
7213	レシップホールディングス	8,500	511.00	4,343,500	貸付有価証券 1,600株
7214	GMB	3,900	1,950.00	7,605,000	貸付有価証券 800株
7215	ファルテック	3,700	607.00	2,245,900	貸付有価証券 700株
7220	武蔵精密工業	81,300	1,739.00	141,380,700	
7222	日産車体	58,700	832.00	48,838,400	貸付有価証券 12,500株
7224	新明和工業	104,600	1,350.00	141,210,000	
7226	極東開発工業	55,000	1,722.00	94,710,000	
7231	トピー工業	27,000	2,190.00	59,130,000	貸付有価証券 3,600株
7236	ティラド	8,400	1,821.00	15,296,400	
7238	曙ブレーキ工業	203,100	138.00	28,027,800	
7239	タチエス	52,600	1,486.00	78,163,600	貸付有価証券 7,300株
7240	NOK	129,300	2,048.00	264,806,400	
7241	フタバ産業	89,200	503.00	44,867,600	
7242	KYB	32,000	4,945.00	158,240,000	
7245	大同メタル工業	65,100	483.00	31,443,300	貸付有価証券 500株
7246	プレス工業	148,700	596.00	88,625,200	
7247	ミクニ	24,900	436.00	10,856,400	貸付有価証券 5,600株
7250	太平洋工業	76,300	1,298.00	99,037,400	貸付有価証券 9,200株
7256	河西工業	26,300	152.00	3,997,600	貸付有価証券

					6,000株
7259	アイシン	256,700	4,266.00	1,095,082,200	貸付有価証券 36,500株
7261	マツダ	1,101,000	1,351.00	1,487,451,000	
7266	今仙電機製作所	14,100	623.00	8,784,300	貸付有価証券 4,100株
7267	本田技研工業	2,705,600	4,302.00	11,639,491,200	
7269	スズキ	611,300	4,941.00	3,020,433,300	貸付有価証券 125,900株
7270	SUBARU	1,053,100	2,650.50	2,791,241,550	貸付有価証券 1,500株
7271	安永	8,600	916.00	7,877,600	貸付有価証券 2,100株
7272	ヤマハ発動機	523,100	3,991.00	2,087,692,100	
7277	T B K	21,600	385.00	8,316,000	貸付有価証券 5,200株
7278	エクセディ	54,400	2,325.00	126,480,000	貸付有価証券 6,000株
7282	豊田合成	97,100	2,554.00	247,993,400	
7283	愛三工業	55,000	1,124.00	61,820,000	
7284	盟和産業	3,100	1,000.00	3,100,000	
7291	日本プラスト	15,500	444.00	6,882,000	
7294	ヨロズ	31,200	897.00	27,986,400	
7296	エフ・シー・シー	59,000	1,837.00	108,383,000	
7309	シマノ	136,200	22,660.00	3,086,292,000	
7313	テイ・エス テック	152,400	1,814.50	276,529,800	貸付有価証券 20,600株
7408	ジャムコ	12,500	1,474.00	18,425,000	貸付有価証券 2,200株
4543	テルモ	1,023,700	4,549.00	4,656,811,300	貸付有価証券 125,300株
5187	クリエートメディック	6,500	909.00	5,908,500	貸付有価証券 700株
6376	日機装	77,500	911.00	70,602,500	
7600	日本エム・ディ・エム	19,800	1,000.00	19,800,000	
7701	島津製作所	405,400	4,399.00	1,783,354,600	
7702	J M S	30,800	579.00	17,833,200	
7709	クボテック	4,600	280.00	1,288,000	貸付有価証券 1,600株
7715	長野計器	24,200	2,122.00	51,352,400	
7717	ブイ・テクノロジー	16,300	2,425.00	39,527,500	貸付有価証券 2,500株
7721	東京計器	25,500	1,289.00	32,869,500	貸付有価証券 2,900株

7723	愛知時計電機	13,000	1,482.00	19,266,000	
7725	インターアクション	15,800	1,360.00	21,488,000	
7727	オーバル	19,200	402.00	7,718,400	貸付有価証券 4,000株
7729	東京精密	73,100	7,460.00	545,326,000	
7730	マニー	133,100	1,711.00	227,734,100	
7731	ニコン	481,200	1,847.00	888,776,400	貸付有価証券 82,700株
7732	トプコン	175,200	2,046.00	358,459,200	
7733	オリンパス	2,048,800	2,247.00	4,603,653,600	
7734	理研計器	20,600	5,420.00	111,652,000	
7740	タムロン	24,900	3,960.00	98,604,000	
7741	HOYA	710,900	16,715.00	11,882,693,500	貸付有価証券 89,100株
7743	シード	10,000	573.00	5,730,000	
7744	ノーリツ鋼機	31,500	2,279.00	71,788,500	
7745	A&Dホロンホールディングス	48,500	1,651.00	80,073,500	
7747	朝日インテック	371,900	2,779.50	1,033,696,050	
7762	シチズン時計	365,900	876.00	320,528,400	貸付有価証券 51,600株
7769	リズム	6,700	1,634.00	10,947,800	貸付有価証券 1,400株
7775	大研医器	17,000	515.00	8,755,000	貸付有価証券 3,100株
7780	メニコン	114,300	2,511.00	287,007,300	貸付有価証券 12,200株
7782	シンシア	1,800	611.00	1,099,800	
7979	松風	15,000	2,336.00	35,040,000	
8050	セイコーグループ	51,500	2,560.00	131,840,000	
8086	ニプロ	277,400	1,028.00	285,167,200	
7795	KYORITSU	29,400	151.00	4,439,400	貸付有価証券 7,400株
7811	中本パックス	6,000	1,688.00	10,128,000	
7816	スノーピーク	57,000	1,922.00	109,554,000	貸付有価証券 5,000株
7817	パラマウントベッドホールディングス	76,900	2,404.00	184,867,600	貸付有価証券 14,800株
7818	トランザクション	21,900	1,765.00	38,653,500	
7819	粧美堂	5,300	439.00	2,326,700	貸付有価証券 1,300株
7820	ニホンフラッシュ	31,200	965.00	30,108,000	
7821	前田工織	28,100	3,095.00	86,969,500	貸付有価証券

					6,400株
7822	永大産業	23,400	215.00	5,031,000	貸付有価証券 1,400株
7823	アートネイチャー	34,200	742.00	25,376,400	
7832	バンダイナムコホールディングス	911,900	3,267.00	2,979,177,300	貸付有価証券 40,000株
7833	アイフィスジャパン	5,500	621.00	3,415,500	
7839	SHOEI	75,200	2,590.00	194,768,000	
7840	フランスベッドホールディングス	41,200	1,103.00	45,443,600	
7846	パイロットコーポレーション	52,000	4,620.00	240,240,000	
7856	萩原工業	22,300	1,407.00	31,376,100	貸付有価証券 800株
7864	フジシールインターナショナル	67,400	1,531.00	103,189,400	
7867	タカラトミー	153,100	1,762.00	269,762,200	貸付有価証券 11,900株
7868	広済堂ホールディングス	13,300	2,136.00	28,408,800	貸付有価証券 3,100株
7872	エステールホールディングス	4,600	621.00	2,856,600	貸付有価証券 300株
7885	タカノ	7,300	815.00	5,949,500	貸付有価証券 1,700株
7893	プロネクサス	27,600	979.00	27,020,400	
7897	ホクシン	15,100	133.00	2,008,300	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	6,500	1,177.00	7,650,500	貸付有価証券 1,400株
7905	大建工業	20,200	2,315.00	46,763,000	
7911	凸版印刷	435,300	3,043.00	1,324,617,900	
7912	大日本印刷	363,800	4,102.00	1,492,307,600	
7914	共同印刷	9,400	3,080.00	28,952,000	
7915	N I S S H A	63,300	1,670.00	105,711,000	
7916	光村印刷	1,700	1,216.00	2,067,200	貸付有価証券 400株
7921	TAKARA & COMPANY	21,300	2,331.00	49,650,300	
7936	アシックス	307,200	4,284.00	1,316,044,800	貸付有価証券 9,700株
7937	ツツミ	5,800	2,272.00	13,177,600	
7944	ローランド	24,500	4,225.00	103,512,500	
7949	小松ウオール工業	12,200	2,614.00	31,890,800	
7951	ヤマハ	209,800	5,480.00	1,149,704,000	貸付有価証券 26,300株
7952	河合楽器製作所	9,000	3,280.00	29,520,000	

7955	クリナップ	37,300	712.00	26,557,600	
7956	ビジョン	212,000	2,046.50	433,858,000	
7962	キングジム	29,400	880.00	25,872,000	貸付有価証券 1,500株
7966	リンテック	66,800	2,275.50	152,003,400	
7972	イトーキ	68,200	969.00	66,085,800	
7974	任天堂	2,101,400	6,289.00	13,215,704,600	貸付有価証券 107,800株
7976	三菱鉛筆	47,300	1,703.00	80,551,900	
7981	タカラスタンダード	61,300	1,781.00	109,175,300	貸付有価証券 9,100株
7984	コクヨ	160,200	1,988.50	318,557,700	
7987	ナカバヤシ	35,800	505.00	18,079,000	
7990	グローブライド	26,900	2,200.00	59,180,000	
7994	オカムラ	100,200	1,892.00	189,578,400	
8022	美津濃	33,100	3,765.00	124,621,500	
9501	東京電力ホールディングス	3,000,400	527.20	1,581,810,880	
9502	中部電力	1,226,500	1,719.00	2,108,353,500	貸付有価証券 57,700株
9503	関西電力	1,285,300	1,774.00	2,280,122,200	貸付有価証券 168,300株
9504	中国電力	530,100	966.30	512,235,630	貸付有価証券 61,200株
9505	北陸電力	314,200	758.00	238,163,600	貸付有価証券 60,000株
9506	東北電力	813,700	881.80	717,520,660	
9507	四国電力	284,100	964.20	273,929,220	
9508	九州電力	767,300	906.70	695,710,910	貸付有価証券 91,200株
9509	北海道電力	321,600	594.90	191,319,840	
9511	沖縄電力	77,900	1,143.00	89,039,700	貸付有価証券 8,600株
9513	電源開発	250,600	2,109.50	528,640,700	
9514	エフオン	21,500	569.00	12,233,500	
9517	イーレックス	59,100	1,142.00	67,492,200	貸付有価証券 6,400株
9519	レノバ	88,600	1,632.00	144,595,200	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	703,700	3,147.00	2,214,543,900	
9532	大阪瓦斯	674,200	2,238.50	1,509,196,700	
9533	東邦瓦斯	131,000	2,535.00	332,085,000	
9534	北海道瓦斯	19,900	2,324.00	46,247,600	

9535	広島ガス	70,200	371.00	26,044,200	
9536	西部ガスホールディングス	31,200	2,043.00	63,741,600	
9543	静岡ガス	75,900	1,183.00	89,789,700	
9551	メタウォーター	41,600	1,806.00	75,129,600	貸付有価証券 4,400株
2384	SBSホールディングス	29,700	3,235.00	96,079,500	貸付有価証券 3,800株
9001	東武鉄道	365,600	3,845.00	1,405,732,000	貸付有価証券 46,700株
9003	相鉄ホールディングス	109,900	2,552.00	280,464,800	貸付有価証券 14,200株
9005	東急	933,300	1,767.00	1,649,141,100	貸付有価証券 112,000株
9006	京浜急行電鉄	377,600	1,287.00	485,971,200	
9007	小田急電鉄	504,500	1,990.00	1,003,955,000	貸付有価証券 66,000株
9008	京王電鉄	176,000	4,659.00	819,984,000	貸付有価証券 23,100株
9009	京成電鉄	214,600	5,756.00	1,235,237,600	貸付有価証券 53,700株
9010	富士急行	41,000	5,380.00	220,580,000	貸付有価証券 6,000株
9020	東日本旅客鉄道	564,500	7,927.00	4,474,791,500	貸付有価証券 112,700株
9021	西日本旅客鉄道	425,200	5,989.00	2,546,522,800	貸付有価証券 55,600株
9022	東海旅客鉄道	256,400	17,905.00	4,590,842,000	貸付有価証券 52,600株
9024	西武ホールディングス	402,600	1,518.00	611,146,800	
9025	鴻池運輸	56,700	1,626.00	92,194,200	
9031	西日本鉄道	88,900	2,433.50	216,338,150	貸付有価証券 12,300株
9037	ハマキョウレックス	26,000	3,785.00	98,410,000	
9039	サカイ引越センター	15,800	4,975.00	78,605,000	
9041	近鉄グループホールディングス	332,200	5,020.00	1,667,644,000	貸付有価証券 41,900株
9042	阪急阪神ホールディングス	443,100	4,715.00	2,089,216,500	貸付有価証券 55,900株
9044	南海電気鉄道	158,800	3,235.00	513,718,000	
9045	京阪ホールディングス	183,100	3,790.00	693,949,000	貸付有価証券 18,700株
9046	神戸電鉄	9,000	2,964.00	26,676,000	
9048	名古屋鉄道	367,200	2,323.50	853,189,200	貸付有価証券 4,100株
9052	山陽電気鉄道	25,000	2,210.00	55,250,000	

9055	アルプス物流	26,500	1,526.00	40,439,000	
9064	ヤマトホールディングス	425,500	2,617.00	1,113,533,500	貸付有価証券 73,500株
9065	山九	84,600	4,691.00	396,858,600	
9067	丸運	9,700	237.00	2,298,900	貸付有価証券 2,400株
9068	丸全昭和運輸	20,500	3,795.00	77,797,500	
9069	センコーグループホールディングス	176,000	972.00	171,072,000	
9070	トナミホールディングス	7,300	4,415.00	32,229,500	貸付有価証券 500株
9072	ニッコンホールディングス	106,400	2,793.00	297,175,200	
9074	日本石油輸送	2,200	2,790.00	6,138,000	
9075	福山通運	25,300	3,745.00	94,748,500	
9076	セイノーホールディングス	206,800	1,990.00	411,532,000	貸付有価証券 52,600株
9078	エスライン	5,500	807.00	4,438,500	
9081	神奈川中央交通	9,400	3,120.00	29,328,000	貸付有価証券 500株
9090	AZ-COM丸和ホールディングス	80,300	1,960.00	157,388,000	貸付有価証券 8,800株
9099	C&Fロジホールディングス	32,000	1,244.00	39,808,000	貸付有価証券 4,200株
9142	九州旅客鉄道	235,000	3,113.00	731,555,000	
9143	SGホールディングス	637,700	2,079.00	1,325,778,300	
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	124,000	8,312.00	1,030,688,000	
9101	日本郵船	889,000	3,108.00	2,763,012,000	貸付有価証券 105,300株
9104	商船三井	585,800	3,405.00	1,994,649,000	貸付有価証券 79,200株
9107	川崎汽船	249,600	3,358.00	838,156,800	貸付有価証券 38,700株
9110	NSユニテッド海運	17,900	3,385.00	60,591,500	貸付有価証券 2,300株
9115	明治海運	19,200	553.00	10,617,600	貸付有価証券 4,500株
9119	飯野海運	122,000	830.00	101,260,000	貸付有価証券 19,800株
9130	共栄タンカー	3,600	844.00	3,038,400	貸付有価証券 800株
9308	乾汽船	42,200	1,293.00	54,564,600	貸付有価証券 2,500株
9201	日本航空	816,200	3,035.00	2,477,167,000	貸付有価証券 76,800株
9202	ANAホールディングス	904,200	3,338.00	3,018,219,600	貸付有価証券 155,100株

9232	パスコ	3,900	1,810.00	7,059,000	貸付有価証券 800株
9058	トランコム	9,600	6,450.00	61,920,000	
9066	日新	25,200	2,457.00	61,916,400	
9301	三菱倉庫	71,400	3,599.00	256,968,600	
9302	三井倉庫ホールディングス	31,000	3,490.00	108,190,000	
9303	住友倉庫	89,600	2,376.00	212,889,600	
9304	澁澤倉庫	13,300	2,704.00	35,963,200	
9306	東陽倉庫	28,800	270.00	7,776,000	貸付有価証券 7,600株
9310	日本トランスシティ	66,900	616.00	41,210,400	貸付有価証券 4,800株
9312	ケイヒン	3,500	1,801.00	6,303,500	貸付有価証券 800株
9319	中央倉庫	16,000	1,074.00	17,184,000	
9322	川西倉庫	3,700	1,023.00	3,785,100	
9324	安田倉庫	22,700	976.00	22,155,200	
9325	ファイズホールディングス	4,300	1,336.00	5,744,800	貸付有価証券 900株
9351	東洋埠頭	5,700	1,368.00	7,797,600	貸付有価証券 1,300株
9364	上組	159,300	3,306.00	526,645,800	
9366	サンリツ	5,200	723.00	3,759,600	
9368	キムラユニティー	10,600	1,247.00	13,218,200	貸付有価証券 400株
9369	キューソー流通システム	11,800	948.00	11,186,400	
9380	東海運	11,500	284.00	3,266,000	貸付有価証券 2,400株
9381	エーアイテイナー	20,800	1,863.00	38,750,400	
9384	内外トランスライン	12,000	2,494.00	29,928,000	貸付有価証券 400株
9386	日本コンセプト	10,400	1,760.00	18,304,000	
1973	NECネットエスアイ	111,500	1,935.00	215,752,500	
2307	クロスキャット	19,100	1,111.00	21,220,100	貸付有価証券 2,200株
2317	システナ	561,200	298.00	167,237,600	
2326	デジタルアーツ	21,100	6,000.00	126,600,000	
2327	日鉄ソリューションズ	56,900	4,005.00	227,884,500	貸付有価証券 6,100株
2335	キューブシステム	19,900	1,230.00	24,477,000	
2359	コア	14,800	1,754.00	25,959,200	
2477	手間いらず	5,600	4,035.00	22,596,000	貸付有価証券

					600株
3031	ラクーンホールディングス	27,700	712.00	19,722,400	貸付有価証券 2,100株
3040	ソリトンシステムズ	17,200	1,294.00	22,256,800	
3371	ソフトクリエイイトホールディングス	27,400	1,730.00	47,402,000	貸付有価証券 3,800株
3626	T I S	365,100	3,585.00	1,308,883,500	
3627	J N Sホールディングス	9,700	623.00	6,043,100	貸付有価証券 2,000株
3632	グリー	89,500	640.00	57,280,000	
3633	GMOペパボ	4,800	1,828.00	8,774,400	貸付有価証券 500株
3635	コーエーテクモホールディングス	209,200	2,428.50	508,042,200	
3636	三菱総合研究所	16,400	5,360.00	87,904,000	貸付有価証券 400株
3639	ボルテージ	5,700	354.00	2,017,800	貸付有価証券 800株
3640	電算	2,300	1,610.00	3,703,000	貸付有価証券 500株
3648	A G S	8,300	757.00	6,283,100	貸付有価証券 2,400株
3649	ファインデックス	26,500	616.00	16,324,000	
3655	ブレインパッド	25,000	938.00	23,450,000	
3656	K L a b	66,500	340.00	22,610,000	貸付有価証券 10,600株
3657	ポールトゥウィンホールディングス	57,000	791.00	45,087,000	貸付有価証券 7,300株
3659	ネクソン	864,700	2,771.50	2,396,516,050	
3660	アイスタイル	97,000	612.00	59,364,000	
3661	エムアップホールディングス	40,900	1,182.00	48,343,800	貸付有価証券 5,200株
3662	エイチーム	19,700	668.00	13,159,600	
3665	エニグモ	42,500	399.00	16,957,500	貸付有価証券 3,700株
3666	テクノスジャパン	16,300	660.00	10,758,000	貸付有価証券 3,400株
3667	e n i s h	14,900	401.00	5,974,900	貸付有価証券 1,900株
3668	コロブラ	129,500	657.00	85,081,500	貸付有価証券 14,200株
3672	オルトプラス	15,100	231.00	3,488,100	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	195,000	440.00	85,800,000	
3675	クロス・マーケティンググループ	8,000	823.00	6,584,000	
3676	デジタルハーツホールディングス	20,800	1,258.00	26,166,400	貸付有価証券

					1,300株
3677	システム情報	26,500	758.00	20,087,000	貸付有価証券 2,900株
3678	メディアドゥ	13,500	1,447.00	19,534,500	貸付有価証券 800株
3679	じげん	97,300	744.00	72,391,200	
3681	ブイキューブ	40,000	486.00	19,440,000	貸付有価証券 2,700株
3682	エンカレッジ・テクノロジー	4,600	514.00	2,364,400	貸付有価証券 700株
3683	サイバーリンクス	6,300	714.00	4,498,200	貸付有価証券 1,400株
3686	ディー・エル・イー	14,100	341.00	4,808,100	貸付有価証券 3,000株
3687	フィックスターズ	37,700	1,403.00	52,893,100	
3688	CARTA HOLDINGS	15,700	1,277.00	20,048,900	
3694	オプティム	27,500	1,021.00	28,077,500	貸付有価証券 800株
3696	セレス	13,400	1,028.00	13,775,200	貸付有価証券 1,400株
3697	SHIFT	22,200	25,410.00	564,102,000	貸付有価証券 2,500株
3738	ティーガイア	34,900	1,700.00	59,330,000	貸付有価証券 3,800株
3741	セック	3,100	3,315.00	10,276,500	貸付有価証券 600株
3762	テクマトリックス	61,000	1,806.00	110,166,000	
3763	プロシップ	14,600	1,409.00	20,571,400	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	97,700	2,856.00	279,031,200	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	66,700	11,235.00	749,374,500	
3770	ザッパラス	6,900	350.00	2,415,000	貸付有価証券 3,300株
3771	システムリサーチ	10,400	2,647.00	27,528,800	
3774	インターネットイニシアティブ	186,300	2,684.00	500,029,200	
3778	さくらインターネット	37,500	1,184.00	44,400,000	
3784	ヴィンクス	5,900	1,448.00	8,543,200	貸付有価証券 1,200株
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	10,200	3,195.00	32,589,000	
3817	SRAホールディングス	17,100	3,205.00	54,805,500	
3826	システムインテグレータ	6,700	441.00	2,954,700	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	35,800	636.00	22,768,800	
3835	eBASE	47,000	770.00	36,190,000	貸付有価証券

					5,200株
3836	アバントグループ	42,200	1,523.00	64,270,600	貸付有価証券 3,700株
3837	アドソル日進	14,000	1,703.00	23,842,000	
3839	ODKソリューションズ	4,400	567.00	2,494,800	
3843	フリービット	17,500	1,472.00	25,760,000	貸付有価証券 2,600株
3844	コムチュア	44,100	2,015.00	88,861,500	
3852	サイバーコム	3,200	1,475.00	4,720,000	貸付有価証券 800株
3853	アステリア	26,100	778.00	20,305,800	貸付有価証券 2,600株
3854	アイル	15,600	2,875.00	44,850,000	貸付有価証券 2,200株
3901	マークライnz	18,100	2,468.00	44,670,800	
3902	メディカル・データ・ビジョン	49,800	739.00	36,802,200	貸付有価証券 4,500株
3903	g u m i	49,100	652.00	32,013,200	貸付有価証券 5,500株
3909	ショーケース	4,600	352.00	1,619,200	貸付有価証券 1,000株
3912	モバイルファクトリー	4,100	857.00	3,513,700	貸付有価証券 1,000株
3915	テラスカイ	14,400	2,850.00	41,040,000	貸付有価証券 3,400株
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	19,300	1,586.00	30,609,800	
3918	PCIホールディングス	8,300	1,132.00	9,395,600	貸付有価証券 1,800株
3920	アイビーシー	3,100	599.00	1,856,900	貸付有価証券 1,400株
3921	ネオジャパン	11,100	1,109.00	12,309,900	
3922	PR TIMES	8,400	1,409.00	11,835,600	
3923	ラクス	157,900	2,378.50	375,565,150	貸付有価証券 6,200株
3924	ランドコンピュータ	4,800	1,361.00	6,532,800	貸付有価証券 400株
3925	ダブルスタンダード	13,500	2,560.00	34,560,000	
3926	オープンドア	23,300	1,290.00	30,057,000	貸付有価証券 2,200株
3928	マイネット	6,400	339.00	2,169,600	貸付有価証券 1,400株
3932	アカツキ	15,800	2,012.00	31,789,600	貸付有価証券 1,500株
3934	ベネフィットジャパン	1,500	1,192.00	1,788,000	貸付有価証券 300株
3937	Ubicomホールディングス	10,300	1,688.00	17,386,400	貸付有価証券

					800 株
3939	カナミックネットワーク	35,900	463.00	16,621,700	
3940	ノムラシステムコーポレーション	18,500	117.00	2,164,500	貸付有価証券 4,000 株
3962	チェンジホールディングス	81,800	2,188.00	178,978,400	貸付有価証券 5,400 株
3963	シンクロ・フード	10,700	718.00	7,682,600	
3964	オークネット	16,500	1,734.00	28,611,000	貸付有価証券 1,300 株
3965	キャピタル・アセット・プランニング	3,800	815.00	3,097,000	貸付有価証券 900 株
3968	セグエグループ	5,500	1,086.00	5,973,000	貸付有価証券 600 株
3969	エイトレッド	3,000	1,414.00	4,242,000	貸付有価証券 500 株
3978	マクロミル	65,500	827.00	54,168,500	
3981	ビーグリー	3,300	1,153.00	3,804,900	貸付有価証券 800 株
3983	オロ	10,100	2,093.00	21,139,300	貸付有価証券 1,100 株
3984	ユーザーローカル	12,000	2,594.00	31,128,000	貸付有価証券 600 株
3985	テモナ	3,800	292.00	1,109,600	貸付有価証券 600 株
3992	ニーズウェル	12,200	808.00	9,857,600	
3994	マネーフォワード	80,600	5,541.00	446,604,600	貸付有価証券 9,900 株
3996	サインポスト	6,800	507.00	3,447,600	貸付有価証券 700 株
4053	S u n A s t e r i s k	23,700	1,163.00	27,563,100	
4072	電算システムホールディングス	16,100	3,280.00	52,808,000	
4180	A p p i e r G r o u p	126,500	1,712.00	216,568,000	
4284	ソルクシーズ	16,100	445.00	7,164,500	貸付有価証券 3,800 株
4295	フェイス	5,500	512.00	2,816,000	貸付有価証券 1,500 株
4298	プロトコーポレーション	41,700	1,133.00	47,246,100	貸付有価証券 3,900 株
4299	ハイマックス	10,400	1,412.00	14,684,800	貸付有価証券 1,200 株
4307	野村総合研究所	665,000	3,951.00	2,627,415,000	貸付有価証券 73,100 株
4312	サイバネットシステム	27,900	857.00	23,910,300	貸付有価証券 3,400 株
4320	C E ホールディングス	10,200	647.00	6,599,400	貸付有価証券 2,500 株
4323	日本システム技術	7,500	2,417.00	18,127,500	貸付有価証券

					1,200株
4326	インテージホールディングス	37,700	1,652.00	62,280,400	
4333	東邦システムサイエンス	5,500	1,165.00	6,407,500	貸付有価証券 1,200株
4344	ソースネクスト	169,700	198.00	33,600,600	貸付有価証券 20,400株
4348	インフォコム	43,000	2,250.00	96,750,000	貸付有価証券 4,800株
4373	シンプレクス・ホールディングス	57,100	2,510.00	143,321,000	
4382	HEROZ	11,200	2,101.00	23,531,200	貸付有価証券 500株
4384	ラクスル	80,000	1,363.00	109,040,000	貸付有価証券 3,200株
4385	メルカリ	201,100	3,337.00	671,070,700	貸付有価証券 8,300株
4390	I P S	10,800	2,317.00	25,023,600	貸付有価証券 1,100株
4392	F I G	22,900	277.00	6,343,300	貸付有価証券 4,700株
4396	システムサポート	12,900	2,058.00	26,548,200	
4420	イーソル	21,400	942.00	20,158,800	
4423	アルテリア・ネットワークス	31,100	1,968.00	61,204,800	
4430	東海ソフト	3,300	1,108.00	3,656,400	貸付有価証券 700株
4432	ウイングアーク1st	34,400	2,478.00	85,243,200	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	8,900	1,505.00	13,394,500	
4434	サーバーワークス	6,800	2,924.00	19,883,200	貸付有価証券 700株
4439	東名	1,500	3,025.00	4,537,500	貸付有価証券 100株
4440	ヴィッツ	1,900	1,482.00	2,815,800	貸付有価証券 400株
4441	トビラシステムズ	4,900	977.00	4,787,300	貸付有価証券 900株
4443	S a n s a n	109,200	1,685.50	184,056,600	貸付有価証券 16,100株
4446	L i n k - U	3,800	1,132.00	4,301,600	貸付有価証券 800株
4449	ギフティ	36,300	1,807.00	65,594,100	貸付有価証券 4,000株
4480	メドレー	44,800	5,200.00	232,960,000	
4481	ベース	11,300	5,560.00	62,828,000	
4483	J M D C	54,800	5,697.00	312,195,600	貸付有価証券 7,000株
4662	フォーカスシステムズ	24,300	1,054.00	25,612,200	

4674	クレスコ	25,800	2,037.00	52,554,600	貸付有価証券 2,600株
4676	フジ・メディア・ホールディングス	320,700	1,425.00	456,997,500	
4684	オービック	111,600	22,675.00	2,530,530,000	
4686	ジャストシステム	48,000	4,090.00	196,320,000	
4687	TDCソフト	28,100	1,656.00	46,533,600	貸付有価証券 3,800株
4689	Zホールディングス	4,750,700	352.70	1,675,571,890	
4704	トレンドマイクロ	192,800	6,847.00	1,320,101,600	貸付有価証券 21,200株
4709	IDホールディングス	22,500	1,253.00	28,192,500	
4716	日本オラクル	63,900	10,800.00	690,120,000	
4719	アルファシステムズ	10,500	3,510.00	36,855,000	
4722	フューチャー	83,100	1,733.00	144,012,300	
4725	CAC Holdings	20,500	1,745.00	35,772,500	
4726	SBテクノロジー	14,200	2,563.00	36,394,600	貸付有価証券 1,600株
4728	トーセ	5,200	769.00	3,998,800	貸付有価証券 1,800株
4733	オービックビジネスコンサルタント	65,700	5,270.00	346,239,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	179,200	3,542.00	634,726,400	
4743	アイティフォー	44,000	1,056.00	46,464,000	
4746	東計電算	4,700	6,120.00	28,764,000	
4762	エックスネット	3,300	1,029.00	3,395,700	
4768	大塚商会	189,200	5,490.00	1,038,708,000	貸付有価証券 34,200株
4776	サイボウズ	46,000	2,501.00	115,046,000	
4812	電通国際情報サービス	40,600	5,050.00	205,030,000	
4813	ACCESS	39,500	986.00	38,947,000	貸付有価証券 4,100株
4819	デジタルガレージ	59,300	3,705.00	219,706,500	貸付有価証券 7,900株
4820	EMシステムズ	55,600	783.00	43,534,800	貸付有価証券 3,200株
4825	ウェザーニューズ	10,300	6,560.00	67,568,000	
4826	CIJ	55,400	637.00	35,289,800	貸付有価証券 6,400株
4828	ビジネスエンジニアリング	4,800	3,355.00	16,104,000	貸付有価証券 1,000株
4829	日本エンタープライズ	20,500	132.00	2,706,000	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	25,100	1,145.00	28,739,500	

4845	スカラ	30,900	779.00	24,071,100	
4847	インテリジェント ウェイブ	10,500	795.00	8,347,500	貸付有価証券 2,300株
5032	ANYCOLOR	4,400	7,360.00	32,384,000	
6879	IMAGICA GROUP	27,800	605.00	16,819,000	
7518	ネットワンシステムズ	124,400	3,137.00	390,242,800	
7527	システムソフト	116,200	78.00	9,063,600	
7595	アルゴグラフィックス	30,600	3,870.00	118,422,000	
7844	マーベラス	54,200	671.00	36,368,200	
7860	エイベックス	56,700	1,496.00	84,823,200	
8056	B I P R O G Y	122,800	3,540.00	434,712,000	貸付有価証券 13,600株
8157	都築電気	17,600	1,996.00	35,129,600	貸付有価証券 1,400株
9401	T B Sホールディングス	170,900	2,555.00	436,649,500	貸付有価証券 34,200株
9404	日本テレビホールディングス	295,500	1,344.00	397,152,000	
9405	朝日放送グループホールディングス	31,200	652.00	20,342,400	
9409	テレビ朝日ホールディングス	81,100	1,581.00	128,219,100	
9412	スカパー J S A Tホールディングス	296,100	556.00	164,631,600	
9413	テレビ東京ホールディングス	24,000	3,215.00	77,160,000	
9414	日本BS放送	7,100	918.00	6,517,800	貸付有価証券 1,500株
9416	ビジョン	44,000	1,789.00	78,716,000	
9417	スマートバリュー	4,800	393.00	1,886,400	貸付有価証券 1,300株
9418	USEN-NEXT HOLDING S	37,400	3,225.00	120,615,000	貸付有価証券 1,600株
9419	ワイヤレスゲート	8,600	230.00	1,978,000	貸付有価証券 2,000株
9424	日本通信	308,100	250.00	77,025,000	貸付有価証券 33,800株
9428	クロップス	3,900	1,050.00	4,095,000	貸付有価証券 800株
9432	日本電信電話	4,277,500	4,132.00	17,674,630,000	
9433	KDDI	2,579,600	4,428.00	11,422,468,800	
9434	ソフトバンク	5,363,900	1,523.50	8,171,901,650	
9435	光通信	39,300	20,490.00	805,257,000	
9438	エムティーアイ	22,900	600.00	13,740,000	貸付有価証券 6,100株
9449	GMOインターネットグループ	123,400	2,788.00	344,039,200	貸付有価証券 17,100株

9450	ファイバーゲート	17,900	1,417.00	25,364,300	
9466	アイドママーケティングコミュニケーション	4,500	277.00	1,246,500	貸付有価証券 1,300株
9468	KADOKAWA	176,500	3,353.00	591,804,500	貸付有価証券 23,400株
9470	学研ホールディングス	55,600	865.00	48,094,000	
9474	ゼンリン	57,100	910.00	51,961,000	
9475	昭文社ホールディングス	8,500	302.00	2,567,000	貸付有価証券 2,400株
9479	インプレスホールディングス	17,500	210.00	3,675,000	貸付有価証券 3,600株
9600	アイネット	20,200	1,626.00	32,845,200	貸付有価証券 2,200株
9601	松竹	19,100	10,755.00	205,420,500	貸付有価証券 2,900株
9602	東宝	208,900	5,398.00	1,127,642,200	
9605	東映	9,200	17,730.00	163,116,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,047,400	1,977.50	2,071,233,500	
9629	ビー・シー・エー	19,200	1,320.00	25,344,000	貸付有価証券 2,400株
9658	ビジネスブレイン太田昭和	14,300	2,338.00	33,433,400	
9682	D T S	71,100	3,395.00	241,384,500	貸付有価証券 5,700株
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	167,800	6,893.00	1,156,645,400	
9692	シーイーシー	46,800	1,723.00	80,636,400	
9697	カプコン	331,700	5,436.00	1,803,121,200	貸付有価証券 40,800株
9702	アイ・エス・ビー	17,000	1,671.00	28,407,000	
9717	ジャステック	20,500	1,328.00	27,224,000	貸付有価証券 1,500株
9719	S C S K	272,400	2,259.50	615,487,800	貸付有価証券 30,300株
9739	N S W	13,000	2,391.00	31,083,000	
9742	アイネス	23,400	1,470.00	34,398,000	
9746	T K C	53,200	3,810.00	202,692,000	
9749	富士ソフト	37,800	9,120.00	344,736,000	
9759	N S D	119,100	2,867.00	341,459,700	
9766	コナミグループ	142,900	7,355.00	1,051,029,500	貸付有価証券 4,500株
9790	福井コンピュータホールディングス	23,200	2,771.00	64,287,200	貸付有価証券 1,700株
9889	J B C Cホールディングス	24,300	2,532.00	61,527,600	

9928	ミロク情報サービス	30,300	1,526.00	46,237,800	
9984	ソフトバンクグループ	1,646,700	6,622.00	10,904,447,400	貸付有価証券 344,700株
2676	高千穂交易	7,500	3,080.00	23,100,000	貸付有価証券 2,600株
2689	オルバヘルスケアホールディングス	3,500	2,000.00	7,000,000	
2692	伊藤忠食品	7,900	5,170.00	40,843,000	
2715	エレマテック	31,600	1,776.00	56,121,600	貸付有価証券 4,100株
2733	あらた	26,900	4,695.00	126,295,500	
2737	トーメンデバイス	5,100	5,010.00	25,551,000	貸付有価証券 600株
2760	東京エレクトロン デバイス	13,000	10,330.00	134,290,000	
2767	円谷フィールズホールディングス	60,500	2,778.00	168,069,000	
2768	双日	351,000	3,190.00	1,119,690,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	353,500	2,167.00	766,034,500	貸付有価証券 48,500株
2874	横浜冷凍	95,900	1,172.00	112,394,800	貸付有価証券 13,900株
3004	神栄	3,100	1,082.00	3,354,200	貸付有価証券 600株
3023	ラサ商事	9,600	1,444.00	13,862,400	貸付有価証券 2,300株
3036	アルコニックス	46,300	1,368.00	63,338,400	貸付有価証券 4,600株
3038	神戸物産	272,400	3,765.00	1,025,586,000	貸付有価証券 30,000株
3054	ハイパー	3,900	448.00	1,747,200	貸付有価証券 600株
3076	あい ホールディングス	56,400	2,346.00	132,314,400	
3079	ディーブイエックス	7,200	909.00	6,544,800	貸付有価証券 1,600株
3107	ダイワボウホールディングス	143,900	2,728.50	392,631,150	貸付有価証券 6,200株
3132	マクニカホールディングス	83,300	5,690.00	473,977,000	
3139	ラクト・ジャパン	13,600	2,032.00	27,635,200	貸付有価証券 1,600株
3150	グリムス	14,700	2,890.00	42,483,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	51,400	895.00	46,003,000	
3153	八洲電機	28,500	1,380.00	39,330,000	
3154	メディアスホールディングス	22,500	899.00	20,227,500	
3156	レスターホールディングス	33,700	2,433.00	81,992,100	
3157	ジュエテックホールディングス	4,100	1,163.00	4,768,300	貸付有価証券 1,000株

3160	大光	8,900	570.00	5,073,000	貸付有価証券 1,800株
3166	OCHIホールディングス	4,700	1,259.00	5,917,300	貸付有価証券 1,300株
3167	TOKAIホールディングス	173,900	887.00	154,249,300	
3168	黒谷	5,700	599.00	3,414,300	貸付有価証券 1,000株
3173	Cominix	3,700	864.00	3,196,800	
3176	三洋貿易	39,700	1,411.00	56,016,700	
3180	ビューティガレージ	5,600	4,475.00	25,060,000	貸付有価証券 200株
3183	ウイン・パートナーズ	25,600	1,024.00	26,214,400	
3321	ミタチ産業	5,300	1,401.00	7,425,300	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	126,500	2,379.50	301,006,750	
3388	明治電機工業	13,100	1,415.00	18,536,500	
3392	デリカフーズホールディングス	8,200	589.00	4,829,800	
3393	スターティアホールディングス	4,800	1,342.00	6,441,600	貸付有価証券 1,000株
3543	コメダホールディングス	86,300	2,670.00	230,421,000	
3559	ビーバンドットコム	2,900	461.00	1,336,900	貸付有価証券 800株
3565	アセンテック	11,800	629.00	7,422,200	
5009	富士興産	5,300	1,516.00	8,034,800	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	2,100	2,045.00	4,294,500	
7128	フルサト・マルカホールディングス	35,000	2,296.00	80,360,000	
7130	ヤマエグループホールディングス	19,900	3,015.00	59,998,500	
7414	小野建	34,600	1,597.00	55,256,200	
7417	南陽	4,000	2,142.00	8,568,000	貸付有価証券 1,000株
7420	佐鳥電機	13,100	1,658.00	21,719,800	貸付有価証券 3,200株
7427	エコートレーディング	4,400	789.00	3,471,600	
7433	伯東	20,200	5,210.00	105,242,000	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	27,100	1,135.00	30,758,500	
7442	中山福	11,100	341.00	3,785,100	貸付有価証券 2,500株
7447	ナガイレーベン	44,500	2,267.00	100,881,500	貸付有価証券 6,300株
7451	三菱食品	32,500	3,615.00	117,487,500	
7456	松田産業	26,800	2,241.00	60,058,800	

7458	第一興商	136,300	2,512.00	342,385,600	
7459	メディopalホールディングス	336,800	2,385.50	803,436,400	貸付有価証券 47,000株
7466	S P K	15,600	1,782.00	27,799,200	
7467	萩原電気ホールディングス	13,500	3,145.00	42,457,500	貸付有価証券 1,600株
7476	アズワン	50,100	5,686.00	284,868,600	貸付有価証券 100株
7480	スズデン	12,300	2,196.00	27,010,800	貸付有価証券 1,500株
7481	尾家産業	4,900	1,251.00	6,129,900	貸付有価証券 1,300株
7482	シモジマ	24,200	1,092.00	26,426,400	貸付有価証券 2,700株
7483	ドウシシャ	37,200	2,284.00	84,964,800	
7487	小津産業	4,700	1,599.00	7,515,300	
7504	高速	18,300	2,011.00	36,801,300	
7510	たけびし	13,400	1,711.00	22,927,400	
7525	リックス	4,300	3,085.00	13,265,500	貸付有価証券 1,000株
7537	丸文	31,400	1,278.00	40,129,200	
7552	ハピネット	29,900	2,109.00	63,059,100	貸付有価証券 3,600株
7570	橋本総業ホールディングス	13,900	1,261.00	17,527,900	
7575	日本ライフライン	103,200	1,043.00	107,637,600	
7590	タカショー	30,700	673.00	20,661,100	貸付有価証券 2,600株
7599	I D O M	106,400	875.00	93,100,000	貸付有価証券 5,300株
7607	進和	21,500	2,253.00	48,439,500	
7608	エスケイジャパン	5,100	552.00	2,815,200	貸付有価証券 1,000株
7609	ダイトロン	13,900	3,010.00	41,839,000	
7613	シークス	50,200	1,546.00	77,609,200	貸付有価証券 4,800株
7619	田中商事	6,500	652.00	4,238,000	
7628	オーハシテクニカ	17,000	1,569.00	26,673,000	貸付有価証券 1,000株
7637	白銅	12,700	2,338.00	29,692,600	
7673	ダイコー通産	2,500	1,120.00	2,800,000	貸付有価証券 500株
8001	伊藤忠商事	2,170,000	5,645.00	12,249,650,000	
8002	丸紅	2,748,200	2,488.50	6,838,895,700	貸付有価証券 452,700株

8007	高島	3,000	3,550.00	10,650,000	貸付有価証券 700株
8012	長瀬産業	161,400	2,372.50	382,921,500	
8014	蝶理	18,900	2,854.00	53,940,600	貸付有価証券 2,800株
8015	豊田通商	308,500	7,016.00	2,164,436,000	貸付有価証券 48,700株
8018	三共生興	50,500	553.00	27,926,500	貸付有価証券 6,600株
8020	兼松	136,700	1,977.00	270,255,900	
8025	ツカモトコーポレーション	3,500	1,351.00	4,728,500	
8031	三井物産	2,499,300	5,460.00	13,646,178,000	
8032	日本紙パルプ商事	18,700	5,060.00	94,622,000	貸付有価証券 1,000株
8037	カメイ	37,400	1,435.00	53,669,000	
8038	東都水産	1,100	6,480.00	7,128,000	
8041	OUGホールディングス	3,100	2,454.00	7,607,400	貸付有価証券 700株
8043	スターゼン	26,700	2,322.00	61,997,400	貸付有価証券 1,200株
8051	山善	94,900	1,115.00	105,813,500	
8052	椿本興業	5,700	4,075.00	23,227,500	
8053	住友商事	2,181,000	3,042.00	6,634,602,000	貸付有価証券 274,200株
8057	内田洋行	14,300	5,520.00	78,936,000	
8058	三菱商事	2,178,200	6,924.00	15,081,856,800	貸付有価証券 306,000株
8059	第一実業	12,400	5,730.00	71,052,000	貸付有価証券 1,100株
8060	キャノンマーケティングジャパン	81,600	3,534.00	288,374,400	
8061	西華産業	13,800	1,992.00	27,489,600	
8065	佐藤商事	24,400	1,433.00	34,965,200	貸付有価証券 3,600株
8068	菱洋エレクトロ	30,000	3,420.00	102,600,000	
8070	東京産業	32,100	896.00	28,761,600	貸付有価証券 3,900株
8074	ユアサ商事	31,700	4,330.00	137,261,000	貸付有価証券 4,200株
8075	神鋼商事	8,800	5,740.00	50,512,000	
8077	トルク	11,200	258.00	2,889,600	貸付有価証券 2,600株
8078	阪和興業	63,200	4,560.00	288,192,000	
8079	正栄食品工業	23,400	4,275.00	100,035,000	貸付有価証券 1,700株

8081	カナデン	23,500	1,282.00	30,127,000	
8084	RYODEN	28,400	2,128.00	60,435,200	貸付有価証券 2,700株
8088	岩谷産業	80,200	7,512.00	602,462,400	貸付有価証券 9,700株
8089	ナイス	6,500	1,463.00	9,509,500	貸付有価証券 1,800株
8091	ニチモウ	2,500	3,775.00	9,437,500	
8093	極東貿易	21,000	1,672.00	35,112,000	貸付有価証券 1,600株
8095	アステナホールディングス	60,900	446.00	27,161,400	
8097	三愛オブリ	93,100	1,499.00	139,556,900	貸付有価証券 10,800株
8098	稲畑産業	71,100	3,200.00	227,520,000	
8101	G S I クレオス	20,400	2,038.00	41,575,200	貸付有価証券 2,200株
8103	明和産業	46,800	670.00	31,356,000	貸付有価証券 4,000株
8104	クワザワホールディングス	7,500	550.00	4,125,000	貸付有価証券 1,600株
8125	ワキタ	64,800	1,302.00	84,369,600	
8129	東邦ホールディングス	87,700	2,598.00	227,844,600	
8130	サンゲツ	88,400	2,472.00	218,524,800	
8131	ミツウロコグループホールディングス	44,900	1,389.00	62,366,100	貸付有価証券 2,800株
8132	シナネンホールディングス	11,400	3,820.00	43,548,000	貸付有価証券 700株
8133	伊藤忠エネクス	87,300	1,237.00	107,990,100	
8136	サンリオ	99,800	5,566.00	555,486,800	貸付有価証券 5,200株
8137	サンワテクノス	18,000	2,335.00	42,030,000	
8140	リョーサン	37,300	4,205.00	156,846,500	貸付有価証券 4,800株
8141	新光商事	47,300	1,165.00	55,104,500	貸付有価証券 6,900株
8142	トーホー	15,100	2,976.00	44,937,600	
8150	三信電気	14,200	2,112.00	29,990,400	
8151	東陽テクニカ	35,700	1,425.00	50,872,500	
8153	モスフードサービス	51,800	3,215.00	166,537,000	
8154	加賀電子	28,600	6,150.00	175,890,000	貸付有価証券 4,400株
8158	ソーダニッカ	16,900	808.00	13,655,200	貸付有価証券 4,500株
8159	立花エレテック	25,700	3,080.00	79,156,000	貸付有価証券 3,200株

8275	フォーバル	13,800	1,052.00	14,517,600	
8283	PALTAC	55,400	4,823.00	267,194,200	貸付有価証券 5,600株
8285	三谷産業	61,500	319.00	19,618,500	貸付有価証券 5,700株
8835	太平洋興発	7,800	753.00	5,873,400	貸付有価証券 1,700株
9260	西本Wismettacホールディングス	8,900	4,615.00	41,073,500	
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,900	2,050.00	3,895,000	貸付有価証券 300株
9273	コア商事ホールディングス	19,700	706.00	13,908,200	
9274	KPPグループホールディングス	82,100	624.00	51,230,400	貸付有価証券 10,300株
9305	ヤマタネ	15,500	1,686.00	26,133,000	
9763	丸紅建材リース	1,800	2,380.00	4,284,000	
9824	泉州電業	17,600	3,585.00	63,096,000	
9830	トラスコ中山	73,900	2,291.00	169,304,900	
9832	オートバックスセブン	122,600	1,528.50	187,394,100	
9837	モリト	25,200	1,030.00	25,956,000	
9869	加藤産業	43,600	3,915.00	170,694,000	
9872	北恵	4,700	753.00	3,539,100	貸付有価証券 800株
9882	イエローハット	62,100	1,850.00	114,885,000	
9896	JKホールディングス	27,000	969.00	26,163,000	貸付有価証券 4,000株
9902	日伝	20,800	2,371.00	49,316,800	貸付有価証券 4,000株
9930	北沢産業	11,100	438.00	4,861,800	貸付有価証券 3,300株
9932	杉本商事	15,600	2,166.00	33,789,600	
9934	因幡電機産業	91,300	3,285.00	299,920,500	
9960	東テク	11,800	4,300.00	50,740,000	貸付有価証券 1,400株
9962	ミスミグループ本社	531,500	2,907.00	1,545,070,500	
9972	アルテック	11,600	271.00	3,143,600	貸付有価証券 3,000株
9982	タキヒヨー	5,700	916.00	5,221,200	
9986	蔵王産業	4,100	2,279.00	9,343,900	
9987	スズケン	103,100	3,823.00	394,151,300	
9991	ジェコス	21,000	853.00	17,913,000	貸付有価証券 3,000株
9995	グローセル	22,900	405.00	9,274,500	貸付有価証券

					4,300株
2651	ローソン	87,400	6,392.00	558,660,800	貸付有価証券 2,100株
2659	サンエー	26,900	4,595.00	123,605,500	
2664	カワチ薬品	27,500	2,189.00	60,197,500	
2670	エービーシー・マート	51,400	7,679.00	394,700,600	
2674	ハードオフコーポレーション	9,300	1,404.00	13,057,200	
2678	アスクル	72,800	1,993.00	145,090,400	貸付有価証券 9,200株
2681	ゲオホールディングス	34,400	1,719.00	59,133,600	
2685	アダストリア	42,500	2,989.00	127,032,500	
2686	ジーフット	12,700	274.00	3,479,800	貸付有価証券 2,700株
2687	シー・ヴィ・エス・バイエリア	3,100	505.00	1,565,500	貸付有価証券 600株
2695	くら寿司	41,200	3,075.00	126,690,000	貸付有価証券 4,600株
2698	キャンドウ	12,500	2,430.00	30,375,000	貸付有価証券 1,600株
2722	I Kホールディングス	6,700	368.00	2,465,600	貸付有価証券 1,300株
2726	バルグループホールディングス	34,600	3,775.00	130,615,000	貸付有価証券 4,400株
2730	エディオン	139,400	1,427.00	198,923,800	貸付有価証券 38,400株
2734	サーラコーポレーション	74,000	778.00	57,572,000	
2735	ワッツ	10,200	712.00	7,262,400	貸付有価証券 1,900株
2742	ハローズ	16,000	3,555.00	56,880,000	
2752	フジオフードグループ本社	39,100	1,490.00	58,259,000	貸付有価証券 1,400株
2753	あみやき亭	8,500	3,510.00	29,835,000	
2764	ひらまつ	44,800	240.00	10,752,000	貸付有価証券 8,600株
2791	大黒天物産	10,800	5,290.00	57,132,000	貸付有価証券 1,100株
2792	ハニーズホールディングス	27,800	1,559.00	43,340,200	
2796	ファーマライズホールディングス	4,500	617.00	2,776,500	
3028	アルペン	29,000	2,034.00	58,986,000	貸付有価証券 2,400株
3030	ハブ	6,900	808.00	5,575,200	貸付有価証券 1,300株
3034	クオールホールディングス	48,400	1,725.00	83,490,000	
3046	ジンズホールディングス	20,900	2,998.00	62,658,200	

3048	ビクカメラ	187,300	1,071.00	200,598,300	貸付有価証券 25,900株
3050	DCMホールディングス	204,700	1,219.00	249,529,300	
3053	ペッパーフードサービス	83,000	131.00	10,873,000	貸付有価証券 7,000株
3064	Monotaro	499,200	1,833.50	915,283,200	貸付有価証券 32,900株
3067	東京一番フーズ	4,800	502.00	2,409,600	
3073	DDグループ	11,100	1,387.00	15,395,700	貸付有価証券 1,700株
3082	きちりホールディングス	5,600	896.00	5,017,600	貸付有価証券 1,200株
3085	アークランドサービスホールディングス	28,800	2,929.00	84,355,200	貸付有価証券 3,200株
3086	J.フロントリテイリング	437,800	1,391.50	609,198,700	
3087	ドトール・日レスホールディングス	62,400	2,056.00	128,294,400	
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	213,500	8,093.00	1,727,855,500	貸付有価証券 25,800株
3091	ブロンコビリー	18,800	2,935.00	55,178,000	
3092	ZOZO	232,700	3,066.00	713,458,200	
3093	トレジャー・ファクトリー	12,400	1,606.00	19,914,400	
3097	物語コーポレーション	58,800	3,435.00	201,978,000	貸付有価証券 1,900株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	592,900	1,443.00	855,554,700	貸付有価証券 76,400株
3134	Hamee	12,200	1,065.00	12,993,000	貸付有価証券 1,300株
3135	マーケットエンタープライズ	2,100	1,518.00	3,187,800	貸付有価証券 300株
3141	ウエルシアホールディングス	182,700	2,978.50	544,171,950	
3148	クリエイトSDホールディングス	58,200	3,525.00	205,155,000	
3159	丸善CHIホールディングス	24,700	351.00	8,669,700	貸付有価証券 5,100株
3169	ミサワ	4,300	612.00	2,631,600	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	2,800	1,479.00	4,141,200	貸付有価証券 600株
3175	エー・ピーホールディングス	4,100	784.00	3,214,400	貸付有価証券 300株
3178	チムニー	6,500	1,289.00	8,378,500	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	26,200	1,125.00	29,475,000	貸付有価証券 2,900株
3182	オイシックス・ラ・大地	47,300	2,470.00	116,831,000	
3186	ネクステージ	80,400	2,735.00	219,894,000	貸付有価証券 8,500株

3191	ジョイフル本田	104,600	1,706.00	178,447,600	貸付有価証券 5,400株
3193	鳥貴族ホールディングス	13,000	2,558.00	33,254,000	貸付有価証券 1,400株
3196	ホットランド	27,000	1,726.00	46,602,000	貸付有価証券 2,200株
3197	すかいらくホールディングス	481,400	1,883.00	906,476,200	貸付有価証券 11,700株
3198	SFPホールディングス	19,300	2,089.00	40,317,700	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	27,200	1,360.00	36,992,000	
3221	ヨシックスホールディングス	4,100	2,410.00	9,881,000	貸付有価証券 700株
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ ホール	114,700	1,113.00	127,661,100	貸付有価証券 12,700株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	15,900	794.00	12,624,600	
3328	BEENOS	14,900	2,027.00	30,202,300	貸付有価証券 1,500株
3333	あさひ	29,400	1,281.00	37,661,400	
3341	日本調剤	23,900	1,162.00	27,771,800	貸付有価証券 4,200株
3349	コスモス薬品	34,900	14,375.00	501,687,500	貸付有価証券 3,800株
3361	トーエル	9,300	753.00	7,002,900	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	1,213,700	6,085.00	7,385,364,500	
3387	クリエイト・レストランツ・ホールデ ィング	264,900	977.00	258,807,300	
3391	ツルハホールディングス	73,900	10,895.00	805,140,500	貸付有価証券 9,500株
3395	サンマルクホールディングス	28,400	1,877.00	53,306,800	
3396	フェリシモ	4,700	1,016.00	4,775,200	
3397	トリドールホールディングス	87,600	3,045.00	266,742,000	貸付有価証券 6,000株
3415	TOKYO BASE	36,200	358.00	12,959,600	貸付有価証券 3,900株
3538	ウイルプラスホールディングス	4,000	1,313.00	5,252,000	
3539	JMホールディングス	26,600	1,990.00	52,934,000	
3544	サツドラホールディングス	9,500	765.00	7,267,500	貸付有価証券 1,800株
3546	アレンザホールディングス	26,300	987.00	25,958,100	
3547	串カツ田中ホールディングス	9,400	1,686.00	15,848,400	貸付有価証券 700株
3548	パロックジャパンリミテッド	22,800	854.00	19,471,200	
3549	クスリのアオキホールディングス	31,400	8,077.00	253,617,800	貸付有価証券 4,400株

3561	力の源ホールディングス	11,200	2,014.00	22,556,800	貸付有価証券 1,900株
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	187,800	2,892.50	543,211,500	
4350	メディカルシステムネットワーク	30,500	377.00	11,498,500	
7127	一家ホールディングス	4,500	625.00	2,812,500	貸付有価証券 1,000株
7135	ジャパングラフトホールディングス	6,500	560.00	3,640,000	貸付有価証券 800株
7416	はるやまホールディングス	9,900	497.00	4,920,300	
7419	ノジマ	114,900	1,377.00	158,217,300	
7421	カップ・クリエイト	55,400	1,529.00	84,706,600	
7445	ライトオン	15,800	582.00	9,195,600	
7453	良品計画	384,400	1,391.50	534,892,600	
7455	パリミキホールディングス	26,100	325.00	8,482,500	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	33,500	925.00	30,987,500	貸付有価証券 700株
7475	アルビス	11,500	2,399.00	27,588,500	貸付有価証券 500株
7494	コナカ	22,800	377.00	8,595,600	貸付有価証券 5,100株
7506	ハウス オブ ローゼ	2,600	1,616.00	4,201,600	
7508	G-7ホールディングス	43,900	1,311.00	57,552,900	貸付有価証券 5,200株
7512	イオン北海道	52,100	879.00	45,795,900	貸付有価証券 5,200株
7513	コジマ	58,200	576.00	33,523,200	
7514	ヒマラヤ	6,600	949.00	6,263,400	
7516	コーナン商事	47,500	3,490.00	165,775,000	貸付有価証券 6,200株
7520	エコス	13,000	1,863.00	24,219,000	
7522	ワタミ	42,500	896.00	38,080,000	貸付有価証券 2,900株
7524	マルシェ	6,900	262.00	1,807,800	貸付有価証券 900株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	710,900	2,475.50	1,759,832,950	
7545	西松屋チェーン	78,000	1,686.00	131,508,000	貸付有価証券 9,600株
7550	ゼンショーホールディングス	192,800	6,218.00	1,198,830,400	貸付有価証券 6,500株
7554	幸楽苑ホールディングス	23,000	1,010.00	23,230,000	
7561	ハークスレイ	8,800	620.00	5,456,000	貸付有価証券 1,800株

7581	サイゼリヤ	52,100	3,665.00	190,946,500	貸付有価証券 100株
7593	V Tホールディングス	133,700	540.00	72,198,000	
7596	魚力	10,900	2,180.00	23,762,000	
7601	ポプラ	4,600	192.00	883,200	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	19,900	1,669.00	33,213,100	
7606	ユナイテッドアローズ	37,600	2,434.00	91,518,400	貸付有価証券 7,500株
7611	ハイデイ日高	52,200	2,337.00	121,991,400	貸付有価証券 6,300株
7615	YU-WA Creation Holdi	12,400	195.00	2,418,000	貸付有価証券 2,700株
7616	コロワイド	162,300	2,022.00	328,170,600	貸付有価証券 14,500株
7618	ピーシーデポコーポレーション	39,300	479.00	18,824,700	貸付有価証券 5,800株
7630	壱番屋	27,800	5,460.00	151,788,000	貸付有価証券 2,400株
7640	トップカルチャー	6,700	191.00	1,279,700	貸付有価証券 1,600株
7646	P L A N T	4,900	704.00	3,449,600	貸付有価証券 1,100株
7649	スギホールディングス	70,900	6,198.00	439,438,200	貸付有価証券 8,700株
7679	薬王堂ホールディングス	19,700	2,502.00	49,289,400	
7918	ヴィア・ホールディングス	27,800	84.00	2,335,200	貸付有価証券 5,300株
8005	スクロール	52,200	958.00	50,007,600	
8008	ヨンドシーホールディングス	30,300	1,778.00	53,873,400	貸付有価証券 400株
8160	木曽路	53,300	2,383.00	127,013,900	
8163	S R Sホールディングス	58,100	935.00	54,323,500	
8165	千趣会	64,800	411.00	26,632,800	貸付有価証券 7,800株
8166	タカキュー	14,300	79.00	1,129,700	貸付有価証券 3,300株
8167	リテールパートナーズ	52,300	1,610.00	84,203,000	貸付有価証券 5,900株
8168	ケーヨー	56,800	806.00	45,780,800	
8173	上新電機	31,400	1,923.00	60,382,200	貸付有価証券 5,100株
8174	日本瓦斯	188,700	1,980.00	373,626,000	
8179	ロイヤルホールディングス	68,300	2,769.00	189,122,700	貸付有価証券 1,800株
8181	東天紅	1,500	786.00	1,179,000	

8182	いなげや	34,200	1,514.00	51,778,800	貸付有価証券 5,400株
8185	チヨダ	33,600	878.00	29,500,800	
8194	ライフコーポレーション	30,800	3,055.00	94,094,000	貸付有価証券 1,700株
8200	リンガーハット	45,400	2,473.00	112,274,200	貸付有価証券 6,900株
8203	MrMaxHD	49,300	621.00	30,615,300	
8207	テンアライド	21,200	280.00	5,936,000	貸付有価証券 6,200株
8214	AOKIホールディングス	65,500	862.00	56,461,000	貸付有価証券 8,700株
8217	オークワ	56,300	875.00	49,262,500	貸付有価証券 5,200株
8218	コメリ	54,200	2,974.00	161,190,800	貸付有価証券 6,700株
8219	青山商事	75,300	1,288.00	96,986,400	
8227	しまむら	41,400	14,045.00	581,463,000	
8230	はせがわ	11,200	351.00	3,931,200	貸付有価証券 2,300株
8233	高島屋	265,500	1,876.00	498,078,000	貸付有価証券 11,500株
8237	松屋	59,700	1,121.00	66,923,700	貸付有価証券 8,800株
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	171,400	1,470.00	251,958,000	貸付有価証券 20,700株
8244	近鉄百貨店	15,100	2,523.00	38,097,300	
8252	丸井グループ	259,700	2,398.00	622,760,600	
8255	アクシアル リテイリング	24,000	3,615.00	86,760,000	貸付有価証券 3,600株
8260	井筒屋	9,900	348.00	3,445,200	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	1,193,800	2,942.50	3,512,756,500	貸付有価証券 258,300株
8273	イズミ	53,500	3,400.00	181,900,000	
8276	平和堂	58,900	2,156.00	126,988,400	貸付有価証券 8,900株
8278	フジ	54,100	1,825.00	98,732,500	貸付有価証券 5,200株
8279	ヤオコー	39,800	7,226.00	287,594,800	貸付有価証券 7,500株
8281	ゼビオホールディングス	47,700	1,088.00	51,897,600	
8282	ケーズホールディングス	248,900	1,253.00	311,871,700	貸付有価証券 42,200株
8289	Olympicグループ	9,300	552.00	5,133,600	貸付有価証券 2,200株

8291	日産東京販売ホールディングス	31,100	348.00	10,822,800	貸付有価証券 6,400株
9262	シルバーライフ	6,700	1,320.00	8,844,000	貸付有価証券 600株
9267	Genky Drug Stores	15,400	4,430.00	68,222,000	貸付有価証券 900株
9275	ナルミヤ・インターナショナル	4,300	964.00	4,145,200	
9278	ブックオフグループホールディングス	12,300	1,252.00	15,399,600	
9279	ギフトホールディングス	7,400	4,990.00	36,926,000	
9627	アインホールディングス	48,500	5,162.00	250,357,000	貸付有価証券 5,900株
9828	元気寿司	10,000	3,270.00	32,700,000	
9831	ヤマダホールディングス	1,444,000	422.50	610,090,000	貸付有価証券 141,400株
9842	アークランズ	51,500	1,572.00	80,958,000	貸付有価証券 6,800株
9843	ニトリホールディングス	142,400	16,140.00	2,298,336,000	
9850	グルメ杵屋	28,500	1,036.00	29,526,000	
9854	愛眼	15,500	182.00	2,821,000	貸付有価証券 3,500株
9856	ケーユーホールディングス	20,600	1,259.00	25,935,400	
9861	吉野家ホールディングス	137,800	2,574.50	354,766,100	
9887	松屋フーズホールディングス	16,600	4,095.00	67,977,000	
9900	サガミホールディングス	56,600	1,250.00	70,750,000	貸付有価証券 5,800株
9919	関西フードマーケット	31,800	1,529.00	48,622,200	貸付有価証券 3,600株
9936	王将フードサービス	23,200	6,630.00	153,816,000	
9946	ミニストップ	25,600	1,443.00	36,940,800	
9948	アークス	64,600	2,447.00	158,076,200	貸付有価証券 8,900株
9956	バローホールディングス	67,200	1,975.00	132,720,000	
9974	ベルク	17,500	6,390.00	111,825,000	
9979	大庄	11,300	1,128.00	12,746,400	貸付有価証券 2,300株
9983	ファーストリテイリング	158,400	35,790.00	5,669,136,000	貸付有価証券 17,400株
9989	サンドラッグ	133,700	4,256.00	569,027,200	貸付有価証券 16,400株
9990	サックスパーホールディングス	33,400	1,035.00	34,569,000	貸付有価証券 2,300株
9993	ヤマザワ	4,400	1,260.00	5,544,000	貸付有価証券 1,000株
9994	やまや	4,300	2,689.00	11,562,700	

9997	ベルーナ	84,700	716.00	60,645,200	貸付有価証券 9,400株
5830	いよぎんホールディングス	390,100	787.60	307,242,760	貸付有価証券 62,100株
5831	しずおかフィナンシャルグループ	740,800	1,032.00	764,505,600	貸付有価証券 65,100株
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	276,000	860.80	237,580,800	
5838	楽天銀行	114,000	1,935.00	220,590,000	
7150	島根銀行	6,700	480.00	3,216,000	貸付有価証券 900株
7161	じもとホールディングス	14,000	381.00	5,334,000	貸付有価証券 2,900株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,626,700	330.90	538,275,030	貸付有価証券 226,900株
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	42,000	3,070.00	128,940,000	
7180	九州フィナンシャルグループ	576,800	583.10	336,332,080	貸付有価証券 87,500株
7182	ゆうちょ銀行	918,600	1,124.50	1,032,965,700	
7184	富山第一銀行	108,900	725.00	78,952,500	貸付有価証券 10,400株
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,758,900	551.60	970,209,240	貸付有価証券 257,600株
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	203,500	1,237.00	251,729,500	貸付有価証券 26,400株
7322	三十三フィナンシャルグループ	29,300	1,564.00	45,825,200	
7327	第四北越フィナンシャルグループ	51,500	3,035.00	156,302,500	貸付有価証券 7,600株
7337	ひろぎんホールディングス	427,700	789.30	337,583,610	貸付有価証券 16,000株
7350	おきなわフィナンシャルグループ	31,200	2,078.00	64,833,600	貸付有価証券 4,000株
7380	十六フィナンシャルグループ	42,500	3,035.00	128,987,500	
7381	北國フィナンシャルホールディングス	36,800	4,090.00	150,512,000	貸付有価証券 4,500株
7384	プロクレアホールディングス	40,100	2,034.00	81,563,400	貸付有価証券 4,600株
7389	あいちフィナンシャルグループ	45,900	2,257.00	103,596,300	貸付有価証券 7,100株
8303	S B I 新生銀行	76,600	2,810.00	215,246,000	
8304	あおぞら銀行	206,100	2,660.00	548,226,000	貸付有価証券 26,000株
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	20,530,100	1,006.50	20,663,545,650	
8308	りそなホールディングス	4,143,300	669.50	2,773,939,350	貸付有価証券 479,100株
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	595,700	4,963.00	2,956,459,100	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,395,500	5,924.00	14,190,942,000	貸付有価証券

					302,300株
8331	千葉銀行	913,600	864.00	789,350,400	
8334	群馬銀行	636,100	516.50	328,545,650	
8336	武蔵野銀行	42,100	2,099.00	88,367,900	貸付有価証券 6,500株
8337	千葉興業銀行	45,600	578.00	26,356,800	貸付有価証券 12,200株
8338	筑波銀行	143,900	200.00	28,780,000	
8341	七十七銀行	105,000	2,448.00	257,040,000	貸付有価証券 14,700株
8343	秋田銀行	22,000	1,667.00	36,674,000	
8344	山形銀行	36,400	1,019.00	37,091,600	貸付有価証券 1,600株
8345	岩手銀行	22,400	2,014.00	45,113,600	貸付有価証券 2,900株
8346	東邦銀行	259,300	222.00	57,564,600	貸付有価証券 39,100株
8349	東北銀行	9,500	1,010.00	9,595,000	貸付有価証券 2,100株
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	261,700	2,801.00	733,021,700	貸付有価証券 36,900株
8358	スルガ銀行	288,900	570.00	164,673,000	
8359	八十二銀行	692,400	610.60	422,779,440	貸付有価証券 108,900株
8360	山梨中央銀行	33,700	1,207.00	40,675,900	
8361	大垣共立銀行	62,500	1,812.00	113,250,000	貸付有価証券 8,700株
8362	福井銀行	29,300	1,420.00	41,606,000	貸付有価証券 3,700株
8364	清水銀行	13,000	1,434.00	18,642,000	
8365	富山銀行	3,300	1,648.00	5,438,400	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	54,500	2,648.00	144,316,000	貸付有価証券 8,700株
8367	南都銀行	49,300	2,397.00	118,172,100	貸付有価証券 7,200株
8368	百五銀行	308,400	404.00	124,593,600	貸付有価証券 31,300株
8369	京都銀行	103,800	7,069.00	733,762,200	貸付有価証券 15,700株
8370	紀陽銀行	117,300	1,451.00	170,202,300	貸付有価証券 15,400株
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	208,400	1,134.00	236,325,600	貸付有価証券 29,000株
8381	山陰合同銀行	205,200	791.00	162,313,200	貸付有価証券 25,900株
8383	鳥取銀行	6,700	1,140.00	7,638,000	貸付有価証券

					1,400株
8386	百十四銀行	29,900	1,823.00	54,507,700	貸付有価証券 4,600株
8387	四国銀行	52,100	846.00	44,076,600	
8388	阿波銀行	46,000	1,960.00	90,160,000	貸付有価証券 7,100株
8392	大分銀行	19,700	2,125.00	41,862,500	貸付有価証券 2,500株
8393	宮崎銀行	21,400	2,270.00	48,578,000	
8395	佐賀銀行	19,200	1,646.00	31,603,200	
8399	琉球銀行	75,100	906.00	68,040,600	貸付有価証券 10,100株
8410	セブン銀行	1,174,300	282.20	331,387,460	貸付有価証券 76,700株
8411	みずほフィナンシャルグループ	4,740,900	2,131.00	10,102,857,900	
8416	高知銀行	6,700	697.00	4,669,900	貸付有価証券 1,600株
8418	山口フィナンシャルグループ	361,900	934.20	338,086,980	貸付有価証券 54,500株
8522	名古屋銀行	21,600	3,235.00	69,876,000	貸付有価証券 2,300株
8524	北洋銀行	496,700	275.00	136,592,500	貸付有価証券 65,900株
8537	大光銀行	6,300	1,050.00	6,615,000	貸付有価証券 1,500株
8541	愛媛銀行	44,200	792.00	35,006,400	
8542	トマト銀行	6,400	1,024.00	6,553,600	貸付有価証券 1,700株
8544	京葉銀行	150,000	522.00	78,300,000	貸付有価証券 4,500株
8550	栃木銀行	150,100	246.00	36,924,600	貸付有価証券 21,200株
8551	北日本銀行	11,500	2,028.00	23,322,000	貸付有価証券 1,400株
8558	東和銀行	60,200	520.00	31,304,000	貸付有価証券 6,600株
8562	福島銀行	22,400	210.00	4,704,000	貸付有価証券 4,100株
8563	大東銀行	9,300	623.00	5,793,900	貸付有価証券 2,200株
8600	トモニホールディングス	264,900	357.00	94,569,300	貸付有価証券 33,800株
8713	フィデアホールディングス	33,900	1,344.00	45,561,600	
8714	池田泉州ホールディングス	419,700	230.00	96,531,000	貸付有価証券 50,000株
7148	F P G	110,900	1,237.00	137,183,300	

7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	26,800	1,122.00	30,069,600	
7347	マーキュリアホールディングス	11,400	743.00	8,470,200	貸付有価証券 1,500株
8473	SBIホールディングス	474,600	2,759.00	1,309,421,400	
8518	日本アジア投資	16,700	236.00	3,941,200	貸付有価証券 3,700株
8595	ジャフコグループ	109,500	1,776.50	194,526,750	
8601	大和証券グループ本社	2,344,100	721.60	1,691,502,560	貸付有価証券 350,400株
8604	野村ホールディングス	6,037,200	541.00	3,266,125,200	
8609	岡三証券グループ	287,800	461.00	132,675,800	貸付有価証券 37,200株
8613	丸三証券	109,100	433.00	47,240,300	貸付有価証券 22,500株
8614	東洋証券	108,700	314.00	34,131,800	貸付有価証券 15,600株
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	356,800	376.00	134,156,800	
8617	光世証券	4,400	552.00	2,428,800	貸付有価証券 1,500株
8622	水戸証券	88,000	329.00	28,952,000	
8624	いちよし証券	60,400	595.00	35,938,000	貸付有価証券 1,800株
8628	松井証券	193,600	791.00	153,137,600	貸付有価証券 24,800株
8698	マネックスグループ	353,200	543.00	191,787,600	
8706	極東証券	40,800	635.00	25,908,000	貸付有価証券 4,100株
8707	岩井コスモホールディングス	37,400	1,417.00	52,995,800	
8708	アイザワ証券グループ	47,300	797.00	37,698,100	
8732	マネーパートナーズグループ	22,500	267.00	6,007,500	貸付有価証券 4,600株
8739	スパークス・グループ	36,500	1,501.00	54,786,500	
8742	小林洋行	7,500	234.00	1,755,000	
7181	かんぽ生命保険	398,000	2,131.50	848,337,000	
8630	SOMPOホールディングス	562,600	6,465.00	3,637,209,000	
8715	アニコムホールディングス	111,300	636.00	70,786,800	貸付有価証券 14,400株
8725	MS&ADインシュアランスグループホール	667,100	5,109.00	3,408,213,900	貸付有価証券 22,500株
8750	第一生命ホールディングス	1,601,500	2,720.00	4,356,080,000	
8766	東京海上ホールディングス	3,240,300	3,285.00	10,644,385,500	貸付有価証券 98,900株
8795	T&Dホールディングス	879,800	2,088.00	1,837,022,400	貸付有価証券

					135,100株
8798	アドバンスクリエイト	19,000	1,191.00	22,629,000	
7164	全国保証	85,700	5,043.00	432,185,100	貸付有価証券 5,000株
7183	あんしん保証	8,400	301.00	2,528,400	貸付有価証券 1,600株
7187	ジェイリース	7,100	2,111.00	14,988,100	貸付有価証券 1,200株
7191	イントラスト	8,900	950.00	8,455,000	
7192	日本モーゲージサービス	11,700	556.00	6,505,200	貸付有価証券 1,800株
7196	C a s a	7,500	892.00	6,690,000	貸付有価証券 1,600株
7198	アルヒ	40,400	985.00	39,794,000	
7199	プレミアグループ	55,200	1,762.00	97,262,400	貸付有価証券 7,200株
7383	ネットプロテクションズホールディングス	108,500	326.00	35,371,000	
8253	クレディセゾン	207,700	2,110.00	438,247,000	
8424	芙蓉総合リース	30,200	11,050.00	333,710,000	貸付有価証券 3,500株
8425	みずほリース	48,800	4,550.00	222,040,000	
8439	東京センチュリー	61,300	5,151.00	315,756,300	
8511	日本証券金融	120,500	1,090.00	131,345,000	
8515	アイフル	542,900	336.00	182,414,400	貸付有価証券 66,600株
8566	リコーリース	31,100	4,100.00	127,510,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	188,200	1,248.50	234,967,700	
8572	アコム	585,000	346.50	202,702,500	
8584	ジャックス	34,900	4,985.00	173,976,500	
8585	オリエントコーポレーション	85,600	1,124.00	96,214,400	
8591	オリックス	2,151,800	2,548.00	5,482,786,400	
8593	三菱HCキャピタル	1,278,100	839.20	1,072,581,520	
8596	九州リースサービス	9,100	866.00	7,880,600	貸付有価証券 2,200株
8697	日本取引所グループ	921,100	2,573.00	2,369,990,300	貸付有価証券 125,000株
8771	イー・ギャランティ	53,200	1,916.00	101,931,200	
8772	アサックス	11,000	651.00	7,161,000	貸付有価証券 2,200株
8793	NECキャピタルソリューション	16,100	3,105.00	49,990,500	
1878	大東建託	120,100	14,340.00	1,722,234,000	

2337	いちご	377,400	271.00	102,275,400	
2353	日本駐車場開発	346,900	224.00	77,705,600	
2975	スター・マイカ・ホールディングス	29,600	650.00	19,240,000	
2980	S R Eホールディングス	16,100	3,790.00	61,019,000	貸付有価証券 1,000株
2982	A Dワークスグループ	47,400	206.00	9,764,400	貸付有価証券 11,700株
3003	ヒューリック	764,700	1,250.50	956,257,350	
3228	三栄建築設計	15,800	1,366.00	21,582,800	
3231	野村不動産ホールディングス	204,900	3,519.00	721,043,100	貸付有価証券 26,600株
3232	三重交通グループホールディングス	70,100	569.00	39,886,900	
3244	サムティ	52,100	2,214.00	115,349,400	
3245	ディア・ライフ	55,900	775.00	43,322,500	
3246	コーセーアールイー	6,200	775.00	4,805,000	貸付有価証券 1,300株
3252	地主	25,000	1,946.00	48,650,000	貸付有価証券 2,700株
3254	プレサンスコーポレーション	51,700	2,037.00	105,312,900	
3271	T H Eグローバル社	11,300	218.00	2,463,400	貸付有価証券 2,200株
3275	ハウスコム	3,700	932.00	3,448,400	貸付有価証券 600株
3276	J P M C	16,600	1,134.00	18,824,400	
3277	サンセイランディック	5,700	916.00	5,221,200	貸付有価証券 1,600株
3280	エストラスト	2,500	643.00	1,607,500	
3284	フージャースホールディングス	50,500	985.00	49,742,500	
3288	オープンハウスグループ	120,100	5,414.00	650,221,400	貸付有価証券 1,700株
3289	東急不動産ホールディングス	985,600	838.00	825,932,800	貸付有価証券 118,700株
3291	飯田グループホールディングス	287,200	2,370.00	680,664,000	貸付有価証券 36,400株
3294	イーグランド	3,000	1,499.00	4,497,000	貸付有価証券 700株
3299	ムゲンエステート	13,000	715.00	9,295,000	貸付有価証券 3,600株
3452	ビーロッド	13,300	700.00	9,310,000	貸付有価証券 2,000株
3454	ファーストブラザーズ	3,900	926.00	3,611,400	貸付有価証券 1,000株
3457	A n d D oホールディングス	19,500	1,253.00	24,433,500	
3458	シーアールイー	18,200	1,377.00	25,061,400	貸付有価証券 1,100株

3464	プロパティエージェント	2,500	1,161.00	2,902,500	貸付有価証券 700株
3465	ケイアイスター不動産	15,800	4,805.00	75,919,000	貸付有価証券 1,700株
3467	アグレ都市デザイン	3,500	1,547.00	5,414,500	貸付有価証券 700株
3475	グッドコムアセット	30,400	832.00	25,292,800	
3480	ジェイ・エス・ビー	8,100	4,860.00	39,366,000	
3482	ロードスターキャピタル	18,700	1,673.00	31,285,100	貸付有価証券 1,800株
3484	テンポイノベーション	5,900	1,085.00	6,401,500	貸付有価証券 1,000株
3486	グローバル・リンク・マネジメント	3,700	1,435.00	5,309,500	貸付有価証券 700株
3489	フェイスネットワーク	5,400	1,568.00	8,467,200	貸付有価証券 800株
4666	パーク24	255,500	2,042.50	521,858,750	貸付有価証券 11,900株
4809	パラカ	11,500	1,914.00	22,011,000	
6620	宮越ホールディングス	14,900	856.00	12,754,400	貸付有価証券 1,600株
8801	三井不動産	1,416,600	2,901.50	4,110,264,900	貸付有価証券 262,400株
8802	三菱地所	1,978,000	1,739.00	3,439,742,000	
8803	平和不動産	53,200	3,855.00	205,086,000	貸付有価証券 8,000株
8804	東京建物	312,400	1,924.50	601,213,800	
8818	京阪神ビルディング	55,100	1,166.00	64,246,600	貸付有価証券 7,100株
8830	住友不動産	592,600	3,618.00	2,144,026,800	
8841	テーオーシー	59,300	626.00	37,121,800	貸付有価証券 8,700株
8842	東京楽天地	5,400	4,110.00	22,194,000	
8848	レオパレス21	369,000	276.00	101,844,000	貸付有価証券 37,800株
8850	スターツコーポレーション	47,000	2,948.00	138,556,000	
8860	フジ住宅	45,900	676.00	31,028,400	
8864	空港施設	39,600	541.00	21,423,600	貸付有価証券 500株
8869	明和地所	9,900	1,006.00	9,959,400	
8871	ゴールドクレスト	31,200	1,802.00	56,222,400	
8877	エスリード	15,400	2,547.00	39,223,800	
8881	日神グループホールディングス	52,600	513.00	26,983,800	
8892	日本エスコン	73,600	822.00	60,499,200	

8897	M I R A R T Hホールディングス	165,700	441.00	73,073,700	
8904	A V A N T I A	9,900	846.00	8,375,400	
8905	イオンモール	169,900	1,817.50	308,793,250	
8908	毎日コムネット	7,200	741.00	5,335,200	貸付有価証券 1,400株
8917	ファースト住建	7,900	1,097.00	8,666,300	貸付有価証券 2,700株
8918	ランド	1,972,900	10.00	19,729,000	
8919	カチタス	88,100	2,461.00	216,814,100	
8923	トーセイ	54,500	1,794.00	97,773,000	
8928	穴吹興産	4,600	2,295.00	10,557,000	貸付有価証券 400株
8934	サンフロンティア不動産	54,600	1,428.00	77,968,800	貸付有価証券 6,000株
8935	F J ネクストホールディングス	34,500	1,007.00	34,741,500	
8940	インテリックス	4,700	541.00	2,542,700	貸付有価証券 1,300株
8944	ランドビジネス	7,100	258.00	1,831,800	
8945	サンネクスタグループ	6,400	1,022.00	6,540,800	貸付有価証券 600株
8999	グランディハウス	14,400	576.00	8,294,400	貸付有価証券 3,400株
9706	日本空港ビルデング	115,900	6,564.00	760,767,600	
1717	明豊ファシリティワークス	9,300	742.00	6,900,600	貸付有価証券 1,900株
1954	日本工営	20,600	3,755.00	77,353,000	
2120	L I F U L L	117,000	288.00	33,696,000	
2121	M I X I	77,900	2,717.00	211,654,300	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	30,900	2,508.00	77,497,200	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	587,100	1,094.50	642,580,950	
2130	メンバーズ	10,000	1,714.00	17,140,000	貸付有価証券 1,300株
2139	中広	3,300	413.00	1,362,900	
2146	U Tグループ	50,200	2,941.00	147,638,200	
2148	アイティメディア	13,000	1,315.00	17,095,000	貸付有価証券 1,300株
2153	E・Jホールディングス	20,000	1,571.00	31,420,000	
2154	オープンアップグループ	102,600	2,075.00	212,895,000	
2157	コシダカホールディングス	102,400	1,214.00	124,313,600	
2163	アルトナー	4,900	1,707.00	8,364,300	
2168	パソナグループ	41,500	1,662.00	68,973,000	

2169	CDS	5,100	1,825.00	9,307,500	貸付有価証券 1,100株
2170	リンクアンドモチベーション	98,500	423.00	41,665,500	
2175	エス・エム・エス	130,200	2,974.50	387,279,900	
2180	サニーサイドアップグループ	7,100	675.00	4,792,500	貸付有価証券 1,400株
2181	パーソルホールディングス	377,300	2,631.00	992,676,300	貸付有価証券 42,300株
2183	リニカル	11,500	826.00	9,499,000	貸付有価証券 2,100株
2193	クックパッド	93,600	173.00	16,192,800	
2196	エスクリ	9,200	386.00	3,551,200	貸付有価証券 1,800株
2198	アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	601.00	6,010,000	
2301	学情	15,500	1,880.00	29,140,000	
2305	スタジオアリス	17,100	2,185.00	37,363,500	貸付有価証券 3,700株
2309	シミックホールディングス	16,500	1,987.00	32,785,500	貸付有価証券 500株
2311	エプロ	4,300	760.00	3,268,000	貸付有価証券 700株
2325	NJS	7,500	2,665.00	19,987,500	
2331	総合警備保障	127,000	4,035.00	512,445,000	貸付有価証券 16,800株
2371	カカコム	251,100	2,130.00	534,843,000	貸付有価証券 4,900株
2372	アイロムグループ	12,300	1,979.00	24,341,700	貸付有価証券 1,500株
2374	セントケア・ホールディング	21,800	776.00	16,916,800	
2376	サイネックス	3,500	674.00	2,359,000	貸付有価証券 700株
2378	ルネサンス	23,900	886.00	21,175,400	貸付有価証券 1,200株
2379	ディップ	59,900	3,505.00	209,949,500	
2389	デジタルホールディングス	26,700	1,041.00	27,794,700	貸付有価証券 2,300株
2395	新日本科学	36,300	2,124.00	77,101,200	貸付有価証券 4,600株
2410	キャリアデザインセンター	4,200	1,543.00	6,480,600	貸付有価証券 1,100株
2412	ベネフィット・ワン	158,500	1,520.50	240,999,250	貸付有価証券 14,100株
2413	エムスリー	676,100	3,127.00	2,114,164,700	
2418	ツカダ・グローバルホールディング	13,100	474.00	6,209,400	貸付有価証券 2,700株
2424	プラス	2,700	941.00	2,540,700	貸付有価証券

					500株
2427	アウトソーシング	203,800	1,353.50	275,843,300	
2428	ウェルネット	18,100	614.00	11,113,400	
2429	ワールドホールディングス	15,400	2,709.00	41,718,600	
2432	ディー・エヌ・エー	136,800	1,900.00	259,920,000	貸付有価証券 20,900株
2433	博報堂DYホールディングス	436,400	1,528.00	666,819,200	貸付有価証券 58,900株
2440	ぐるなび	62,900	346.00	21,763,400	貸付有価証券 7,300株
2445	タカミヤ	46,400	532.00	24,684,800	貸付有価証券 4,500株
2453	ジャパンベストレスキューシステム	17,000	677.00	11,509,000	
2461	ファンコミュニケーションズ	67,000	396.00	26,532,000	貸付有価証券 3,900株
2462	ライク	12,700	1,687.00	21,424,900	
2464	ビジネス・ブレークスルー	7,600	463.00	3,518,800	貸付有価証券 1,700株
2471	エスプール	98,300	528.00	51,902,400	
2475	WDBホールディングス	17,500	2,110.00	36,925,000	
2485	ティア	11,900	447.00	5,319,300	貸付有価証券 2,500株
2487	CDG	2,200	1,404.00	3,088,800	
2489	アドウェイズ	47,100	675.00	31,792,500	
2491	バリューコマース	25,700	1,397.00	35,902,900	
2492	インフォマート	355,200	312.00	110,822,400	
2749	J Pホールディングス	98,400	340.00	33,456,000	貸付有価証券 13,200株
3521	エコナックホールディングス	35,300	95.00	3,353,500	貸付有価証券 7,600株
4286	CLホールディングス	9,400	912.00	8,572,800	貸付有価証券 400株
4290	プレステージ・インターナショナル	144,000	603.00	86,832,000	貸付有価証券 15,800株
4301	アミューズ	18,500	1,780.00	32,930,000	
4310	ドリームインキュベータ	10,400	2,823.00	29,359,200	
4318	クイック	26,100	2,176.00	56,793,600	
4319	TAC	11,100	200.00	2,220,000	貸付有価証券 2,500株
4324	電通グループ	336,300	4,726.00	1,589,353,800	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	8,800	1,148.00	10,102,400	貸付有価証券 1,600株
4337	ぴあ	11,500	3,350.00	38,525,000	貸付有価証券 1,200株

4343	イオンファンタジー	14,800	3,245.00	48,026,000	貸付有価証券 1,200株
4345	シーティーエス	37,800	736.00	27,820,800	貸付有価証券 2,400株
4346	ネクシィーズグループ	6,300	649.00	4,088,700	貸付有価証券 1,500株
4544	H. U. グループホールディングス	100,200	2,732.00	273,746,400	
4641	アルプス技研	29,800	3,065.00	91,337,000	
4651	サニックス	54,800	345.00	18,906,000	貸付有価証券 7,400株
4658	日本空調サービス	36,700	749.00	27,488,300	
4661	オリエンタルランド	1,810,700	5,343.00	9,674,570,100	貸付有価証券 307,000株
4665	ダスキン	76,200	3,218.00	245,211,600	貸付有価証券 10,900株
4668	明光ネットワークジャパン	41,500	640.00	26,560,000	貸付有価証券 2,600株
4671	ファルコホールディングス	15,400	1,838.00	28,305,200	貸付有価証券 1,800株
4678	秀英予備校	4,500	409.00	1,840,500	
4679	田谷	3,700	475.00	1,757,500	
4680	ラウンドワン	286,100	573.00	163,935,300	
4681	リゾートトラスト	135,100	2,144.00	289,654,400	
4694	ビー・エム・エル	42,400	2,963.00	125,631,200	
4708	りらいあコミュニケーションズ	56,500	1,463.00	82,659,500	
4714	リソー教育	155,500	266.00	41,363,000	貸付有価証券 19,400株
4718	早稲田アカデミー	18,900	1,331.00	25,155,900	
4732	ユー・エス・エス	351,900	2,412.00	848,782,800	
4745	東京個別指導学院	40,500	517.00	20,938,500	貸付有価証券 2,800株
4751	サイバーエージェント	755,900	1,114.50	842,450,550	貸付有価証券 117,100株
4755	楽天グループ	2,052,300	477.10	979,152,330	貸付有価証券 303,600株
4763	クリーク・アンド・リバー社	20,000	1,949.00	38,980,000	貸付有価証券 2,200株
4765	SBIグローバルアセットマネジメン ト	55,800	505.00	28,179,000	
4767	テー・オー・ダブリュー	67,000	323.00	21,641,000	
4792	山田コンサルティンググループ	17,300	1,617.00	27,974,100	
4801	セントラルスポーツ	12,800	2,383.00	30,502,400	
4848	フルキャストホールディングス	32,700	2,266.00	74,098,200	
4849	エン・ジャパン	61,900	2,465.00	152,583,500	貸付有価証券

					7,400株
5261	リゾルホールディングス	2,200	4,735.00	10,417,000	貸付有価証券 300株
6028	テクノプロ・ホールディングス	202,400	3,146.00	636,750,400	
6029	アトラグループ	4,600	182.00	837,200	貸付有価証券 1,000株
6032	インターワークス	5,900	340.00	2,006,000	貸付有価証券 800株
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	17,800	1,617.00	28,782,600	
6036	K e e P e r 技研	21,100	4,795.00	101,174,500	
6037	ファーストロジック	3,000	1,002.00	3,006,000	貸付有価証券 1,000株
6044	三機サービス	3,500	1,178.00	4,123,000	貸付有価証券 900株
6047	G u n o s y	27,200	605.00	16,456,000	貸付有価証券 1,800株
6048	デザインワン・ジャパン	6,100	178.00	1,085,800	貸付有価証券 800株
6050	イー・ガーディアン	13,000	1,998.00	25,974,000	貸付有価証券 2,200株
6054	リブセンス	9,400	295.00	2,773,000	貸付有価証券 2,700株
6055	ジャパンマテリアル	104,700	2,283.00	239,030,100	貸付有価証券 12,900株
6058	ベクトル	53,700	1,324.00	71,098,800	貸付有価証券 3,300株
6059	ウチヤマホールディングス	10,100	328.00	3,312,800	貸付有価証券 2,100株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	28,500	1,298.00	36,993,000	
6070	キャリアリンク	12,500	3,040.00	38,000,000	
6071	I B J	20,900	679.00	14,191,100	
6073	アサンテ	16,900	1,669.00	28,206,100	
6078	バリューHR	29,900	1,361.00	40,693,900	
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	27,600	3,335.00	92,046,000	
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	12,200	1,051.00	12,822,200	
6083	E R Iホールディングス	5,700	1,378.00	7,854,600	
6087	アビスト	3,200	3,225.00	10,320,000	貸付有価証券 600株
6088	シグマクシス・ホールディングス	51,900	1,264.00	65,601,600	貸付有価証券 3,800株
6089	ウィルグループ	28,600	1,081.00	30,916,600	貸付有価証券 2,800株
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	21,300	147.00	3,131,100	

6095	メドピア	30,100	1,016.00	30,581,600	
6096	レアジョブ	3,900	1,074.00	4,188,600	貸付有価証券 900株
6098	リクルートホールディングス	2,533,200	4,530.00	11,475,396,000	
6099	エラン	45,300	855.00	38,731,500	
6171	土木管理総合試験所	8,500	345.00	2,932,500	貸付有価証券 1,900株
6178	日本郵政	4,117,000	1,032.00	4,248,744,000	
6183	バルシステム24ホールディングス	45,900	1,356.00	62,240,400	貸付有価証券 4,100株
6184	鎌倉新書	38,900	739.00	28,747,100	貸付有価証券 5,200株
6185	SMN	4,700	449.00	2,110,300	貸付有価証券 700株
6186	一蔵	2,600	585.00	1,521,000	貸付有価証券 500株
6189	グローバルキッズCOMPANY	3,100	690.00	2,139,000	貸付有価証券 600株
6191	エアトリ	24,900	2,795.00	69,595,500	
6194	アトラエ	20,200	731.00	14,766,200	
6196	ストライク	14,500	3,460.00	50,170,000	貸付有価証券 1,600株
6197	ソラスト	94,300	654.00	61,672,200	
6199	セラク	10,400	1,599.00	16,629,600	
6200	インソース	74,300	1,192.00	88,565,600	
6532	ベйкаレント・コンサルティング	270,800	5,388.00	1,459,070,400	
6533	Orchestra Holdings	7,300	1,263.00	9,219,900	
6535	アイモバイル	15,200	1,165.00	17,708,000	
6538	キャリアインデックス	7,000	298.00	2,086,000	貸付有価証券 1,700株
6539	MS-Japan	8,300	1,047.00	8,690,100	貸付有価証券 1,400株
6540	船場	3,500	742.00	2,597,000	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グ	121,900	1,824.00	222,345,600	
6546	フルテック	2,900	1,121.00	3,250,900	
6547	グリーンズ	7,700	1,333.00	10,264,100	貸付有価証券 1,600株
6551	ツナググループ・ホールディングス	5,700	673.00	3,836,100	
6552	GameWith	6,100	363.00	2,214,300	貸付有価証券 900株
6555	MS&Consulting	3,000	616.00	1,848,000	貸付有価証券 500株

6556	ウェルビー	25,100	460.00	11,546,000	貸付有価証券 2,400株
6560	エル・ティー・エス	4,400	3,505.00	15,422,000	
6564	ミダックホールディングス	20,700	1,546.00	32,002,200	
6569	日総工産	25,700	909.00	23,361,300	貸付有価証券 2,000株
6571	キュービーネットホールディングス	16,200	1,464.00	23,716,800	
6572	R P Aホールディングス	46,300	424.00	19,631,200	
7030	スプリックス	7,000	785.00	5,495,000	貸付有価証券 2,000株
7033	マネジメントソリューションズ	18,800	4,100.00	77,080,000	
7034	プロレド・パートナーズ	8,400	526.00	4,418,400	
7035	a n d f a c t o r y	5,900	411.00	2,424,900	貸付有価証券 1,000株
7037	テノ.ホールディングス	2,500	663.00	1,657,500	貸付有価証券 600株
7038	フロンティア・マネジメント	11,400	1,235.00	14,079,000	貸付有価証券 1,200株
7044	ピアラ	3,300	508.00	1,676,400	貸付有価証券 700株
7059	コプロ・ホールディングス	4,000	2,206.00	8,824,000	貸付有価証券 600株
7060	ギークス	3,500	765.00	2,677,500	貸付有価証券 800株
7071	アンビスホールディングス	36,600	3,165.00	115,839,000	
7085	カーブスホールディングス	93,500	749.00	70,031,500	貸付有価証券 900株
7088	フォーラムエンジニアリング	19,900	1,182.00	23,521,800	貸付有価証券 2,200株
7092	F a s t F i t n e s s J a p a n	11,700	1,309.00	15,315,300	
7354	ダイレクトマーケティングミックス	41,000	869.00	35,629,000	貸付有価証券 4,800株
7358	ポピンズ	5,100	1,591.00	8,114,100	
7366	L I T A L I C O	26,600	2,302.00	61,233,200	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	10,300	603.00	6,210,900	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	190,500	1,952.00	371,856,000	貸付有価証券 23,100株
8920	東祥	23,800	1,215.00	28,917,000	貸付有価証券 2,700株
9216	ビーウィズ	8,600	2,267.00	19,496,200	
9247	T R Eホールディングス	72,000	1,200.00	86,400,000	
9248	人・夢・技術グループ	12,900	1,478.00	19,066,200	
9336	大栄環境	87,000	2,572.00	223,764,000	

9347	日本管財ホールディングス	35,900	2,587.00	92,873,300	
9603	エイチ・アイ・エス	89,500	2,026.00	181,327,000	
9612	ラックランド	14,200	3,460.00	49,132,000	
9616	共立メンテナンス	58,600	5,495.00	322,007,000	貸付有価証券 4,100株
9619	イチネンホールディングス	36,200	1,331.00	48,182,200	
9621	建設技術研究所	17,600	3,550.00	62,480,000	貸付有価証券 2,600株
9622	スペース	24,800	1,032.00	25,593,600	
9628	燦ホールディングス	14,600	2,097.00	30,616,200	
9632	スバル興業	1,300	9,720.00	12,636,000	
9633	東京テアトル	7,500	1,130.00	8,475,000	貸付有価証券 1,600株
9644	タナベコンサルティンググループ	7,900	904.00	7,141,600	
9663	ナガワ	9,200	6,890.00	63,388,000	貸付有価証券 1,300株
9672	東京都競馬	28,600	3,905.00	111,683,000	
9675	常磐興産	7,100	1,225.00	8,697,500	貸付有価証券 1,700株
9678	カナモト	62,700	2,198.00	137,814,600	貸付有価証券 6,900株
9699	ニシオホールディングス	31,800	3,325.00	105,735,000	
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	112,700	25.00	2,817,500	貸付有価証券 27,100株
9715	トランス・コスモス	42,500	3,525.00	149,812,500	貸付有価証券 1,700株
9716	乃村工藝社	149,200	972.00	145,022,400	
9722	藤田観光	15,200	3,435.00	52,212,000	貸付有価証券 900株
9726	KNT-CTホールディングス	20,400	1,428.00	29,131,200	貸付有価証券 2,600株
9729	トーカイ	30,300	1,835.00	55,600,500	貸付有価証券 4,100株
9731	白洋舎	1,900	2,852.00	5,418,800	貸付有価証券 500株
9735	セコム	348,500	9,712.00	3,384,632,000	貸付有価証券 44,900株
9740	セントラル警備保障	18,400	2,870.00	52,808,000	貸付有価証券 2,100株
9743	丹青社	66,300	776.00	51,448,800	
9744	メイテック	133,500	2,423.00	323,470,500	貸付有価証券 9,000株
9755	応用地質	31,900	2,036.00	64,948,400	
9757	船井総研ホールディングス	71,200	2,508.00	178,569,600	

9760	進学会ホールディングス	6,700	292.00	1,956,400	
9765	オオバ	12,800	778.00	9,958,400	貸付有価証券 3,300株
9768	いであ	4,500	1,683.00	7,573,500	貸付有価証券 800株
9769	学究社	13,700	2,097.00	28,728,900	
9783	ベネッセホールディングス	127,700	1,825.00	233,052,500	
9787	イオンディライト	37,800	3,050.00	115,290,000	
9788	ナック	15,100	962.00	14,526,200	
9793	ダイセキ	69,800	3,990.00	278,502,000	
9795	ステップ	12,400	1,794.00	22,245,600	
合 計		392,789,300		1,075,163,359,280	

(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)

[2023年6月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	54,589,557,147
コール・ローン	2,069,494,655
株式	2,625,881,399,370
投資証券	53,108,109,750
派生商品評価勘定	16,933,446
未収入金	25,310,427
未収配当金	2,921,163,483
差入委託証拠金	48,833,297,713
流動資産合計	2,787,445,265,991
資産合計	2,787,445,265,991
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	711,007,647
未払解約金	1,832,138,676
未払利息	5,201
流動負債合計	2,543,151,524

負債合計	2,543,151,524
純資産の部	
元本等	
元本	513,699,458,357
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,271,202,656,110
元本等合計	2,784,902,114,467
純資産合計	2,784,902,114,467
負債純資産合計	2,787,445,265,991

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)

	[2023年6月26日現在]
1. 期首	2022年6月28日
期首元本額	357,084,936,417円
期中追加設定元本額	243,309,943,163円
期中一部解約元本額	86,695,421,223円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	211,444,667円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	978,532,740円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	887,649,261円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,952,434,413円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	3,933,814,037円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,631,191,199円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	9,559,960,211円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,383,564,848円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	50,881,214円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	134,361,748円
ファンド・マネジャー(海外株式)	780,227円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,622,180,308円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,103,875,175円
eMAXIS バランス(波乗り型)	64,918,726円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,773,644,299円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	216,053,789円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	266,984,449円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	246,221,961円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス 海外株式セレクション (ラップ向け)	90,745,972,847円 2,638,277,146円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	4,839,185,694円
つみたて先進国株式	25,121,859,088円
つみたて8資産均等バランス	2,314,820,675円
つみたて4資産均等バランス	786,065,784円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,863,912円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,186,183円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,245,918円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	185,992,614円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	207,074,585円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	135,909,554円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	58,644,907円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	482,817,482円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,186,533,996円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	45,089,316,498円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	495,577,491円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	3,729,376,227円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	187,968,197,682円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	122,686,055円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	43,501,720円
つみたて全世界株式	243,935,161円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	51,514,851円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,366,909,917円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	20,451,896円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	4,165,374,904円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	45,353,986円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	29,878,516,345円
eMAXIS 全世界株式インデックス	4,742,993,306円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	521,192,661円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,004,727,709円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	238,493,975円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	544,642,972円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	220,394,941円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	327,526,945円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	84,385,707円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	113,771,878円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	458,978,049円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	368,326,422円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	697,461,533円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,510,003,896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)	13,678円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	5,404,105円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,714,074,709円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限	43,761,271円

定)	
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	744, 776, 967 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)	9, 942, 007, 162 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	70, 276 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	589, 734, 609 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)	5, 180, 411, 998 円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	11, 373, 564 円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	68, 797, 438 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, 512, 887, 530 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)	469, 899, 565 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)	312, 483, 824 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	53, 500, 956 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, 832, 116, 112 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)	75, 763, 745 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, 386, 887, 414 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)	203, 552, 549 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, 431, 155, 095 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)	40, 626, 164 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)	120, 855 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, 613, 987, 832 円
海外株式インデックスファンドS	3, 071, 905, 584 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)	1, 297, 972 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2, 688, 602, 205 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	770, 789 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, 091, 495 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	627, 809 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1, 973, 858 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	23, 404, 937 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	853, 128 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	8, 778, 629 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	920, 193 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	12, 281, 181 円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6, 543, 007, 603 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)	92, 048, 758 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)	394, 219, 553 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)	419, 254, 105 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)	418, 456, 756 円
合計	513, 699, 458, 357 円
2. 受益権の総数	513, 699, 458, 357 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 2022年 6月 28日 至 2023年 6月 26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	[2023年 6月 26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	[2023年 6月 26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	82,161,686,799
投資証券	△2,272,383,360
合計	79,889,303,439

(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

[2023年6月26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	108,878,687,963	—	108,184,216,614	△694,471,349
合計		108,878,687,963	—	108,184,216,614	△694,471,349

(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はありません。

通貨関連

[2023年6月26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	1,998,445,787	—	1,998,951,250	505,463
	カナダドル	96,397,297	—	96,394,200	△3,097
	オーストラリアドル	101,257,530	—	101,014,167	△243,363
	イギリスポンド	85,110,706	—	85,108,702	△2,004
	スイスフラン	96,361,164	—	96,400,922	39,758
	香港ドル	17,197,785	—	17,198,066	281
	シンガポールドル	17,517,555	—	17,517,060	△495
	スウェーデンクローネ	23,177,675	—	23,177,329	△346
	デンマーククローネ	19,830,608	—	19,829,664	△944
	ユーロ	230,765,225	—	230,759,767	△5,458
	売建				
	ユーロ	48,611,100	—	48,503,747	107,353
合計		2,734,672,432	—	2,734,854,874	397,148

(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)

	[2023年6月26日現在]
1口当たり純資産額	5,4213円
(1万口当たり純資産額)	(54,213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	115,689	32.58	3,769,147.62	
	BAKER HUGHES CO	363,477	29.77	10,820,710.29	
	CHENIERE ENERGY INC	85,699	148.56	12,731,443.44	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,592	80.59	3,593,669.28	
	CHEVRON CORP	644,907	151.35	97,606,674.45	
	CONOCOPHILLIPS	434,366	100.46	43,636,408.36	
	COTERRA ENERGY INC	274,210	23.72	6,504,261.20	
	DEVON ENERGY CORP	230,471	47.15	10,866,707.65	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	61,070	125.40	7,658,178.00	
	EOG RESOURCES INC	211,328	106.82	22,574,056.96	
	EQT CORP	131,720	39.18	5,160,789.60	
	EXXON MOBIL CORP	1,454,345	102.40	148,924,928.00	
	HALLIBURTON CO	321,798	30.89	9,940,340.22	
	HESS CORP	99,334	131.61	13,073,347.74	
	HF SINCLAIR CORP	59,686	42.50	2,536,655.00	
	KINDER MORGAN INC	722,362	16.32	11,788,947.84	
	MARATHON OIL CORP	217,347	21.95	4,770,766.65	
	MARATHON PETROLEUM CORP	160,298	111.64	17,895,668.72	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	258,261	56.07	14,480,694.27	

ONEOK INC	162,313	57.69	9,363,836.97
OVINTIV INC	82,940	34.97	2,900,411.80
PHILLIPS 66	167,010	90.86	15,174,528.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	84,951	198.66	16,876,365.66
SCHLUMBERGER LTD	509,318	46.59	23,729,125.62
TARGA RESOURCES CORP	76,008	69.92	5,314,479.36
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,158	1,282.66	2,767,980.28
VALERO ENERGY CORP	129,312	111.30	14,392,425.60
WILLIAMS COS INC	436,341	30.59	13,347,671.19
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	79,744	286.26	22,827,517.44
ALBEMARLE CORP	42,904	220.18	9,446,602.72
ALCOA CORP	65,943	32.84	2,165,568.12
AMCOR PLC	523,563	9.87	5,167,566.81
AVERY DENNISON CORP	27,835	167.85	4,672,104.75
BALL CORP	110,807	55.81	6,184,138.67
CELANESE CORP	35,523	109.46	3,888,347.58
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	69,306	70.56	4,890,231.36
CLEVELAND-CLIFFS INC	171,019	15.83	2,707,230.77
CORTEVA INC	253,670	57.23	14,517,534.10
CROWN HOLDINGS INC	43,629	85.74	3,740,750.46
DOW INC	251,154	51.36	12,899,269.44
DUPONT DE NEMOURS INC	161,201	67.78	10,926,203.78
EASTMAN CHEMICAL CO	40,284	78.55	3,164,308.20
ECOLAB INC	90,750	178.15	16,167,112.50
FMC CORP	43,553	105.73	4,604,858.69
FREEMONT-MCMORAN INC	503,689	38.37	19,326,546.93
INTERNATIONAL PAPER CO	111,608	30.60	3,415,204.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	91,686	75.28	6,902,122.08
LINDE PLC	175,628	370.59	65,085,980.52
LYONDELLBASELL INDU-CL A	96,083	88.33	8,487,011.39
MARTIN MARIETTA MATERIALS	21,677	442.38	9,589,471.26
MOSAIC CO/THE	113,000	34.21	3,865,730.00
NEWMONT CORP	284,516	41.58	11,830,175.28
NUCOR CORP	92,207	153.79	14,180,514.53
PACKAGING CORP OF AMERICA	30,858	128.82	3,975,127.56
PPG INDUSTRIES INC	84,081	138.89	11,678,010.09

RELIANCE STEEL & ALUMINUM	21,500	258.26	5,552,590.00
RPM INTERNATIONAL INC	45,708	82.17	3,755,826.36
SEALED AIR CORP	49,467	38.06	1,882,714.02
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	88,653	247.04	21,900,837.12
STEEL DYNAMICS INC	60,768	102.68	6,239,658.24
VULCAN MATERIALS CO	48,952	214.43	10,496,777.36
WESTLAKE CORP	13,051	112.80	1,472,152.80
WESTROCK CO	100,519	27.23	2,737,132.37
3M CO	199,587	100.72	20,102,402.64
AECOM	50,248	84.99	4,270,577.52
AERCAP HOLDINGS NV	56,854	60.60	3,445,352.40
ALLEGION PLC	31,093	115.50	3,591,241.50
AMETEK INC	83,048	156.06	12,960,470.88
AXON ENTERPRISE INC	24,900	188.71	4,698,879.00
BOEING CO/THE	203,893	205.41	41,881,661.13
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	48,400	127.52	6,171,968.00
CARLISLE COS INC	19,189	241.66	4,637,213.74
CARRIER GLOBAL CORP	299,382	48.05	14,385,305.10
CATERPILLAR INC	185,039	234.44	43,380,543.16
CUMMINS INC	50,613	232.02	11,743,228.26
DEERE & CO	100,862	404.45	40,793,635.90
DOVER CORP	49,146	141.13	6,935,974.98
EATON CORP PLC	142,339	194.46	27,679,241.94
EMERSON ELECTRIC CO	207,149	86.68	17,955,675.32
FASTENAL CO	206,429	56.89	11,743,745.81
FERGUSON PLC	75,182	150.62	11,323,912.84
FORTIVE CORP	124,354	71.03	8,832,864.62
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	47,372	67.57	3,200,926.04
GENERAC HOLDINGS INC	21,013	129.07	2,712,147.91
GENERAL DYNAMICS CORP	84,811	212.39	18,013,008.29
GENERAL ELECTRIC CO	390,203	103.78	40,495,267.34
GRACO INC	63,107	83.55	5,272,589.85
HEICO CORP	15,479	173.74	2,689,321.46
HEICO CORP-CLASS A	28,213	139.26	3,928,942.38
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	238,513	200.09	47,724,066.17
HOWMET AEROSPACE INC	137,808	46.35	6,387,400.80

HUBBELL INC	18,346	317.07	5,816,966.22
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	13,307	216.96	2,887,086.72
IDEX CORP	27,872	203.04	5,659,130.88
ILLINOIS TOOL WORKS	109,645	242.25	26,561,501.25
INGERSOLL-RAND INC	149,438	63.37	9,469,886.06
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	52,400	50.45	2,643,580.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	243,745	64.99	15,840,987.55
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	68,494	191.90	13,143,998.60
LENNOX INTERNATIONAL INC	11,485	311.71	3,579,989.35
LOCKHEED MARTIN CORP	81,683	459.36	37,521,902.88
MASCO CORP	84,835	55.26	4,687,982.10
NORDSON CORP	17,492	235.74	4,123,564.08
NORTHROP GRUMMAN CORP	51,113	454.05	23,207,857.65
OTIS WORLDWIDE CORP	149,651	86.37	12,925,356.87
OWENS CORNING	34,823	124.06	4,320,141.38
PACCAR INC	186,598	78.44	14,636,747.12
PARKER HANNIFIN CORP	45,567	370.12	16,865,258.04
PENTAIR PLC	62,808	60.12	3,776,016.96
QUANTA SERVICES INC	51,971	186.61	9,698,308.31
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	523,979	96.91	50,778,804.89
ROCKWELL AUTOMATION INC	41,132	313.27	12,885,421.64
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	60,064	43.12	2,589,959.68
SMITH (A. O.) CORP	41,076	69.49	2,854,371.24
SNAP-ON INC	18,428	273.62	5,042,269.36
STANLEY BLACK & DECKER INC	56,055	87.81	4,922,189.55
TEXTRON INC	76,878	64.91	4,990,150.98
TORO CO	34,600	97.41	3,370,386.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	81,860	186.16	15,239,057.60
TRANSDIGM GROUP INC	19,761	850.26	16,801,987.86
UNITED RENTALS INC	24,930	404.38	10,081,193.40
WABTEC CORP	63,893	102.32	6,537,531.76
WATSCO INC	11,800	365.27	4,310,186.00
WW GRAINGER INC	16,351	737.90	12,065,402.90
XYLEM INC	83,624	111.03	9,284,772.72
AUTOMATIC DATA PROCESSING	148,407	213.83	31,733,868.81
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	46,380	107.44	4,983,067.20

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	43,509	158.01	6,874,857.09
CERIDIAN HCM HOLDING INC	54,780	63.46	3,476,338.80
CINTAS CORP	32,315	482.59	15,594,895.85
CLARIVATE PLC	115,796	8.80	1,019,004.80
COPART INC	152,925	89.19	13,639,380.75
COSTAR GROUP INC	146,649	86.75	12,721,800.75
EQUIFAX INC	44,323	224.03	9,929,681.69
JACOBS SOLUTIONS INC	47,103	114.50	5,393,293.50
LEIDOS HOLDINGS INC	49,801	84.72	4,219,140.72
PAYCHEX INC	116,279	108.38	12,602,318.02
PAYCOM SOFTWARE INC	19,097	306.20	5,847,501.40
PAYLOCITY HOLDING CORP	13,942	176.75	2,464,248.50
REPUBLIC SERVICES INC	79,804	146.53	11,693,680.12
ROBERT HALF INTL INC	38,389	70.53	2,707,576.17
ROLLINS INC	92,741	41.39	3,838,549.99
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	80,381	58.49	4,701,484.69
TRANSUNION	70,635	74.22	5,242,529.70
VERISK ANALYTICS INC	50,689	224.35	11,372,077.15
WASTE CONNECTIONS INC	91,490	136.10	12,451,789.00
WASTE MANAGEMENT INC	147,134	165.59	24,363,919.06
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	40,475	90.45	3,660,963.75
CSX CORP	737,513	32.74	24,146,175.62
DELTA AIR LINES INC	53,589	42.86	2,296,824.54
EXPEDITORS INTL WASH INC	53,436	114.45	6,115,750.20
FEDEX CORP	86,494	232.34	20,096,015.96
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	661,326	3.20	2,116,243.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	28,551	175.18	5,001,564.18
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	58,606	54.00	3,164,724.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	81,885	218.00	17,850,930.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	35,010	326.63	11,435,316.30
SOUTHWEST AIRLINES CO	50,383	33.93	1,709,495.19
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	36,932	46.74	1,726,201.68
UBER TECHNOLOGIES INC	650,488	43.34	28,192,149.92
UNION PACIFIC CORP	219,037	199.89	43,783,305.93
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	259,561	169.29	43,941,081.69
APTIV PLC	99,071	97.40	9,649,515.40

BORGWARNER INC	78,768	45.23	3,562,676.64
FORD MOTOR CO	1,394,215	14.02	19,546,894.30
GENERAL MOTORS CO	501,280	36.18	18,136,310.40
LEAR CORP	20,206	136.39	2,755,896.34
LUCID GROUP INC	324,874	5.47	1,777,060.78
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	227,100	13.53	3,072,663.00
TESLA INC	1,021,909	256.60	262,221,849.40
DECKERS OUTDOOR CORP	9,300	506.12	4,706,916.00
DR HORTON INC	108,467	120.40	13,059,426.80
GARMIN LTD	53,987	101.56	5,482,919.72
HASBRO INC	51,810	60.00	3,108,600.00
LENNAR CORP-A	90,104	122.30	11,019,719.20
LULULEMON ATHLETICA INC	41,156	374.25	15,402,633.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	22,320	97.82	2,183,342.40
NIKE INC -CL B	441,660	109.52	48,370,603.20
NVR INC	1,154	6,160.21	7,108,882.34
PULTEGROUP INC	84,307	76.27	6,430,094.89
VF CORP	121,637	18.23	2,217,442.51
WHIRLPOOL CORP	20,470	140.59	2,877,877.30
AIRBNB INC-CLASS A	149,871	124.73	18,693,409.83
ARAMARK	78,822	39.29	3,096,916.38
BOOKING HOLDINGS INC	13,464	2,623.93	35,328,593.52
CAESARS ENTERTAINMENT INC	70,724	45.21	3,197,432.04
CARNIVAL CORP	370,350	15.80	5,851,530.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	9,986	2,043.68	20,408,188.48
DARDEN RESTAURANTS INC	41,711	161.30	6,727,984.30
DOMINO'S PIZZA INC	12,458	316.82	3,946,943.56
DOORDASH INC - A	87,546	72.64	6,359,341.44
EXPEDIA GROUP INC	53,423	104.79	5,598,196.17
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	92,759	137.11	12,718,186.49
HYATT HOTELS CORP - CL A	16,700	107.54	1,795,918.00
LAS VEGAS SANDS CORP	127,829	57.28	7,322,045.12
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	94,730	171.45	16,241,458.50
MCDONALD'S CORP	261,439	289.91	75,793,780.49
MGM RESORTS INTERNATIONAL	104,054	41.38	4,305,754.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	79,355	97.92	7,770,441.60

STARBUCKS CORP	411,366	98.34	40,453,732.44
VAIL RESORTS INC	13,389	243.63	3,261,962.07
WYNN RESORTS LTD	38,455	104.20	4,007,011.00
YUM! BRANDS INC	99,990	135.60	13,558,644.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	268,167	81.90	21,962,877.30
ALPHABET INC-CL A	2,131,346	122.34	260,748,869.64
ALPHABET INC-CL C	1,926,910	123.02	237,048,468.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	34,877	326.28	11,379,667.56
COMCAST CORP-CLASS A	1,506,525	40.09	60,396,587.25
ELECTRONIC ARTS INC	99,184	125.25	12,422,796.00
FOX CORP - CLASS A	99,915	32.67	3,264,223.05
FOX CORP - CLASS B	50,847	30.63	1,557,443.61
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	142,963	38.48	5,501,216.24
LIBERTY BROADBAND-C	43,606	70.76	3,085,560.56
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	50,965	29.72	1,514,679.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	72,629	75.56	5,487,847.24
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	57,466	87.76	5,043,216.16
MATCH GROUP INC	95,483	41.24	3,937,718.92
META PLATFORMS INC-CLASS A	793,481	288.73	229,101,769.13
NETFLIX INC	159,524	424.02	67,641,366.48
NEWS CORP - CLASS A	130,626	18.76	2,450,543.76
OMNICOM GROUP	69,272	93.18	6,454,764.96
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	177,253	15.36	2,722,606.08
PINTEREST INC- CLASS A	222,288	26.24	5,832,837.12
ROBLOX CORP -CLASS A	147,825	37.85	5,595,176.25
ROKU INC	48,057	62.57	3,006,926.49
SEA LTD-ADR	134,213	58.91	7,906,487.83
SIRIUS XM HOLDINGS INC	234,669	3.83	898,782.27
SNAP INC - A	350,310	10.82	3,790,354.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	60,511	141.85	8,583,485.35
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	159,875	76.24	12,188,870.00
WALT DISNEY CO/THE	654,030	88.10	57,620,043.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	841,804	11.79	9,924,869.16
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	110,986	23.99	2,662,554.14
ADVANCE AUTO PARTS INC	19,129	65.67	1,256,201.43
AMAZON.COM INC	3,308,197	129.33	427,849,118.01

AUTOZONE INC	6,474	2,423.73	15,691,228.02
BATH & BODY WORKS INC	83,543	37.21	3,108,635.03
BEST BUY CO INC	70,326	79.13	5,564,896.38
BURLINGTON STORES INC	24,572	157.98	3,881,884.56
CARMAX INC	59,580	86.21	5,136,391.80
CHEWY INC - CLASS A	31,027	39.25	1,217,809.75
DICK'S SPORTING GOODS INC	22,300	134.57	3,000,911.00
EBAY INC	195,518	43.37	8,479,615.66
ETSY INC	47,624	88.93	4,235,202.32
GENUINE PARTS CO	51,814	159.67	8,273,141.38
HOME DEPOT INC	362,727	300.81	109,111,908.87
LKQ CORP	100,144	54.42	5,449,836.48
LOWE'S COS INC	213,460	215.22	45,940,861.20
MERCADOLIBRE INC	16,296	1,226.49	19,986,881.04
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21,999	924.76	20,343,795.24
POOL CORP	14,653	352.34	5,162,838.02
ROSS STORES INC	120,008	108.66	13,040,069.28
TJX COMPANIES INC	414,067	82.06	33,978,338.02
TRACTOR SUPPLY COMPANY	39,195	218.70	8,571,946.50
ULTA BEAUTY INC	17,726	453.45	8,037,854.70
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	101,400	21.46	2,176,044.00
COSTCO WHOLESALE CORP	158,876	524.44	83,320,929.44
DOLLAR GENERAL CORP	76,806	171.15	13,145,346.90
DOLLAR TREE INC	79,492	143.67	11,420,615.64
KROGER CO	246,544	46.14	11,375,540.16
SYSCO CORP	180,836	72.45	13,101,568.20
TARGET CORP	165,672	131.83	21,840,539.76
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	255,139	31.40	8,011,364.60
WALMART INC	531,371	155.46	82,606,935.66
ALTRIA GROUP INC	640,483	43.42	27,809,771.86
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	195,276	72.90	14,235,620.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	113,860	65.04	7,405,454.40
BUNGE LTD	51,318	94.04	4,825,944.72
CAMPBELL SOUP CO	69,241	45.59	3,156,697.19
COCA-COLA CO/THE	1,473,183	61.20	90,158,799.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	75,211	65.04	4,891,723.44

CONAGRA BRANDS INC	178,677	34.09	6,091,098.93
CONSTELLATION BRANDS INC-A	59,373	242.38	14,390,827.74
DARLING INGREDIENTS INC	61,326	58.84	3,608,421.84
GENERAL MILLS INC	208,647	81.32	16,967,174.04
HERSHEY CO/THE	52,460	259.09	13,591,861.40
HORMEL FOODS CORP	104,570	40.47	4,231,947.90
JM SMUCKER CO/THE	37,304	150.32	5,607,537.28
KELLOGG CO	94,905	65.16	6,184,009.80
KEURIG DR PEPPER INC	321,012	31.18	10,009,154.16
KRAFT HEINZ CO/THE	280,103	35.91	10,058,498.73
LAMB WESTON HOLDINGS INC	52,797	114.69	6,055,287.93
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	91,298	93.79	8,562,839.42
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	71,471	66.18	4,729,950.78
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	488,320	73.10	35,696,192.00
MONSTER BEVERAGE CORP	285,792	59.11	16,893,165.12
PEPSICO INC	493,721	186.07	91,866,666.47
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	556,325	96.30	53,574,097.50
TYSON FOODS INC-CL A	99,095	49.50	4,905,202.50
CHURCH & DWIGHT CO INC	88,299	97.12	8,575,598.88
CLOROX COMPANY	44,784	156.14	6,992,573.76
COLGATE-PALMOLIVE CO	284,459	77.11	21,934,633.49
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	81,772	191.94	15,695,317.68
KIMBERLY-CLARK CORP	119,148	136.97	16,319,701.56
PROCTER & GAMBLE CO/THE	845,518	148.46	125,525,602.28
ABBOTT LABORATORIES	622,122	108.05	67,220,282.10
ALIGN TECHNOLOGY INC	25,443	328.83	8,366,421.69
AMERISOURCEBERGEN CORP	60,505	187.67	11,354,973.35
BAXTER INTERNATIONAL INC	187,314	45.04	8,436,622.56
BECTON DICKINSON AND CO	101,388	256.55	26,011,091.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	509,193	53.97	27,481,146.21
CARDINAL HEALTH INC	89,557	91.72	8,214,168.04
CENTENE CORP	193,432	66.33	12,830,344.56
COOPER COS INC/THE	16,931	372.78	6,311,538.18
CVS HEALTH CORP	458,311	69.60	31,898,445.60
DAVITA INC	22,235	97.73	2,173,026.55
DENTSPLY SIRONA INC	77,655	38.44	2,985,058.20

DEXCOM INC	140,706	126.75	17,834,485.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	216,400	90.34	19,549,576.00
ELEVANCE HEALTH INC	84,929	450.40	38,252,021.60
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	146,596	79.82	11,701,292.72
HCA HEALTHCARE INC	74,407	295.40	21,979,827.80
HENRY SCHEIN INC	47,391	78.90	3,739,149.90
HOLOGIC INC	91,537	81.46	7,456,604.02
HUMANA INC	45,225	445.95	20,168,088.75
IDEXX LABORATORIES INC	29,446	487.78	14,363,169.88
INSULET CORP	25,647	287.85	7,382,488.95
INTUITIVE SURGICAL INC	125,236	327.26	40,984,733.36
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	32,185	234.83	7,558,003.55
MASIMO CORP	16,542	162.00	2,679,804.00
MCKESSON CORP	49,498	415.76	20,579,288.48
MEDTRONIC PLC	475,887	87.48	41,630,594.76
MOLINA HEALTHCARE INC	21,512	287.94	6,194,165.28
NOVOCURE LTD	30,832	41.77	1,287,852.64
QUEST DIAGNOSTICS INC	38,458	141.49	5,441,422.42
RESMED INC	52,417	215.27	11,283,807.59
STERIS PLC	36,698	210.81	7,736,305.38
STRYKER CORP	122,785	297.88	36,575,195.80
TELEFLEX INC	15,654	237.30	3,714,694.20
THE CIGNA GROUP	106,317	274.85	29,221,227.45
UNITEDHEALTH GROUP INC	334,220	477.00	159,422,940.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	24,352	151.43	3,687,623.36
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	51,065	200.76	10,251,809.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	76,881	143.99	11,070,095.19
ABBVIE INC	632,063	135.92	85,910,002.96
AGILENT TECHNOLOGIES INC	105,244	119.42	12,568,238.48
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	42,810	192.69	8,249,058.90
AMGEN INC	191,390	227.11	43,466,582.90
AVANTOR INC	253,057	19.67	4,977,631.19
BIO-RAD LABORATORIES-A	8,004	365.80	2,927,863.20
BIO-TECHNE CORP	54,867	76.62	4,203,909.54
BIOGEN INC	51,000	284.52	14,510,520.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	69,383	93.50	6,487,310.50

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	754,020	65.04	49,041,460.80
CATALENT INC	70,521	44.06	3,107,155.26
CHARLES RIVER LABORATORIES	18,126	207.81	3,766,764.06
DANAHER CORP	247,997	238.18	59,067,925.46
ELI LILLY & CO	289,397	458.84	132,786,919.48
EXACT SCIENCES CORP	65,656	92.62	6,081,058.72
GILEAD SCIENCES INC	447,242	77.47	34,647,837.74
HORIZON THERAPEUTICS PLC	79,314	102.56	8,134,443.84
ILLUMINA INC	56,880	201.67	11,470,989.60
INCYTE CORP	66,688	62.45	4,164,665.60
IQVIA HOLDINGS INC	66,737	214.06	14,285,722.22
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	20,987	124.86	2,620,436.82
JOHNSON & JOHNSON	931,139	165.48	154,084,881.72
MERCK & CO. INC.	909,363	114.60	104,212,999.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8,085	1,288.25	10,415,501.25
MODERNA INC	115,841	118.50	13,727,158.50
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	37,628	96.39	3,626,962.92
PFIZER INC	2,022,851	38.30	77,475,193.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	38,486	779.73	30,008,688.78
REPLIGEN CORP	17,444	149.57	2,609,099.08
REVVITY INC	47,435	115.97	5,501,036.95
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	142,126	30.95	4,398,799.70
SEAGEN INC	50,904	198.22	10,090,190.88
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	437,021	7.62	3,330,100.02
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	138,135	524.21	72,411,748.35
UNITED THERAPEUTICS CORP	17,600	222.36	3,913,536.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	92,152	347.00	31,976,744.00
VIATRIS INC	431,866	9.76	4,215,012.16
WATERS CORP	21,987	259.84	5,713,102.08
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	26,923	367.00	9,880,741.00
ZOETIS INC	166,068	168.37	27,960,869.16
BANK OF AMERICA CORP	2,578,388	27.75	71,550,267.00
CITIGROUP INC	700,564	46.02	32,239,955.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	171,073	25.47	4,357,229.31
FIFTH THIRD BANCORP	236,722	25.54	6,045,879.88
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	3,794	1,208.38	4,584,593.72

FIRST HORIZON CORP	173,558	11.00	1,909,138.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	505,449	10.21	5,160,634.29
JPMORGAN CHASE & CO	1,050,273	138.85	145,830,406.05
KEYCORP	306,076	9.35	2,861,810.60
M & T BANK CORP	60,159	115.87	6,970,623.33
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	142,909	123.03	17,582,094.27
REGIONS FINANCIAL CORP	348,054	16.95	5,899,515.30
TRUIST FINANCIAL CORP	475,419	30.00	14,262,570.00
US BANCORP	556,131	31.88	17,729,456.28
WEBSTER FINANCIAL CORP	57,805	36.51	2,110,460.55
WELLS FARGO & CO	1,347,784	40.61	54,733,508.24
ALLY FINANCIAL INC	96,450	26.37	2,543,386.50
AMERICAN EXPRESS CO	226,494	168.07	38,066,846.58
AMERIPRISE FINANCIAL INC	38,139	317.02	12,090,825.78
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	185,468	20.12	3,731,616.16
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	146,808	73.00	10,716,984.00
ARES MANAGEMENT CORP - A	57,459	90.41	5,194,868.19
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	290,658	42.84	12,451,788.72
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	465,013	335.25	155,895,608.25
BLACKROCK INC	53,591	680.45	36,465,995.95
BLACKSTONE INC	252,535	87.84	22,182,674.40
BLOCK INC	191,970	62.86	12,067,234.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	135,060	106.60	14,397,396.00
CARLYLE GROUP INC/THE	80,098	30.00	2,402,940.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	39,246	135.33	5,311,161.18
CME GROUP INC	128,760	181.67	23,391,829.20
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	58,300	61.47	3,583,701.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	93,741	115.42	10,819,586.22
EQUITABLE HOLDINGS INC	136,406	25.43	3,468,804.58
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	14,108	394.05	5,559,257.40
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	214,322	52.75	11,305,485.50
FISERV INC	218,503	120.49	26,327,426.47
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23,896	238.56	5,700,629.76
FRANKLIN RESOURCES INC	117,877	25.53	3,009,399.81
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	38.99	779,800.00
GLOBAL PAYMENTS INC	91,798	98.84	9,073,314.32

GOLDMAN SACHS GROUP INC	119,412	314.71	37,580,150.52
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	200,526	111.09	22,276,433.34
INVESCO LTD	115,882	16.01	1,855,270.82
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	27,787	162.80	4,523,723.60
KKR & CO INC	211,878	53.59	11,354,542.02
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	27,042	208.24	5,631,226.08
MARKETAXESS HOLDINGS INC	14,393	263.00	3,785,359.00
MASTERCARD INC - A	304,946	379.81	115,821,540.26
MOODY'S CORP	59,716	337.28	20,141,012.48
MORGAN STANLEY	449,659	83.58	37,582,499.22
MSCI INC	28,527	465.15	13,269,334.05
NASDAQ INC	127,376	49.64	6,322,944.64
NORTHERN TRUST CORP	75,740	71.28	5,398,747.20
PAYPAL HOLDINGS INC	382,065	66.94	25,575,431.10
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	71,929	97.19	6,990,779.51
S&P GLOBAL INC	117,241	390.36	45,766,196.76
SCHWAB (CHARLES) CORP	538,058	53.17	28,608,543.86
SEI INVESTMENTS COMPANY	39,270	56.98	2,237,604.60
STATE STREET CORP	118,212	71.07	8,401,326.84
SYNCHRONY FINANCIAL	154,684	32.70	5,058,166.80
T ROWE PRICE GROUP INC	82,987	106.33	8,824,007.71
TOAST INC-CLASS A	105,437	21.54	2,271,112.98
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	37,148	69.38	2,577,328.24
VISA INC-CLASS A SHARES	582,213	229.55	133,646,994.15
AFLAC INC	210,984	67.14	14,165,465.76
ALLSTATE CORP	95,954	107.53	10,317,933.62
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	28,005	116.03	3,249,420.15
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	265,451	55.22	14,658,204.22
AON PLC-CLASS A	74,132	331.43	24,569,568.76
ARCH CAPITAL GROUP LTD	135,954	72.41	9,844,429.14
ARTHUR J GALLAGHER & CO	77,089	212.46	16,378,328.94
ASSURANT INC	18,269	123.81	2,261,884.89
BROWN & BROWN INC	83,573	66.43	5,551,754.39
CHUBB LTD	148,349	193.24	28,666,960.76
CINCINNATI FINANCIAL CORP	57,094	95.71	5,464,466.74
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9,638	211.10	2,034,581.80

EVEREST RE GROUP LTD	14,562	345.66	5,033,500.92
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86,645	33.72	2,921,669.40
GLOBE LIFE INC	30,200	106.28	3,209,656.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	110,821	70.47	7,809,555.87
LOEWS CORP	65,826	57.90	3,811,325.40
MARKEL GROUP INC	4,594	1,324.05	6,082,685.70
MARSH & MCLENNAN COS	177,225	183.73	32,561,549.25
METLIFE INC	239,601	53.33	12,777,921.33
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	82,864	72.40	5,999,353.60
PROGRESSIVE CORP	209,632	132.77	27,832,840.64
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	133,653	83.89	11,212,150.17
TRAVELERS COS INC/THE	83,116	173.72	14,438,911.52
WILLIS TOWERS WATSON PLC	37,225	232.52	8,655,557.00
WR BERKLEY CORP	79,680	58.21	4,638,172.80
ACCENTURE PLC-CL A	226,134	298.43	67,485,169.62
ADOBE INC	164,274	484.72	79,626,893.28
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	54,596	88.63	4,838,843.48
ANSYS INC	31,125	319.54	9,945,682.50
ASPEN TECHNOLOGY INC	10,737	162.60	1,745,836.20
ATLASSIAN CORP-CL A	54,856	162.41	8,909,162.96
AUTODESK INC	76,613	202.00	15,475,826.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	78,632	51.72	4,066,847.04
BILL HOLDINGS INC	36,094	108.19	3,905,009.86
BLACK KNIGHT INC	51,474	57.00	2,934,018.00
CADENCE DESIGN SYS INC	98,503	225.32	22,194,695.96
CHECK POINT SOFTWARE TECH	33,201	126.06	4,185,318.06
CLOUDFLARE INC - CLASS A	96,116	63.41	6,094,715.56
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	185,117	62.04	11,484,658.68
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	78,368	143.65	11,257,563.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	14,727	153.17	2,255,734.59
DATADOG INC - CLASS A	91,575	93.67	8,577,830.25
DOCUSIGN INC	70,528	50.08	3,532,042.24
DROPBOX INC-CLASS A	105,126	26.33	2,767,967.58
DYNATRACE INC	82,144	50.58	4,154,843.52
EPAM SYSTEMS INC	20,043	214.00	4,289,202.00
FAIR ISAAC CORP	9,075	776.05	7,042,653.75

FORTINET INC	235,042	71.59	16,826,656.78
GARTNER INC	28,305	338.19	9,572,467.95
GEN DIGITAL INC	212,134	17.71	3,756,893.14
GODADDY INC - CLASS A	50,548	72.35	3,657,147.80
HUBSPOT INC	17,107	512.21	8,762,376.47
INTL BUSINESS MACHINES CORP	324,952	129.43	42,058,537.36
INTUIT INC	100,402	452.69	45,450,981.38
MICROSOFT CORP	2,533,947	335.02	848,922,923.94
MONDAY.COM LTD	6,900	169.52	1,169,688.00
MONGODB INC	25,298	389.99	9,865,967.02
OKTA INC	53,584	69.25	3,710,692.00
ORACLE CORP	580,144	118.64	68,828,284.16
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	631,976	14.03	8,866,623.28
PALO ALTO NETWORKS INC	108,254	243.94	26,407,480.76
PTC INC	41,723	140.86	5,877,101.78
ROPER TECHNOLOGIES INC	38,571	460.81	17,773,902.51
SALESFORCE INC	358,114	210.09	75,236,170.26
SERVICENOW INC	72,880	542.99	39,573,111.20
SNOWFLAKE INC-CLASS A	94,423	178.25	16,830,899.75
SPLUNK INC	53,603	100.98	5,412,830.94
SYNOPSYS INC	54,774	419.56	22,980,979.44
TWILIO INC - A	67,301	64.03	4,309,283.03
TYLER TECHNOLOGIES INC	15,174	396.93	6,023,015.82
UIPATH INC - CLASS A	126,300	15.73	1,986,699.00
UNITY SOFTWARE INC	81,932	37.47	3,069,992.04
VERISIGN INC	32,791	221.33	7,257,632.03
VMWARE INC-CLASS A	82,508	137.83	11,372,077.64
WIX.COM LTD	21,919	77.59	1,700,695.21
WORKDAY INC-CLASS A	72,049	222.25	16,012,890.25
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	84,291	66.62	5,615,466.42
ZSCALER INC	32,383	142.70	4,621,054.10
AMPHENOL CORP-CL A	209,585	80.19	16,806,621.15
APPLE INC	5,669,603	186.68	1,058,401,488.04
ARISTA NETWORKS INC	94,671	148.82	14,088,938.22
ARROW ELECTRONICS INC	22,583	135.08	3,050,511.64
CDW CORP/DE	47,028	177.40	8,342,767.20

CISCO SYSTEMS INC	1,464,054	50.33	73,685,837.82
COGNEX CORP	56,700	53.35	3,024,945.00
CORNING INC	294,609	33.86	9,975,460.74
DELL TECHNOLOGIES -C	86,496	50.87	4,400,051.52
F5 INC	20,124	144.45	2,906,911.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	470,924	16.52	7,779,664.48
HP INC	312,209	29.61	9,244,508.49
JUNIPER NETWORKS INC	122,932	29.91	3,676,896.12
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	65,236	157.98	10,305,983.28
MOTOROLA SOLUTIONS INC	60,882	278.61	16,962,334.02
NETAPP INC	79,448	73.21	5,816,388.08
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	70,743	60.32	4,267,217.76
TE CONNECTIVITY LTD	113,158	133.11	15,062,461.38
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	16,214	399.09	6,470,845.26
TRIMBLE INC	92,751	49.55	4,595,812.05
WESTERN DIGITAL CORP	118,289	37.86	4,478,421.54
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	18,052	264.33	4,771,685.16
AT&T INC	2,556,678	15.45	39,500,675.10
LIBERTY GLOBAL PLC- C	82,999	17.39	1,443,352.61
LIBERTY GLOBAL PLC-A	55,653	16.59	923,283.27
T-MOBILE US INC	216,311	132.80	28,726,100.80
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,507,981	35.51	53,548,405.31
AES CORP	236,364	20.43	4,828,916.52
ALLIANT ENERGY CORP	87,688	51.83	4,544,869.04
AMEREN CORPORATION	92,575	80.83	7,482,837.25
AMERICAN ELECTRIC POWER	181,349	83.49	15,140,828.01
AMERICAN WATER WORKS CO INC	70,014	145.76	10,205,240.64
ATMOS ENERGY CORP	53,948	114.42	6,172,730.16
CENTERPOINT ENERGY INC	234,182	28.47	6,667,161.54
CMS ENERGY CORP	100,621	58.59	5,895,384.39
CONSOLIDATED EDISON INC	121,209	90.74	10,998,504.66
CONSTELLATION ENERGY	119,373	90.36	10,786,544.28
DOMINION ENERGY INC	294,826	51.82	15,277,883.32
DTE ENERGY COMPANY	74,910	110.00	8,240,100.00
DUKE ENERGY CORP	276,780	89.72	24,832,701.60
EDISON INTERNATIONAL	140,232	67.76	9,502,120.32

ENTERGY CORP	78,733	97.13	7,647,336.29
ESSENTIAL UTILITIES INC	96,524	40.01	3,861,925.24
EVERGY INC	80,215	57.31	4,597,121.65
EVERSOURCE ENERGY	128,003	69.73	8,925,649.19
EXELON CORP	352,321	39.87	14,047,038.27
FIRSTENERGY CORP	195,855	38.49	7,538,458.95
NEXTERA ENERGY INC	725,343	74.17	53,798,690.31
NISOURCE INC	155,640	26.72	4,158,700.80
NRG ENERGY INC	77,774	34.69	2,697,980.06
P G & E CORP	632,257	16.89	10,678,820.73
PPL CORP	265,319	26.38	6,999,115.22
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	179,815	61.50	11,058,622.50
SEMPRA ENERGY	110,773	143.75	15,923,618.75
SOUTHERN CO/THE	391,593	70.45	27,587,726.85
UGI CORP	77,644	26.45	2,053,683.80
VISTRA CORP	119,689	25.10	3,004,193.90
WEC ENERGY GROUP INC	114,226	87.90	10,040,465.40
XCEL ENERGY INC	195,612	62.10	12,147,505.20
ADVANCED MICRO DEVICES	576,673	110.01	63,439,796.73
ANALOG DEVICES INC	181,285	185.94	33,708,132.90
APPLIED MATERIALS INC	303,004	136.07	41,229,754.28
BROADCOM INC	149,408	822.15	122,835,787.20
ENPHASE ENERGY INC	49,183	158.69	7,804,850.27
ENTEGRIS INC	53,642	103.54	5,554,092.68
FIRST SOLAR INC	35,704	184.52	6,588,102.08
INTEL CORP	1,494,955	33.00	49,333,515.00
KLA CORP	49,693	456.95	22,707,216.35
LAM RESEARCH CORP	48,510	608.76	29,530,947.60
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	48,200	85.35	4,113,870.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	308,322	57.82	17,827,178.04
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	195,214	81.97	16,001,691.58
MICRON TECHNOLOGY INC	395,862	65.28	25,841,871.36
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	16,542	506.00	8,370,252.00
NVIDIA CORP	885,082	422.09	373,584,261.38
NXP SEMICONDUCTORS NV	91,824	188.69	17,326,270.56
ON SEMICONDUCTOR	153,718	87.52	13,453,399.36

	QORVO INC	38,881	97.32	3,783,898.92	
	QUALCOMM INC	399,744	113.43	45,342,961.92	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	55,375	102.02	5,649,357.50	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	19,580	243.65	4,770,667.00	
	TERADYNE INC	58,440	105.16	6,145,550.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	325,426	167.68	54,567,431.68	
	WOLFSPEED INC	40,925	49.45	2,023,741.25	
	CBRE GROUP INC - A	107,372	75.23	8,077,595.56	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	356,100	3.90	1,388,790.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	51,785	48.07	2,489,304.95	
	アメリカドル 小計	121,746,342		13,500,903,873.32 (1,937,244,696,782)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	205,200	18.01	3,695,652.00	
	CAMECO CORP	160,500	39.45	6,331,725.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	399,100	70.35	28,076,685.00	
	CENOVUS ENERGY INC	497,400	21.15	10,520,010.00	
	ENBRIDGE INC	723,300	47.74	34,530,342.00	
	IMPERIAL OIL LTD	75,500	63.38	4,785,190.00	
	KEYERA CORP	76,700	29.37	2,252,679.00	
	PARKLAND CORP	42,600	32.35	1,378,110.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	193,232	39.76	7,682,904.32	
	SUNCOR ENERGY INC	481,600	37.51	18,064,816.00	
	TC ENERGY CORP	359,300	51.81	18,615,333.00	
	TOURMALINE OIL CORP	122,200	60.05	7,338,110.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	177,140	64.79	11,476,900.60	
	BARRICK GOLD CORP	643,200	21.69	13,951,008.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	50,500	61.89	3,125,445.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	223,400	31.55	7,048,270.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	70,100	183.59	12,869,659.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	193,100	12.35	2,384,785.00	
	KINROSS GOLD CORP	392,200	6.09	2,388,498.00	
	LUNDIN MINING CORP	222,100	10.32	2,292,072.00	
	NUTRIEN LTD	175,759	77.56	13,631,868.04	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	125,900	19.05	2,398,395.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	168,700	52.14	8,796,018.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	18,200	107.00	1,947,400.00	

WHEATON PRECIOUS METALS CORP	165,000	56.21	9,274,650.00
CAE INC	122,100	28.00	3,418,800.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	28,300	104.30	2,951,690.00
WSP GLOBAL INC	44,300	168.61	7,469,423.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	76,600	48.53	3,717,398.00
RB GLOBAL INC	67,700	73.06	4,946,162.00
THOMSON REUTERS CORP	60,632	176.17	10,681,539.44
AIR CANADA	62,200	22.88	1,423,136.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	201,100	155.32	31,234,852.00
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	334,400	105.57	35,302,608.00
TFI INTERNATIONAL INC	25,900	139.54	3,614,086.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	102,800	68.63	7,055,164.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	103.52	1,625,264.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	57,100	39.98	2,282,858.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	108,010	99.38	10,734,033.80
QUEBECOR INC -CL B	55,600	31.52	1,752,512.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19,100	170.53	3,257,123.00
DOLLARAMA INC	103,800	86.36	8,964,168.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	275,900	63.48	17,514,132.00
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	35.51	1,963,703.00
LOBLAW COMPANIES LTD	56,300	116.39	6,552,757.00
METRO INC/CN	84,000	71.91	6,040,440.00
WESTON (GEORGE) LTD	21,311	152.35	3,246,730.85
SAPUTO INC	95,600	29.63	2,832,628.00
BANK OF MONTREAL	256,900	115.70	29,723,330.00
BANK OF NOVA SCOTIA	429,000	63.28	27,147,120.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	325,000	55.25	17,956,250.00
NATIONAL BANK OF CANADA	119,900	94.62	11,344,938.00
ROYAL BANK OF CANADA	496,200	122.32	60,695,184.00
TORONTO-DOMINION BANK	652,500	78.00	50,895,000.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	135,688	41.77	5,667,687.76
BROOKFIELD CORP	503,450	41.32	20,802,554.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	126,200	20.21	2,550,502.00
IGM FINANCIAL INC	39,400	39.26	1,546,844.00
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	17,800	35.81	637,418.00
ONEX CORPORATION	24,300	70.09	1,703,187.00

	TMX GROUP LTD	98,000	28.47	2,790,060.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7,700	965.07	7,431,039.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	104,600	37.19	3,890,074.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	34,100	86.87	2,962,267.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	63,100	195.74	12,351,194.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	675,000	24.02	16,213,500.00	
	POWER CORP OF CANADA	209,000	34.36	7,181,240.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	212,900	66.40	14,136,560.00	
	CGI INC	76,000	134.11	10,192,360.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	7,200	2,660.96	19,158,912.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	29,200	100.86	2,945,112.00	
	OPEN TEXT CORP	91,800	52.87	4,853,466.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	428,000	84.11	35,999,080.00	
	BCE INC	22,600	58.82	1,329,332.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	123,300	58.57	7,221,681.00	
	TELUS CORP	145,100	25.35	3,678,285.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	241,500	10.61	2,562,315.00	
	ALTAGAS LTD	94,600	22.80	2,156,880.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	54,950	41.88	2,301,306.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	34.35	2,009,475.00	
	EMERA INC	102,300	53.38	5,460,774.00	
	FORTIS INC	176,700	55.43	9,794,481.00	
	HYDRO ONE LTD	110,100	37.13	4,088,013.00	
	NORTHLAND POWER INC	79,600	26.79	2,132,484.00	
	FIRSTSERVICE CORP	13,900	191.87	2,666,993.00	
	カナダドル 小計	14,421,772		829,614,630.81 (90,386,514,026)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	82,331	29.80	2,453,463.80	
	SANTOS LTD	1,164,635	7.30	8,501,835.50	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	671,153	33.74	22,644,702.22	
	BHP GROUP LTD	1,810,121	44.60	80,731,396.60	
	BLUESCOPE STEEL LTD	157,082	20.09	3,155,777.38	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	616,506	21.41	13,199,393.46	
	IGO LTD	231,962	15.06	3,493,347.72	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	169,026	38.73	6,546,376.98	
	MINERAL RESOURCES LTD	62,759	71.96	4,516,137.64	

NEWCREST MINING LTD	330,667	25.88	8,557,661.96
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	379,080	12.30	4,662,684.00
ORICA LTD	158,310	14.90	2,358,819.00
PILBARA MINERALS LTD	924,776	4.90	4,531,402.40
RIO TINTO LTD	133,167	113.13	15,065,182.71
SOUTH32 LTD	1,717,801	3.72	6,390,219.72
REECE LTD	81,800	18.26	1,493,668.00
BRAMBLES LTD	523,031	14.05	7,348,585.55
COMPUTERSHARE LTD	216,679	22.67	4,912,112.93
AURIZON HOLDINGS LTD	607,049	3.84	2,331,068.16
QANTAS AIRWAYS LTD	318,258	6.20	1,973,199.60
TRANSURBAN GROUP	1,121,113	14.22	15,942,226.86
ARISTOCRAT LEISURE LTD	218,650	38.03	8,315,259.50
IDP EDUCATION LTD	98,033	21.71	2,128,296.43
LOTTERY CORP LTD/THE	820,014	5.07	4,157,470.98
REA GROUP LTD	16,523	132.70	2,192,602.10
SEEK LTD	111,070	21.59	2,398,001.30
WESFARMERS LTD	405,622	48.07	19,498,249.54
COLES GROUP LTD	465,135	18.40	8,558,484.00
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	584,671	6.27	3,665,887.17
WOOLWORTHS GROUP LTD	436,753	39.86	17,408,974.58
TREASURY WINE ESTATES LTD	245,838	11.44	2,812,386.72
COCHLEAR LTD	23,404	227.96	5,335,175.84
RAMSAY HEALTH CARE LTD	66,537	54.92	3,654,212.04
SONIC HEALTHCARE LTD	163,646	34.74	5,685,062.04
CSL LTD	172,787	282.00	48,725,934.00
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,087,384	22.82	24,814,102.88
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	604,918	98.51	59,590,472.18
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,134,650	25.78	29,251,277.00
WESTPAC BANKING CORP	1,270,160	20.75	26,355,820.00
ASX LTD	70,918	61.63	4,370,676.34
MACQUARIE GROUP LTD	129,694	172.78	22,408,529.32
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	89,647	31.95	2,864,221.65
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	818,967	5.65	4,627,163.55
MEDIBANK PRIVATE LTD	936,375	3.60	3,370,950.00
QBE INSURANCE GROUP LTD	544,402	15.40	8,383,790.80

	SUNCORP GROUP LTD	426,844	13.48	5,753,857.12
	WISETECH GLOBAL LTD	55,637	76.80	4,272,921.60
	XERO LTD	54,063	111.34	6,019,374.42
	TELSTRA GROUP LTD	1,517,761	4.32	6,556,727.52
	APA GROUP	397,094	10.01	3,974,910.94
	ORIGIN ENERGY LTD	666,776	8.46	5,640,924.96
	LENLEASE GROUP	244,789	7.00	1,713,523.00
	オーストラリアドル 小計	25,356,068		575,314,501.71 (55,097,869,828)
イギリスポンド	BP PLC	6,328,436	4.54	28,772,234.27
	SHELL PLC	2,450,361	23.18	56,811,619.78
	ANGLO AMERICAN PLC	450,535	22.48	10,128,026.80
	ANTOFAGASTA PLC	155,265	14.52	2,255,224.12
	CRODA INTERNATIONAL PLC	52,230	55.64	2,906,077.20
	ENDEAVOUR MINING PLC	64,300	18.86	1,212,698.00
	GLENORE PLC	3,843,997	4.32	16,631,053.02
	JOHNSON MATTHEY PLC	58,854	16.79	988,452.93
	MONDI PLC	161,979	11.85	1,919,451.15
	RIO TINTO PLC	402,282	49.71	19,999,449.63
	ASHTREAD GROUP PLC	160,184	53.82	8,621,102.88
	BAE SYSTEMS PLC	1,092,626	9.37	10,246,646.62
	BUNZL PLC	125,108	29.77	3,724,465.16
	DCC PLC	39,599	43.52	1,723,348.48
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,934,768	1.54	4,538,618.71
	SMITHS GROUP PLC	140,644	16.35	2,299,529.40
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	24,603	101.70	2,502,125.10
	EXPERIAN PLC	327,003	29.07	9,505,977.21
	INTERTEK GROUP PLC	55,231	42.69	2,357,811.39
	RELX PLC	682,935	26.04	17,783,627.40
	RENTOKIL INITIAL PLC	885,676	6.22	5,508,904.72
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	378,223	4.07	1,540,880.50
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	43,223	37.73	1,630,803.79
	BURBERRY GROUP PLC	126,278	21.40	2,702,349.20
	PERSIMMON PLC	103,740	10.59	1,098,606.60
	TAYLOR WIMPEY PLC	1,180,533	1.00	1,188,796.73
	COMPASS GROUP PLC	616,090	21.82	13,443,083.80

ENTAIN PLC	198,717	12.30	2,444,219.10
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	65,460	52.62	3,444,505.20
PEARSON PLC	248,798	8.21	2,044,621.96
WHITBREAD PLC	78,523	32.71	2,568,487.33
AUTO TRADER GROUP PLC	333,922	5.91	1,975,482.55
INFORMA PLC	532,178	6.93	3,687,993.54
WPP PLC	408,201	8.40	3,430,521.20
JD SPORTS FASHION PLC	969,434	1.43	1,394,046.09
KINGFISHER PLC	726,268	2.25	1,634,103.00
NEXT PLC	41,419	66.12	2,738,624.28
OCADO GROUP PLC	164,438	5.37	884,018.68
SAINSBURY (J) PLC	620,861	2.57	1,596,854.49
TESCO PLC	2,671,626	2.48	6,647,005.48
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	119,280	19.53	2,329,538.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	761,960	26.25	20,001,450.00
COCA-COLA HBC AG-DI	79,436	23.41	1,859,596.76
DIAGEO PLC	806,442	33.05	26,652,908.10
IMPERIAL BRANDS PLC	319,866	17.72	5,669,624.85
HALEON PLC	1,858,087	3.27	6,075,944.49
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	257,290	60.82	15,648,377.80
UNILEVER PLC	904,983	40.90	37,013,804.70
SMITH & NEPHEW PLC	318,038	12.36	3,930,949.68
ASTRAZENECA PLC	555,018	114.22	63,394,155.96
GSK PLC	1,469,204	14.25	20,939,095.40
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	54,192	18.55	1,005,261.60
BARCLAYS PLC	5,689,892	1.45	8,262,861.16
HSBC HOLDINGS PLC	7,146,380	6.02	43,035,500.36
LLOYDS BANKING GROUP PLC	23,843,154	0.42	10,090,422.77
NATWEST GROUP PLC	2,026,809	2.29	4,645,446.22
STANDARD CHARTERED PLC	872,285	6.57	5,730,912.45
3I GROUP PLC	343,324	18.57	6,375,526.68
ABRDN PLC	805,516	2.06	1,663,390.54
HARGREAVES LANSDOWN PLC	123,322	7.72	952,045.84
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	145,454	84.22	12,250,135.88
M&G PLC	725,660	1.89	1,376,939.85
SCHRODERS PLC	321,906	4.30	1,387,092.95

	ST JAMES' S PLACE PLC	199,717	10.60	2,117,000.20	
	WISE PLC - A	218,500	5.29	1,156,302.00	
	ADMIRAL GROUP PLC	81,719	21.16	1,729,174.04	
	AVIVA PLC	934,484	3.86	3,608,977.20	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,050,970	2.23	4,573,663.10	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	293,906	5.30	1,558,289.61	
	PRUDENTIAL PLC	969,729	10.78	10,453,678.62	
	SAGE GROUP PLC/THE	358,305	8.71	3,122,986.38	
	HALMA PLC	139,177	22.59	3,144,008.43	
	BT GROUP PLC	2,429,600	1.27	3,097,740.00	
	VODAFONE GROUP PLC	8,111,593	0.72	5,896,316.95	
	CENTRICA PLC	2,029,600	1.18	2,406,090.80	
	NATIONAL GRID PLC	1,334,272	10.38	13,856,414.72	
	SEVERN TRENT PLC	83,766	26.83	2,247,441.78	
	SSE PLC	401,010	18.25	7,320,437.55	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	232,410	9.98	2,320,381.44	
	イギリスポンド 小計	99,360,804		635,431,332.75 (116,086,950,180)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99,007	12.49	1,236,597.43	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2,396	668.50	1,601,726.00	
	GIVAUDAN-REG	3,333	2,958.00	9,859,014.00	
	HOLCIM LTD	198,952	59.56	11,849,581.12	
	SIG GROUP AG	103,650	24.64	2,553,936.00	
	SIKA AG-REG	51,919	240.50	12,486,519.50	
	ABB LTD-REG	564,633	34.30	19,366,911.90	
	GEBERIT AG-REG	11,835	454.70	5,381,374.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	7,216	191.40	1,381,142.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	14,965	200.70	3,003,475.50	
	VAT GROUP AG	10,059	350.50	3,525,679.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	55,553	28.80	1,599,926.40	
	SGS SA-REG	56,139	84.18	4,725,781.02	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19,929	258.60	5,153,639.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	186,684	146.15	27,283,866.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	9,553	258.00	2,464,674.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	17,907	48.40	866,698.80	
	DUFREY AG-REG	36,100	38.57	1,392,377.00	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,298	1,703.00	2,210,494.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	350	10,900.00	3,815,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	42	109,000.00	4,578,000.00	
	NESTLE SA-REG	985,231	108.78	107,173,428.18	
	ALCON INC	179,222	72.28	12,954,166.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	19,536	233.20	4,555,795.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	41,421	137.75	5,705,742.75	
	BACHEM HOLDING AG	12,632	80.00	1,010,560.00	
	LONZA GROUP AG-REG	26,290	529.80	13,928,442.00	
	NOVARTIS AG-REG	733,974	90.69	66,564,102.06	
	ROCHE HOLDING AG-BR	11,378	297.80	3,388,368.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	251,727	276.50	69,602,515.50	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	9,251	93.05	860,805.55	
	JULIUS BAER GROUP LTD	74,047	54.62	4,044,447.14	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	8,302	817.80	6,789,375.60	
	UBS GROUP AG-REG	1,178,465	17.72	20,888,292.12	
	BALOISE HOLDING AG - REG	15,786	135.70	2,142,160.20	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	13,700	123.80	1,696,060.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	11,319	529.80	5,996,806.20	
	SWISS RE AG	108,777	88.50	9,626,764.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	53,995	424.80	22,937,076.00	
	TEMENOS AG - REG	22,921	69.16	1,585,216.36	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	58,091	49.90	2,898,740.90	
	SWISSCOM AG-REG	8,956	556.20	4,981,327.20	
	BKW AG	6,450	152.10	981,045.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	28,756	76.15	2,189,769.40	
	スイスフラン 小計	5,311,747		498,837,421.49 (79,888,813,051)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	988,868	48.15	47,613,994.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	465,000	81.15	37,734,750.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	656,000	11.60	7,609,600.00	
	MTR CORP	552,000	36.20	19,982,400.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	352,000	13.64	4,801,280.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	767,000	52.05	39,922,350.00	
	SANDS CHINA LTD	943,600	28.00	26,420,800.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	562,000	20.75	11,661,500.00	

	WH GROUP LTD	2,846,000	4.20	11,953,200.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,321,000	24.00	31,704,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	287,300	111.90	32,148,870.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	426,600	301.40	128,577,240.00	
	AIA GROUP LTD	4,171,200	78.15	325,979,280.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,165,000	9.05	10,543,250.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	253,000	41.15	10,410,950.00	
	CLP HOLDINGS LTD	622,000	61.55	38,284,100.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	3,767,348	6.75	25,429,599.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	514,500	40.70	20,940,150.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	750,868	42.95	32,249,780.60	
	ESR GROUP LTD	632,800	13.10	8,289,680.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	12.24	8,861,760.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	559,641	23.15	12,955,689.15	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	552,250	19.52	10,779,920.00	
	SINO LAND CO	1,247,400	9.39	11,713,086.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	525,000	97.65	51,266,250.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	145,000	52.35	7,590,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	18.72	9,374,976.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	639,000	40.20	25,687,800.00	
	香港ドル 小計	26,937,175		1,010,487,004.95 (18,512,121,930)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	33.25	1,004,150.00	
	KEPPEL CORP LTD	477,500	6.64	3,170,600.00	
	SEATRIM LTD	15,794,803	0.12	1,974,350.37	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	529,600	3.61	1,911,856.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	461,640	7.41	3,420,752.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,914,500	0.93	1,790,057.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	670,600	3.92	2,628,752.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	644,400	31.43	20,253,492.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,230,300	12.32	15,157,296.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	466,100	27.99	13,046,139.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	303,500	9.58	2,907,530.00	
	VENTURE CORP LTD	123,900	14.96	1,853,544.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,888,260	2.50	7,220,650.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,026,100	3.27	3,355,347.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	224,100	6.72	1,505,952.00	
	UOL GROUP LTD	194,000	6.39	1,239,660.00	
	シンガポールドル 小計	26,979,503		82,440,128.27 (8,754,317,220)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	418,085	8.46	3,536,999.10	
	EBOS GROUP LTD	54,700	36.80	2,012,960.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	205,994	24.00	4,943,856.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	630,447	5.12	3,227,888.64	
	MERCURY NZ LTD	216,705	6.41	1,389,079.05	
	MERIDIAN ENERGY LTD	445,023	5.40	2,403,124.20	
	ニュージーランドドル 小計	1,970,954		17,513,906.99 (1,546,828,265)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	107,054	308.70	33,047,569.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	382.50	12,629,002.50	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	201,215	138.55	27,878,338.25	
	ALFA LAVAL AB	107,071	379.40	40,622,737.40	
	ASSA ABLOY AB-B	348,981	246.00	85,849,326.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	951,688	153.85	146,417,198.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	580,662	134.05	77,837,741.10	
	BEIJER REF AB	120,100	134.30	16,129,430.00	
	EPIROC AB-A	235,563	195.75	46,111,457.25	
	EPIROC AB-B	132,310	166.20	21,989,922.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	94.18	14,996,469.76	
	INDUTRADE AB	90,200	242.40	21,864,480.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	205.90	12,036,708.10	
	LIFCO AB-B SHS	96,300	223.60	21,532,680.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	558,696	100.90	56,372,426.40	
	SAAB AB-B	28,000	592.00	16,576,000.00	
	SANDVIK AB	370,537	203.70	75,478,386.90	
	SKANSKA AB-B SHS	104,733	141.60	14,830,192.80	
	SKF AB-B SHARES	141,090	188.20	26,553,138.00	
	VOLVO AB-A SHS	62,474	219.40	13,706,795.60	
	VOLVO AB-B SHS	551,007	212.80	117,254,289.60	
SECURITAS AB-B SHS	156,813	84.00	13,172,292.00		
VOLVO CAR AB-B	207,500	42.68	8,856,100.00		
EVOLUTION AB	67,611	1,340.20	90,612,262.20		

	EMBRACER GROUP AB	230,400	26.01	5,992,704.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	219,361	155.38	34,084,312.18	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	211,829	285.70	60,519,545.30	
	GETINGE AB-B SHS	85,916	182.65	15,692,557.40	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	60,727	210.80	12,801,251.60	
	NORDEA BANK ABP	1,181,740	112.26	132,662,132.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	591,053	114.75	67,823,331.75	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	515,326	88.62	45,668,190.12	
	SWEDBANK AB - A SHARES	294,827	178.30	52,567,654.10	
	EQT AB	117,771	208.80	24,590,584.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	44,871	288.60	12,949,770.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	53,600	287.70	15,420,720.00	
	INVESTOR AB-A SHS	168,800	209.90	35,431,120.00	
	INVESTOR AB-B SHS	617,963	208.95	129,123,368.85	
	KINNEVIK AB - B	80,928	140.35	11,358,244.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	24,225	445.30	10,787,392.50	
	ERICSSON LM-B SHS	1,083,625	54.18	58,710,802.50	
	HEXAGON AB-B SHS	728,684	127.10	92,615,736.40	
	TELE2 AB-B SHS	198,238	88.26	17,496,485.88	
	TELIA CO AB	910,648	23.10	21,035,968.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	296,348	37.94	11,243,443.12	
	SAGAX AB-B	64,700	211.30	13,671,110.00	
	スウェーデンクローネ 小計	13,251,893		1,894,601,371.56 (25,387,658,378)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	103,871	246.30	25,583,427.30	
	EQUINOR ASA	347,894	308.55	107,342,693.70	
	NORSK HYDRO ASA	519,804	62.32	32,394,185.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	61,095	376.90	23,026,705.50	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,500	487.20	15,834,000.00	
	ADEVINTA ASA	106,857	74.85	7,998,246.45	
	MOWI ASA	166,963	170.15	28,408,754.45	
	ORKLA ASA	250,892	77.26	19,383,915.92	
	SALMAR ASA	25,891	423.40	10,962,249.40	
	DNB BANK ASA	315,870	190.95	60,315,376.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69,251	172.50	11,945,797.50	
	TELENOR ASA	268,841	109.50	29,438,089.50	

	ノルウェークローネ 小計	2,269,729		372,633,441.50 (4,948,572,103)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	40,357	475.00	19,169,575.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	71,863	318.90	22,917,110.70
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	1,630.00	5,706,630.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	365,695	180.06	65,847,041.70
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,039	11,690.00	12,145,910.00
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,814	11,805.00	21,414,270.00
	DSV A/S	67,683	1,358.50	91,947,355.50
	PANDORA A/S	30,806	576.20	17,750,417.20
	CARLSBERG AS-B	34,731	1,067.50	37,075,342.50
	COLOPLAST-B	39,767	860.80	34,231,433.60
	DEMANT A/S	34,228	280.30	9,594,108.40
	GENMAB A/S	24,118	2,618.00	63,140,924.00
	NOVO NORDISK A/S-B	592,508	1,088.40	644,885,707.20
	DANSKE BANK A/S	256,587	159.00	40,797,333.00
	TRYG A/S	137,570	149.20	20,525,444.00
ORSTED A/S	68,474	625.60	42,837,334.40	
	デンマーククローネ 小計	1,770,741		1,149,985,937.20 (24,161,204,540)
イスラエルシケル	ICL GROUP LTD	299,785	20.75	6,220,538.75
	ELBIT SYSTEMS LTD	10,169	760.50	7,733,524.50
	BANK HAPOALIM BM	445,216	30.43	13,547,922.88
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	520,979	27.50	14,326,922.50
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	403,741	18.37	7,416,722.17
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48,267	124.20	5,994,761.40
	NICE LTD	22,115	750.00	16,586,250.00
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	35,700	139.40	4,976,580.00
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	215.60	3,192,173.60
	イスラエルシケル 小計	1,800,778		79,995,395.80 (3,166,433,753)
ユーロ	ENI SPA	815,099	12.79	10,430,006.80
	GALP ENERGIA SGPS SA	199,355	10.54	2,101,201.70
	NESTE OYJ	158,677	34.70	5,506,091.90
	OMV AG	55,701	37.57	2,092,686.57
	REPSOL SA	480,018	12.95	6,216,233.10

TENARIS SA	169,211	12.80	2,166,746.85
TOTALENERGIES SE	849,270	52.05	44,204,503.50
AIR LIQUIDE SA	187,778	158.58	29,777,835.24
AKZO NOBEL N.V.	59,754	70.42	4,207,876.68
ARCELORMITTAL	171,834	24.57	4,221,961.38
ARKEMA	19,014	80.12	1,523,401.68
BASF SE	324,771	42.23	13,716,703.18
COVESTRO AG	64,321	49.00	3,151,729.00
CRH PLC	265,682	48.83	12,973,252.06
DSM-FIRMENICH AG	63,631	94.44	6,009,311.64
EVONIK INDUSTRIES AG	76,974	16.67	1,283,156.58
HEIDELBERG MATERIALS AG	49,251	73.08	3,599,263.08
OCI NV	34,955	22.35	781,244.25
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	96,855	30.32	2,936,643.60
SOLVAY SA	29,153	98.96	2,884,980.88
STORA ENSO OYJ-R SHS	225,908	10.55	2,383,329.40
SYMRISE AG	47,263	93.42	4,415,309.46
UMICORE	77,865	25.73	2,003,466.45
UPM-KYMMENE OYJ	196,377	27.16	5,333,599.32
VOESTALPINE AG	39,061	32.04	1,251,514.44
WACKER CHEMIE AG	6,600	120.25	793,650.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	80,655	30.97	2,497,885.35
AIRBUS SE	212,511	126.74	26,933,644.14
ALSTOM	114,969	26.87	3,089,217.03
BOUYGUES SA	69,916	29.60	2,069,513.60
BRENTAG SE	58,066	70.06	4,068,103.96
CNH INDUSTRIAL NV	357,627	12.87	4,604,447.62
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	177,863	54.05	9,613,495.15
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	170,311	30.74	5,235,360.14
DASSAULT AVIATION SA	9,266	178.20	1,651,201.20
EIFFAGE	27,982	94.74	2,651,014.68
FERROVIAL SE	180,338	28.55	5,148,649.90
GEA GROUP AG	52,112	37.84	1,971,918.08
IMCD NV	19,265	127.30	2,452,434.50
KINGSPAN GROUP PLC	59,240	57.16	3,386,158.40
KNORR-BREMSE AG	25,881	65.40	1,692,617.40

KONE OYJ-B	126,054	47.39	5,973,699.06
LEGRAND SA	92,909	87.02	8,084,941.18
METSO CORP	226,750	10.61	2,406,951.25
MTU AERO ENGINES AG	20,142	237.30	4,779,696.60
PRYSMIAN SPA	95,781	35.08	3,359,997.48
RATIONAL AG	2,060	629.00	1,295,740.00
RHEINMETALL AG	16,260	255.90	4,160,934.00
SAFRAN SA	120,274	139.48	16,775,817.52
SCHNEIDER ELECTRIC SE	194,700	158.10	30,782,070.00
SIEMENS AG-REG	272,023	156.98	42,702,170.54
SIEMENS ENERGY AG	176,654	14.65	2,587,981.10
THALES SA	36,648	134.65	4,934,653.20
VINCI SA	188,356	104.00	19,589,024.00
WARTSILA OYJ ABP	161,062	10.26	1,653,301.43
BUREAU VERITAS SA	94,880	24.41	2,316,020.80
RANDSTAD NV	40,342	47.27	1,906,966.34
TELEPERFORMANCE	19,579	153.15	2,998,523.85
WOLTERS KLUWER	92,837	117.30	10,889,780.10
ADP	10,260	132.10	1,355,346.00
AENA SME SA	28,703	144.95	4,160,499.85
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	227,150	9.21	2,092,278.65
DEUTSCHE POST AG-REG	363,590	43.19	15,703,452.10
GETLINK SE	131,636	15.45	2,034,434.38
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	118,302	108.62	12,849,963.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	19,307	100.40	1,938,422.80
CONTINENTAL AG	41,850	66.82	2,796,417.00
DR ING HC F PORSCHE AG	38,470	108.40	4,170,148.00
FERRARI NV	45,897	282.60	12,970,492.20
MERCEDES-BENZ GROUP AG	307,649	72.03	22,159,957.47
MICHELIN (CGDE)	250,848	26.26	6,587,268.48
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	54,611	54.14	2,956,639.54
RENAULT SA	69,801	35.67	2,489,801.67
STELLANTIS NV	806,485	15.11	12,190,827.26
VALEO	72,083	19.19	1,383,272.77
VOLKSWAGEN AG	12,382	150.75	1,866,586.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	73,649	122.36	9,011,691.64

ADIDAS AG	56,468	176.88	9,988,059.84
HERMES INTERNATIONAL	11,363	1,901.40	21,605,608.20
KERING	26,497	502.20	13,306,793.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	98,982	830.10	82,164,958.20
MONCLER SPA	70,646	62.44	4,411,136.24
PUMA SE	43,656	51.90	2,265,746.40
SEB SA	9,694	88.40	856,949.60
ACCOR SA	72,993	32.83	2,396,360.19
AMADEUS IT GROUP SA	162,444	68.34	11,101,422.96
DELIVERY HERO SE	67,819	34.71	2,353,997.49
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	62,568	180.05	11,265,368.40
JUST EAT TAKEAWAY	90,381	12.43	1,123,978.11
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	37,870	35.44	1,342,112.80
SODEXO SA	32,194	102.40	3,296,665.60
BOLLORE SE	294,489	5.50	1,621,161.94
PUBLICIS GROUPE	84,876	71.04	6,029,591.04
SCOUT24 SE	27,257	57.34	1,562,916.38
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	289,337	19.28	5,579,864.04
VIVENDI SE	236,529	8.26	1,955,148.71
D' IETEREN GROUP	8,226	157.20	1,293,127.20
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	388,239	33.90	13,161,302.10
PROSUS NV	288,997	62.89	18,175,021.33
ZALANDO SE	72,249	26.65	1,925,435.85
CARREFOUR SA	225,687	16.40	3,702,395.23
HELLOFRESH SE	67,988	20.52	1,395,113.76
JERONIMO MARTINS	95,613	25.26	2,415,184.38
KESKO OYJ-B SHS	93,457	16.97	1,586,432.57
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	358,353	30.24	10,836,594.72
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	315,521	52.40	16,533,300.40
DANONE	228,893	56.09	12,838,608.37
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	210,240	12.29	2,584,900.80
HEINEKEN HOLDING NV	44,614	80.20	3,578,042.80
HEINEKEN NV	94,366	95.46	9,008,178.36
JDE PEET' S NV	53,600	27.32	1,464,352.00
KERRY GROUP PLC-A	54,517	87.10	4,748,430.70
PERNOD RICARD SA	72,925	196.75	14,347,993.75

REMY COINTREAU	6,746	139.90	943,765.40
BEIERSDORF AG	37,736	120.60	4,550,961.60
HENKEL AG & CO KGAA	34,620	63.68	2,204,601.60
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	64,021	72.00	4,609,512.00
L' OREAL	86,374	406.40	35,102,393.60
AMPLIFON SPA	42,891	33.30	1,428,270.30
BIOMERIEUX	13,869	90.84	1,259,859.96
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	15,246	103.85	1,583,297.10
DIASORIN SPA	9,103	96.10	874,798.30
ESSILORLUXOTTICA	104,796	167.56	17,559,617.76
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	67,833	44.84	3,041,631.72
FRESENIUS SE & CO KGAA	148,916	25.19	3,751,194.04
KONINKLIJKE PHILIPS NV	329,605	18.74	6,177,456.91
SIEMENS HEALTHINEERS AG	105,017	51.24	5,381,071.08
ARGENX SE	19,640	363.20	7,133,248.00
BAYER AG-REG	353,807	50.50	17,867,253.50
EUROFINS SCIENTIFIC	44,948	56.58	2,543,157.84
GRIFOLS SA	126,564	11.46	1,451,056.26
IPSEN	13,860	108.60	1,505,196.00
MERCK KGAA	47,749	152.95	7,303,209.55
ORION OYJ-CLASS B	34,824	38.22	1,330,973.28
QIAGEN N. V.	77,251	41.41	3,198,963.91
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	32,103	43.13	1,384,602.39
SANOFI	406,908	98.60	40,121,128.80
SARTORIUS AG-VORZUG	9,986	309.30	3,088,669.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10,076	231.50	2,332,594.00
UCB SA	42,461	83.68	3,553,136.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	133,234	13.47	1,795,328.15
AIB GROUP PLC	464,870	3.81	1,771,154.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,147,930	6.65	14,288,030.36
BANCO SANTANDER SA	5,909,329	3.06	18,118,002.71
BANK OF IRELAND GROUP PLC	407,946	8.69	3,545,866.63
BNP PARIBAS	397,772	54.85	21,817,794.20
CAIXABANK SA	1,458,488	3.65	5,323,481.20
COMMERZBANK AG	404,922	9.62	3,895,349.64
CREDIT AGRICOLE SA	418,393	10.47	4,380,574.71

ERSTE GROUP BANK AG	130,693	30.43	3,976,987.99
FINECOBANK SPA	218,566	11.97	2,616,235.02
ING GROEP NV	1,316,248	11.70	15,402,734.09
INTESA SANPAOLO	5,725,255	2.33	13,368,470.42
KBC GROUP NV	86,970	60.74	5,282,557.80
MEDIOBANCA SPA	181,481	10.76	1,952,735.56
SOCIETE GENERALE SA	259,372	22.70	5,887,744.40
UNICREDIT SPA	653,147	20.14	13,157,646.31
ADYEN NV	7,846	1,540.20	12,084,409.20
AMUNDI SA	21,837	52.05	1,136,615.85
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	673,219	9.16	6,170,052.13
DEUTSCHE BOERSE AG	67,667	167.70	11,347,755.90
EDENRED	92,849	59.88	5,559,798.12
EURAZEO SE	19,619	62.70	1,230,111.30
EURONEXT NV	28,504	63.35	1,805,728.40
EXOR NV	41,814	79.34	3,317,522.76
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	33,261	71.44	2,376,165.84
NEXI SPA	224,714	6.92	1,555,020.88
SOFINA	5,291	191.00	1,010,581.00
WENDEL	9,312	92.90	865,084.80
WORLDLINE SA	79,835	31.81	2,539,551.35
AEGON NV	589,592	4.51	2,659,059.92
AGEAS	51,936	36.91	1,916,957.76
ALLIANZ SE-REG	144,526	209.15	30,227,612.90
ASSICURAZIONI GENERALI	352,127	18.26	6,429,839.02
AXA SA	660,925	26.41	17,455,029.25
HANNOVER RUECK SE	22,584	190.30	4,297,735.20
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	49,353	330.60	16,316,101.80
NN GROUP NV	91,002	32.49	2,956,654.98
POSTE ITALIANE SPA	188,025	9.52	1,790,374.05
SAMPO OYJ-A SHS	164,393	41.07	6,751,620.51
TALANX AG	23,200	50.80	1,178,560.00
BECHTLE AG	26,787	36.12	967,546.44
CAPGEMINI SE	59,342	169.35	10,049,567.70
DASSAULT SYSTEMES SE	242,531	39.68	9,623,630.08
NEMETSCHEK SE	20,683	68.92	1,425,472.36

SAP SE	373,883	122.58	45,830,578.14
NOKIA OYJ	1,876,698	3.75	7,037,617.50
CELLNEX TELECOM SA	202,660	36.34	7,364,664.40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,166,888	19.55	22,821,995.50
ELISA OYJ	51,319	49.07	2,518,223.33
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	114,083	11.74	1,339,334.42
KONINKLIJKE KPN NV	1,105,850	3.21	3,555,307.75
ORANGE	662,271	10.36	6,866,425.72
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.25	936,753.36
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	297,838	2.59	773,783.12
TELEFONICA SA	1,919,526	3.64	6,990,913.69
ACCIONA SA	8,326	154.00	1,282,204.00
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	19,200	29.96	575,232.00
E.ON SE	814,754	11.37	9,263,752.98
EDP RENOVAVEIS SA	96,779	18.72	1,812,186.77
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	985,811	4.48	4,421,362.33
ELIA GROUP SA/NV	10,658	113.60	1,210,748.80
ENAGAS SA	82,825	17.71	1,467,244.87
ENDESA SA	108,855	20.85	2,269,626.75
ENEL SPA	2,941,489	6.05	17,816,598.87
ENGIE	663,487	14.11	9,363,128.54
FORTUM OYJ	143,538	12.39	1,779,153.51
IBERDROLA SA	2,090,263	11.67	24,403,820.52
NATURGY ENERGY GROUP SA	45,200	26.60	1,202,320.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	131,018	15.91	2,084,496.38
RWE AG	220,320	39.73	8,753,313.60
SNAM SPA	693,764	4.70	3,261,384.56
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	533,994	7.61	4,063,694.34
VEOLIA ENVIRONNEMENT	241,804	28.18	6,814,036.72
VERBUND AG	22,697	69.45	1,576,306.65
ASM INTERNATIONAL NV	16,045	376.70	6,044,151.50
ASML HOLDING NV	144,384	640.80	92,521,267.20
INFINEON TECHNOLOGIES AG	461,063	35.70	16,462,254.41
STMICROELECTRONICS NV	247,489	42.63	10,551,693.51
LEG IMMOBILIEN SE	21,715	50.70	1,100,950.50
VONOVIA SE	243,159	17.32	4,211,513.88

ユーロ 小計	64,464,732		1,666,023,896.44 (260,699,419,314)
合計	405,642,238		2,625,881,399,370 (2,625,881,399,370)

(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	58,549	6,386,524.92	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	123,849	4,176,188.28	
		AMERICAN TOWER CORP	166,549	30,983,110.47	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	50,716	9,198,360.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	49,858	2,567,687.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	39,024	4,131,080.64	
		CROWN CASTLE INC	157,148	17,198,277.12	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	104,868	10,922,002.20	
		EQUINIX INC	33,078	24,679,826.58	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	67,474	4,404,027.98	
		EQUITY RESIDENTIAL	132,621	8,270,245.56	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,085	5,299,181.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	49,518	7,029,575.28	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	96,691	4,565,749.02	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	140,933	2,555,115.29	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	205,056	3,951,429.12	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	267,777	4,348,698.48	
		INVITATION HOMES INC	222,743	7,292,605.82	
		IRON MOUNTAIN INC	106,039	5,722,924.83	
		KIMCO REALTY CORP	235,990	4,346,935.80	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	43,604	6,350,486.56	
		PROLOGIS INC	329,588	38,528,837.20	
		PUBLIC STORAGE	55,625	15,774,137.50	
REALTY INCOME CORP	233,241	13,705,241.16			
REGENCY CENTERS CORP	55,581	3,223,698.00			
SBA COMMUNICATIONS CORP	39,725	8,861,853.00			

		SIMON PROPERTY GROUP INC	117,661	12,676,796.14	
		SUN COMMUNITIES INC	43,591	5,454,541.83	
		UDR INC	113,375	4,561,076.25	
		VENTAS INC	137,514	6,115,247.58	
		VICI PROPERTIES INC	366,959	11,239,954.17	
		WELLTOWER INC	177,395	13,531,690.60	
		WEYERHAEUSER CO	265,250	8,066,252.50	
		WP CAREY INC	76,740	5,087,094.60	
アメリカドル合計			4,388,415	321,206,454.10	(46,089,914,098)
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,300	1,113,507.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,077,654.00	
カナダドル合計			81,900	2,191,161.00	(238,726,990)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	413,611	3,172,396.37	
		GOODMAN GROUP	587,247	11,527,658.61	
		GPT GROUP	656,296	2,638,309.92	
		MIRVAC GROUP	1,521,680	3,347,696.00	
		SCENTRE GROUP	1,734,337	4,335,842.50	
		STOCKLAND	815,965	3,272,019.65	
		VICINITY CENTRES	1,315,193	2,354,195.47	
オーストラリアドル合計			7,044,329	30,648,118.52	(2,935,170,310)
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	317,051	943,226.72	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	250,833	1,403,661.46	
		SEGRO PLC	403,906	2,841,882.61	
イギリスポンド合計			971,790	5,188,770.79	(947,936,535)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	865,200	38,155,320.00	
香港ドル合計			865,200	38,155,320.00	(699,005,462)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,134,200	3,028,314.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,879,771	3,590,362.61	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,470,700	2,397,241.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	764,700	1,231,167.00	
シンガポールドル合計			5,249,371	10,247,084.61	

				(1,088,137,914)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	13,302	571,453.92
		GECINA SA	16,340	1,533,509.00
		KLEPIERRE	71,486	1,557,679.94
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	47,386	2,160,801.60
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,808	1,265,119.20
ユーロ合計		199,322	7,088,563.66 (1,109,218,441)	
合計				53,108,109,750 (53,108,109,750)

(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 605 銘柄	97.68%	—	72.31%
	投資証券 34 銘柄	—	2.32%	1.72%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.74%	—	3.37%
	投資証券 2 銘柄	—	0.26%	0.01%
オーストラリアドル	株式 52 銘柄	94.94%	—	2.06%
	投資証券 7 銘柄	—	5.06%	0.11%
イギリスポンド	株式 79 銘柄	99.19%	—	4.33%
	投資証券 3 銘柄	—	0.81%	0.04%
スイスフラン	株式 44 銘柄	100.00%	—	2.98%
香港ドル	株式 28 銘柄	96.36%	—	0.69%
	投資証券 1 銘柄	—	3.64%	0.03%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	88.94%	—	0.33%
	投資証券 4 銘柄	—	11.06%	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 46 銘柄	100.00%	—	0.95%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.00%	—	0.18%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.00%	—	0.90%
イスラエルシェケル	株式 9 銘柄	100.00%	—	0.12%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.58%	—	9.73%
	投資証券 5 銘柄	—	0.42%	0.04%

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。

国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年6月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	722,447,313
国債証券	185,399,631,920
地方債証券	15,959,410,180
特殊債券	12,675,852,802
社債券	16,432,662,000
派生商品評価勘定	1,938,130
未収入金	544,876,100
未収利息	262,890,383
前払費用	46,446,564
差入委託証拠金	3,540,000
流動資産合計	232,049,695,392
資産合計	232,049,695,392
負債の部	
流動負債	
前受金	1,480,000
未払解約金	106,880,486
未払利息	1,815
流動負債合計	108,362,301
負債合計	108,362,301
純資産の部	
元本等	
元本	242,658,034,853
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△10,716,701,762
元本等合計	231,941,333,091
純資産合計	231,941,333,091
負債純資産合計	232,049,695,392

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)

	[2023年6月26日現在]
1. 期首	2022年6月28日
期首元本額	243,420,896,392円
期中追加設定元本額	441,366,400,848円
期中一部解約元本額	442,129,262,387円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー(国内債券)	23,301,004,784円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	31,446,440,263円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	348,310,713円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	50,659,099円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	116,545,571円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	8,155,516,858円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	2,129,814,754円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	240,725,529円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	8,522,706,348円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	5,708,671,643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)	23,671,092,870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)	7,352,784,702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)	18,350,727,714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)	2,005,720,024円
MUKAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	898,107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)	110,620,161,068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)	636,254,806円
合計	242,658,034,853円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	10,716,701,762円
3. 受益権の総数	242,658,034,853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2022年6月28日 至2023年6月26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	[2023年 6月 26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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
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	[2023年 6月 26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	945,165,240
地方債証券	28,737,170
特殊債券	58,683,612
社債券	47,142,700
合計	1,079,728,722

(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

[2023年 6月 26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	296,080,000	—	298,020,000	1,940,000
合計		296,080,000	—	298,020,000	1,940,000

(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)

	[2023年6月26日現在]
1口当たり純資産額	0.9558円
(1万口当たり純資産額)	(9,558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438回利付国債(2年)	400,000,000	400,648,000	
	第439回利付国債(2年)	500,000,000	500,850,000	
	第440回利付国債(2年)	400,000,000	400,708,000	
	第441回利付国債(2年)	720,000,000	721,317,600	
	第442回利付国債(2年)	1,900,000,000	1,903,705,000	
	第443回利付国債(2年)	850,000,000	851,581,000	
	第445回利付国債(2年)	1,420,000,000	1,422,499,200	
	第446回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,222,147,200	
	第447回利付国債(2年)	800,000,000	801,408,000	
	第448回利付国債(2年)	550,000,000	551,061,500	
	第141回利付国債(5年)	460,000,000	461,334,000	
	第142回利付国債(5年)	503,000,000	504,604,570	
	第143回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,806,228,000	
	第144回利付国債(5年)	3,670,000,000	3,684,166,200	
	第145回利付国債(5年)	780,000,000	783,400,800	
	第146回利付国債(5年)	2,670,000,000	2,682,602,400	
	第147回利付国債(5年)	2,640,000,000	2,646,124,800	
	第148回利付国債(5年)	2,050,000,000	2,054,592,000	
	第149回利付国債(5年)	2,790,000,000	2,795,859,000	
	第150回利付国債(5年)	540,000,000	541,031,400	
	第151回利付国債(5年)	510,000,000	510,856,800	
	第152回利付国債(5年)	1,940,000,000	1,950,126,800	

第1 5 3 回利付国債（5年）	2,010,000,000	2,012,391,900	
第1 5 4 回利付国債（5年）	3,020,000,000	3,033,408,800	
第1 5 5 回利付国債（5年）	70,000,000	70,893,200	
第1 5 6 回利付国債（5年）	2,410,000,000	2,429,424,600	
第1 5 7 回利付国債（5年）	80,000,000	80,604,000	
第1 5 8 回利付国債（5年）	3,400,000,000	3,408,806,000	
第1 回利付国債（40年）	740,000,000	949,161,000	
第2 回利付国債（40年）	370,000,000	456,650,300	
第3 回利付国債（40年）	600,000,000	740,916,000	
第4 回利付国債（40年）	350,000,000	432,722,500	
第5 回利付国債（40年）	540,000,000	643,982,400	
第6 回利付国債（40年）	271,000,000	318,143,160	
第7 回利付国債（40年）	450,000,000	505,620,000	
第8 回利付国債（40年）	460,000,000	481,137,000	
第9 回利付国債（40年）	910,000,000	705,750,500	
第1 0 回利付国債（40年）	820,000,000	743,084,000	
第1 1 回利付国債（40年）	670,000,000	585,640,300	
第1 2 回利付国債（40年）	631,000,000	493,397,830	
第1 3 回利付国債（40年）	840,000,000	651,092,400	
第1 4 回利付国債（40年）	900,000,000	743,544,000	
第1 5 回利付国債（40年）	980,000,000	887,125,400	
第1 6 回利付国債（40年）	260,000,000	256,968,400	
第3 3 5 回利付国債（10年）	370,000,000	372,900,800	
第3 3 6 回利付国債（10年）	600,000,000	605,478,000	
第3 3 8 回利付国債（10年）	400,000,000	403,460,000	
第3 3 9 回利付国債（10年）	230,000,000	232,258,600	
第3 4 0 回利付国債（10年）	750,000,000	758,302,500	
第3 4 1 回利付国債（10年）	300,000,000	302,910,000	
第3 4 2 回利付国債（10年）	110,000,000	110,541,200	
第3 4 3 回利付国債（10年）	540,000,000	542,737,800	
第3 4 4 回利付国債（10年）	770,000,000	773,988,600	
第3 4 5 回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,357,060,500	
第3 4 6 回利付国債（10年）	300,000,000	301,566,000	
第3 4 7 回利付国債（10年）	940,000,000	944,681,200	
第3 4 9 回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,204,560,000	
第3 5 0 回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,604,528,000	

第351回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,353,348,000	
第352回利付国債（10年）	1,630,000,000	1,633,390,400	
第353回利付国債（10年）	483,000,000	483,787,290	
第354回利付国債（10年）	2,160,000,000	2,162,462,400	
第355回利付国債（10年）	1,880,000,000	1,881,109,200	
第356回利付国債（10年）	1,050,000,000	1,050,000,000	
第357回利付国債（10年）	2,360,000,000	2,358,466,000	
第358回利付国債（10年）	300,000,000	299,499,000	
第359回利付国債（10年）	2,210,000,000	2,203,878,300	
第360回利付国債（10年）	1,160,000,000	1,155,012,000	
第361回利付国債（10年）	2,940,000,000	2,922,624,600	
第362回利付国債（10年）	1,750,000,000	1,736,017,500	
第363回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,267,535,100	
第364回利付国債（10年）	2,190,000,000	2,164,355,100	
第365回利付国債（10年）	1,740,000,000	1,716,892,800	
第366回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,649,376,000	
第367回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,160,780,400	
第368回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,485,855,000	
第369回利付国債（10年）	2,250,000,000	2,286,202,500	
第370回利付国債（10年）	940,000,000	953,263,400	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	57,750,500	
第7回利付国債（30年）	50,000,000	58,868,500	
第10回利付国債（30年）	50,000,000	53,578,500	
第12回利付国債（30年）	470,000,000	550,167,900	
第14回利付国債（30年）	190,000,000	229,090,600	
第15回利付国債（30年）	100,000,000	121,961,000	
第16回利付国債（30年）	520,000,000	635,336,000	
第17回利付国債（30年）	250,000,000	303,390,000	
第18回利付国債（30年）	280,000,000	337,332,800	
第19回利付国債（30年）	230,000,000	277,580,100	
第20回利付国債（30年）	500,000,000	616,695,000	
第21回利付国債（30年）	250,000,000	302,870,000	
第22回利付国債（30年）	650,000,000	804,609,000	
第23回利付国債（30年）	650,000,000	806,006,500	
第24回利付国債（30年）	380,000,000	472,275,400	
第25回利付国債（30年）	770,000,000	938,537,600	

第26回利付国債（30年）	860,000,000	1,060,380,000	
第27回利付国債（30年）	450,000,000	562,482,000	
第28回利付国債（30年）	570,000,000	714,626,100	
第29回利付国債（30年）	270,000,000	335,488,500	
第30回利付国債（30年）	910,000,000	1,117,880,400	
第31回利付国債（30年）	770,000,000	935,627,000	
第32回利付国債（30年）	590,000,000	727,546,700	
第33回利付国債（30年）	600,000,000	711,738,000	
第34回利付国債（30年）	1,000,000,000	1,218,310,000	
第35回利付国債（30年）	1,180,000,000	1,399,739,600	
第36回利付国債（30年）	920,000,000	1,092,702,400	
第37回利付国債（30年）	650,000,000	760,929,000	
第38回利付国債（30年）	410,000,000	472,611,100	
第39回利付国債（30年）	590,000,000	691,084,700	
第40回利付国債（30年）	351,000,000	404,720,550	
第41回利付国債（30年）	440,000,000	499,144,800	
第42回利付国債（30年）	600,000,000	680,880,000	
第43回利付国債（30年）	510,000,000	578,936,700	
第44回利付国債（30年）	490,000,000	556,404,800	
第45回利付国債（30年）	550,000,000	602,893,500	
第46回利付国債（30年）	650,000,000	712,458,500	
第47回利付国債（30年）	470,000,000	524,120,500	
第48回利付国債（30年）	796,000,000	855,469,160	
第49回利付国債（30年）	580,000,000	623,152,000	
第50回利付国債（30年）	620,000,000	590,469,400	
第51回利付国債（30年）	650,000,000	551,577,000	
第52回利付国債（30年）	710,000,000	630,004,300	
第53回利付国債（30年）	590,000,000	534,445,600	
第54回利付国債（30年）	520,000,000	491,566,400	
第55回利付国債（30年）	680,000,000	641,287,600	
第56回利付国債（30年）	440,000,000	413,952,000	
第57回利付国債（30年）	560,000,000	525,565,600	
第58回利付国債（30年）	230,000,000	215,328,300	
第59回利付国債（30年）	620,000,000	565,303,600	
第60回利付国債（30年）	480,000,000	456,974,400	
第61回利付国債（30年）	568,000,000	513,579,920	

第62回利付国債（30年）	280,000,000	239,817,200	
第63回利付国債（30年）	560,000,000	465,276,000	
第64回利付国債（30年）	490,000,000	405,715,100	
第65回利付国債（30年）	570,000,000	471,258,900	
第66回利付国債（30年）	100,000,000	82,228,000	
第67回利付国債（30年）	590,000,000	510,562,400	
第68回利付国債（30年）	760,000,000	655,636,800	
第69回利付国債（30年）	540,000,000	477,781,200	
第70回利付国債（30年）	810,000,000	715,311,000	
第71回利付国債（30年）	580,000,000	511,217,800	
第72回利付国債（30年）	660,000,000	580,608,600	
第73回利付国債（30年）	650,000,000	571,304,500	
第74回利付国債（30年）	410,000,000	389,565,600	
第75回利付国債（30年）	730,000,000	746,498,000	
第76回利付国債（30年）	500,000,000	523,905,000	
第77回利付国債（30年）	540,000,000	592,844,400	
第78回利付国債（30年）	700,000,000	733,887,000	
第72回利付国債（20年）	100,000,000	102,760,000	
第75回利付国債（20年）	100,000,000	103,809,000	
第77回利付国債（20年）	150,000,000	155,454,000	
第78回利付国債（20年）	100,000,000	103,959,000	
第80回利付国債（20年）	100,000,000	104,356,000	
第81回利付国債（20年）	100,000,000	104,687,000	
第83回利付国債（20年）	200,000,000	210,896,000	
第84回利付国債（20年）	200,000,000	210,398,000	
第86回利付国債（20年）	140,000,000	149,111,200	
第89回利付国債（20年）	200,000,000	213,560,000	
第90回利付国債（20年）	300,000,000	321,960,000	
第92回利付国債（20年）	700,000,000	752,493,000	
第93回利付国債（20年）	50,000,000	53,809,000	
第94回利付国債（20年）	60,000,000	64,794,600	
第95回利付国債（20年）	400,000,000	437,056,000	
第96回利付国債（20年）	100,000,000	108,467,000	
第97回利付国債（20年）	100,000,000	109,335,000	
第98回利付国債（20年）	200,000,000	217,824,000	
第99回利付国債（20年）	300,000,000	328,017,000	

第100回利付国債（20年）	650,000,000	716,430,000	
第102回利付国債（20年）	200,000,000	223,406,000	
第103回利付国債（20年）	200,000,000	222,412,000	
第105回利付国債（20年）	220,000,000	243,474,000	
第106回利付国債（20年）	140,000,000	155,668,800	
第107回利付国債（20年）	250,000,000	277,790,000	
第108回利付国債（20年）	300,000,000	330,072,000	
第109回利付国債（20年）	300,000,000	331,230,000	
第110回利付国債（20年）	100,000,000	111,551,000	
第111回利付国債（20年）	40,000,000	45,034,000	
第112回利付国債（20年）	500,000,000	559,950,000	
第113回利付国債（20年）	620,000,000	697,022,600	
第114回利付国債（20年）	100,000,000	112,844,000	
第115回利付国債（20年）	100,000,000	113,488,000	
第116回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,196,170,500	
第117回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,200,492,400	
第118回利付国債（20年）	350,000,000	395,276,000	
第119回利付国債（20年）	100,000,000	111,553,000	
第120回利付国債（20年）	250,000,000	275,422,500	
第121回利付国債（20年）	610,000,000	686,378,100	
第122回利付国債（20年）	160,000,000	178,889,600	
第123回利付国債（20年）	180,000,000	205,666,200	
第124回利付国債（20年）	400,000,000	454,080,000	
第125回利付国債（20年）	510,000,000	587,856,600	
第126回利付国債（20年）	110,000,000	125,117,300	
第127回利付国債（20年）	40,000,000	45,192,400	
第128回利付国債（20年）	190,000,000	215,203,500	
第129回利付国債（20年）	490,000,000	551,152,000	
第130回利付国債（20年）	180,000,000	202,833,000	
第131回利付国債（20年）	540,000,000	604,135,800	
第132回利付国債（20年）	290,000,000	325,061,000	
第133回利付国債（20年）	702,000,000	792,705,420	
第134回利付国債（20年）	610,000,000	690,178,400	
第135回利付国債（20年）	100,000,000	112,290,000	
第136回利付国債（20年）	100,000,000	111,436,000	
第137回利付国債（20年）	780,000,000	877,414,200	

第138回利付国債（20年）	70,000,000	77,515,200	
第139回利付国債（20年）	380,000,000	424,125,600	
第140回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,453,546,200	
第141回利付国債（20年）	370,000,000	417,371,100	
第142回利付国債（20年）	710,000,000	807,447,500	
第143回利付国債（20年）	1,080,000,000	1,208,714,400	
第144回利付国債（20年）	530,000,000	588,172,800	
第145回利付国債（20年）	924,000,000	1,043,787,360	
第146回利付国債（20年）	740,000,000	836,621,800	
第147回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,255,833,600	
第148回利付国債（20年）	660,000,000	733,550,400	
第149回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,312,384,200	
第150回利付国債（20年）	740,000,000	815,161,800	
第151回利付国債（20年）	970,000,000	1,047,134,400	
第152回利付国債（20年）	780,000,000	841,885,200	
第153回利付国債（20年）	950,000,000	1,036,488,000	
第154回利付国債（20年）	390,000,000	420,985,500	
第155回利付国債（20年）	880,000,000	928,417,600	
第156回利付国債（20年）	582,000,000	570,592,800	
第157回利付国債（20年）	560,000,000	533,663,200	
第158回利付国債（20年）	920,000,000	909,272,800	
第159回利付国債（20年）	220,000,000	219,725,000	
第160回利付国債（20年）	320,000,000	323,033,600	
第161回利付国債（20年）	1,040,000,000	1,033,988,800	
第162回利付国債（20年）	800,000,000	793,752,000	
第163回利付国債（20年）	870,000,000	861,387,000	
第164回利付国債（20年）	874,000,000	851,223,560	
第165回利付国債（20年）	840,000,000	815,556,000	
第166回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,027,167,500	
第167回利付国債（20年）	750,000,000	723,990,000	
第168回利付国債（20年）	250,000,000	236,855,000	
第169回利付国債（20年）	640,000,000	594,656,000	
第170回利付国債（20年）	470,000,000	435,295,200	
第171回利付国債（20年）	790,000,000	729,288,500	
第172回利付国債（20年）	600,000,000	561,684,000	
第173回利付国債（20年）	1,040,000,000	969,831,200	

	第174回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,208,428,000	
	第175回利付国債(20年)	580,000,000	546,603,600	
	第176回利付国債(20年)	560,000,000	526,153,600	
	第177回利付国債(20年)	980,000,000	902,070,400	
	第178回利付国債(20年)	400,000,000	373,768,000	
	第179回利付国債(20年)	930,000,000	866,927,400	
	第180回利付国債(20年)	630,000,000	618,414,300	
	第181回利付国債(20年)	850,000,000	847,246,000	
	第182回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,061,157,500	
	第183回利付国債(20年)	830,000,000	898,043,400	
	第184回利付国債(20年)	680,000,000	698,101,600	
国債証券 合計		180,355,000,000	185,399,631,920	
地方債証券	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,403,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,753,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	80,000,000	95,314,400	
	第9回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,078,000	
	第13回東京都公募公債(20年)	200,000,000	217,672,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,887,000	
	第749回東京都公募公債	1,000,000,000	1,009,050,000	
	第750回東京都公募公債	100,000,000	101,014,000	
	第753回東京都公募公債	150,000,000	150,085,500	
	第792回東京都公募公債	100,000,000	98,954,000	
	第1回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	120,804,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	400,000,000	431,656,000	
	第12回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,833,000	
	第26回神奈川県公募公債(20年)	20,000,000	21,717,600	
	第40回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	89,658,000	
	第209回神奈川県公募公債	200,000,000	201,334,000	
	第211回神奈川県公募公債	200,000,000	201,256,000	
	第11回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	110,513,000	
	第13回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	105,502,000	
	第171回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	199,852,000	
	第176回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	99,896,000	
	第182回大阪府公募公債(5年)	340,000,000	339,432,200	
	第187回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	199,492,000	
	第388回大阪府公募公債	200,000,000	201,332,000	

第391回大阪府公募公債	300,000,000	302,172,000	
第449回大阪府公募公債	400,000,000	393,076,000	
第451回大阪府公募公債	152,000,000	149,838,560	
第466回大阪府公募公債	137,000,000	134,692,920	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	94,610,000	
令和元年度第11回京都府公募公債(5年)	400,000,000	399,920,000	
第1回兵庫県公募公債(15年)	500,000,000	524,430,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	121,535,000	
第3回兵庫県公募公債(15年)	200,000,000	209,842,000	
第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	204,098,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	421,500,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,668,000	
第15回兵庫県公募公債(20年)	200,000,000	219,686,000	
第11回静岡県公募公債(20年)	200,000,000	221,562,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,950,000	
令和2年度第7回静岡県公募公債(5年)	200,000,000	199,964,000	
令和4年度第1回静岡県公募公債	300,000,000	294,930,000	
平成20年度第2回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	111,176,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	200,000,000	210,234,000	
平成26年度第4回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	109,288,000	
平成27年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	100,986,000	
平成26年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,695,000	
平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	100,094,000	
令和元年度第6回広島県公募公債(5年)	500,000,000	499,785,000	
平成26年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,497,000	
平成29年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	200,700,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	110,113,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	200,000,000	209,594,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	100,713,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	221,416,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,702,000	
第149回共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,085,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,070,000	
第162回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,580,000	
第167回共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,244,000	
第214回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,195,000	

	第222回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,378,000	
	第227回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,156,000	
	平成27年度第1回長崎県公募公債	200,000,000	202,170,000	
	平成28年度第2回島根県公募公債(20年)	100,000,000	96,717,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債	200,000,000	202,066,000	
	令和3年度第1回熊本県公募公債(5年)	200,000,000	199,658,000	
	令和3年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	97,369,000	
	平成27年度第1回新潟市公募公債	10,000,000	10,106,900	
	令和3年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	195,304,000	
	平成26年度第5回大阪市公募公債	200,000,000	201,464,000	
	第1回名古屋市長公募公債(15年)	200,000,000	209,874,000	
	第1回名古屋市長公募公債(30年)	100,000,000	120,486,000	
	第3回名古屋市長公募公債(20年)	100,000,000	103,967,000	
	第27回名古屋市長公募公債(5年)	200,000,000	199,958,000	
	第490回名古屋市長公募公債	120,000,000	120,951,600	
	平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	110,078,000	
	第22回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	222,120,000	
	平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	101,059,000	
	平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	112,001,000	
	平成26年度第5回札幌市公募公債	100,000,000	104,262,000	
	第6回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	111,481,000	
	第9回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	112,506,000	
	平成23年度第4回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	111,616,000	
	2021年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	97,472,000	
	平成30年度第3回千葉市公募公債	10,000,000	10,023,500	
	令和元年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	98,850,000	
	第148回福岡北九州高速道路債券(20年)	100,000,000	98,186,000	
地方債証券 合計		15,519,000,000	15,959,410,180	
特殊債券	第4回政府保証新関西国際空港債券	378,000,000	381,587,220	
	第37回政府保証日本政策投資銀行	260,000,000	260,314,600	
	第4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	121,134,000	
	第39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	110,896,000	
	第42回道路債券(財投機関債)	110,000,000	114,116,200	
	第50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	93,078,000	

第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	56,050,500	
第150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	104,469,000	
第156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	105,750,000	
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	113,722,000	
第221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225回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,650,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,684,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,115,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,545,000	
第259回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,363,000	
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	106,437,780	
第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,950,000	
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,303,000	
第372回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,946,000	
第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）	100,000,000	123,397,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	111,612,000	
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	110,576,000	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	111,084,000	
第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）	400,000,000	434,336,000	
第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	109,838,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,577,000	
第48回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	104,664,000	
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,324,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,936,000	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	504,645,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	13,000,000	13,117,130	
F89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,877,000	

第101回政府保証地方公共団体金融機構債券	118,000,000	118,317,420	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	122,000,000	122,247,660	
F149回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,714,000	
第17回政府保証民間都市開発債券	200,000,000	200,698,000	
第21回政府保証中部国際空港債券	204,000,000	205,583,040	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	36,906,000	36,936,262	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,832,000	33,497,450	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,482,000	19,340,304	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,338,000	54,585,917	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,233,000	57,410,284	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,144,000	34,193,670	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	105,834,000	110,198,594	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	90,068,800	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,414,000	96,194,934	
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,006,000	110,829,276	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,435,000	117,511,012	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,582,000	94,858,179	
第94回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	334,980,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,052,000	59,016,824	
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,244,000	124,275,863	
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	336,915,000	330,126,162	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	209,934,000	207,446,282	
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,020,000	70,000,863	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,836,000	143,794,296	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,378,000	146,962,557	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,505,000	75,156,981	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,440,000	76,304,729	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,306,000	78,266,227	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	330,444,000	317,718,601	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	339,656,000	330,773,995	
第156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,596,000	167,098,468	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,600,000	87,213,952	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,491,000	89,168,958	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,489,000	89,619,066	

第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,306,000	91,350,449	
第177回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	202,100,000	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,256,000	92,562,219	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,924,000	92,988,499	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,785,000	94,217,957	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,039,000	102,358,787	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,986,000	203,540,789	
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,903,000	102,945,046	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,370,000	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,691,000	
い第832号商工債券	100,000,000	99,950,000	
い第853号商工債券	100,000,000	99,699,000	
い第854号商工債券	100,000,000	99,662,000	
い第862号商工債券	200,000,000	199,666,000	
い第863号商工債券	200,000,000	199,850,000	
第11号商工債券（10年）	100,000,000	100,710,000	
第268号商工債券（3年）	100,000,000	99,963,000	
第84回中日本高速道路	100,000,000	99,960,000	
第85回中日本高速道路	300,000,000	299,826,000	
第25回西日本高速道路	100,000,000	100,674,000	
第26回西日本高速道路	100,000,000	100,996,000	
第30回西日本高速道路	130,000,000	130,130,000	
第65回西日本高速道路	300,000,000	299,271,000	
特殊債券 合計	12,438,311,000	12,675,852,802	
社債券			
第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	101,009,000	
第29回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,742,000	
第35回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	98,741,000	
第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	200,016,000	
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,565,000	
第4回フランス預金供託公庫	100,000,000	100,591,000	
第1回サンタンデル銀行（2019）	100,000,000	99,420,000	
第12回新関西国際空港	100,000,000	104,146,000	
第21回新関西国際空港	100,000,000	91,934,000	
第24回成田国際空港	100,000,000	99,912,000	
第27回成田国際空港	200,000,000	191,220,000	

第48回鹿島建設（サステナビリティ）	400,000,000	403,800,000	
第13回麒麟ホールディングス	100,000,000	98,411,000	
第9回サントリーホールディングス	100,000,000	100,189,000	
第2回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	200,000,000	199,576,000	
第5回サントリー食品インターナショナル	100,000,000	99,916,000	
第3回 キュービー	100,000,000	100,093,000	
第13回日本たばこ産業	100,000,000	99,872,000	
第10回東急不動産ホールディングス	100,000,000	100,350,000	
第14回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	99,986,000	
第9回クラレ	100,000,000	99,972,000	
第16回旭化成	100,000,000	99,820,000	
第13回イビデン	300,000,000	300,120,000	
第46回三井化学	200,000,000	199,670,000	
第56回三井化学	100,000,000	100,121,000	
第5回電通グループ	200,000,000	199,872,000	
第19回オリエンタルランド	100,000,000	99,915,000	
第13回ヤフー	100,000,000	96,819,000	
第19回Zホールディングス	100,000,000	99,116,000	
第20回Zホールディングス（グリーン）	100,000,000	97,727,000	
第22回Zホールディングス	100,000,000	99,916,000	
第11回ブリヂストン	200,000,000	199,906,000	
第4回新日本製鐵	100,000,000	100,146,000	
第9回新日本製鐵	100,000,000	99,593,000	
第28回ジェイ エフ イー ホールディングス	200,000,000	200,040,000	
第14回LIXIL	100,000,000	100,099,000	
第30回ダイキン工業	100,000,000	99,671,000	
第7回ジェイテクト	100,000,000	99,064,000	
第17回パナソニック	200,000,000	200,950,000	
第18回パナソニック	200,000,000	199,604,000	
第36回三菱重工業（グリーン）	300,000,000	299,604,000	
第31回トヨタ自動車（サステナビリティ）	100,000,000	100,749,000	
第18回アイシン精機	100,000,000	99,872,000	
第4回ヤマハ発動機	100,000,000	100,186,000	
第1回明治安田生命2018基金	200,000,000	199,968,000	
第1回明治安田生命2019基金	100,000,000	99,920,000	

第114回丸紅	200,000,000	201,734,000	
第63回三井物産	100,000,000	107,848,000	
第61回住友商事	100,000,000	100,868,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	100,069,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	98,377,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	100,000,000	102,987,000	
第33回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	200,000,000	208,764,000	
第36回芙蓉総合リース	100,000,000	100,064,000	
第7回みずほリース	200,000,000	199,016,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	299,958,000	
第38回東京センチュリー	200,000,000	201,404,000	
第70回ホンダファイナンス	100,000,000	99,850,000	
第72回ホンダファイナンス	100,000,000	99,819,000	
第78回トヨタファイナンス	300,000,000	300,243,000	
第79回アコム	100,000,000	99,929,000	
第80回アコム	100,000,000	99,382,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	100,000,000	100,414,000	
第1回三菱HCキャピタル	200,000,000	199,566,000	
第3回野村ホールディングス	100,000,000	98,885,000	
第83回三井不動産（グリーン）	100,000,000	100,890,000	
第118回三菱地所	100,000,000	100,053,000	
第137回三菱地所	100,000,000	99,826,000	
第107回住友不動産	200,000,000	199,772,000	
第111回住友不動産（グリーン）	100,000,000	100,431,000	
第78回東京急行電鉄	100,000,000	105,364,000	
第57回東日本旅客鉄道	100,000,000	110,532,000	
第147回東日本旅客鉄道	100,000,000	98,269,000	
第184回東日本旅客鉄道	100,000,000	100,034,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	108,860,000	
第68回東海旅客鉄道	100,000,000	107,438,000	
第73回東海旅客鉄道	100,000,000	101,200,000	
第13回東京地下鉄	100,000,000	108,857,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	100,000,000	99,564,000	
第9回九州旅客鉄道	100,000,000	99,751,000	
第31回KDDI（サステナビリティ）	100,000,000	100,254,000	
第7回ソフトバンク	100,000,000	96,917,000	

第9回ソフトバンク	200,000,000	197,638,000	
第13回ソフトバンク	100,000,000	95,245,000	
第15回ソフトバンク	100,000,000	97,685,000	
第503回中部電力	10,000,000	10,072,000	
第496回関西電力	100,000,000	101,116,000	
第522回関西電力	300,000,000	299,313,000	
第554回関西電力	200,000,000	200,530,000	
第389回中国電力	300,000,000	300,168,000	
第420回中国電力	200,000,000	195,560,000	
第433回中国電力	100,000,000	99,705,000	
第448回中国電力	100,000,000	100,598,000	
第337回北陸電力	200,000,000	195,594,000	
第513回東北電力	100,000,000	98,148,000	
第525回東北電力	100,000,000	99,202,000	
第545回東北電力	200,000,000	200,164,000	
第552回東北電力	100,000,000	101,784,000	
第476回九州電力	100,000,000	99,313,000	
第484回九州電力	100,000,000	98,597,000	
第493回九州電力	200,000,000	198,698,000	
第511回九州電力	300,000,000	301,614,000	
第325回北海道電力	100,000,000	103,897,000	
第345回北海道電力	200,000,000	200,350,000	
第357回北海道電力	100,000,000	99,457,000	
第358回北海道電力	200,000,000	196,178,000	
第84回電源開発	100,000,000	101,501,000	
第85回電源開発	100,000,000	101,699,000	
第86回電源開発	100,000,000	100,602,000	
第6回東京電力パワーグリッド	300,000,000	302,004,000	
第34回東京電力パワーグリッド	300,000,000	301,614,000	
第45回東京電力パワーグリッド	100,000,000	98,188,000	
第49回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,646,000	
第50回東京電力パワーグリッド	100,000,000	98,593,000	
第16回JERA	100,000,000	100,736,000	
第17回JERA	100,000,000	101,547,000	
第1回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	200,000,000	199,562,000	
第13回広島ガス	100,000,000	99,226,000	

社債券 合計	16,410,000,000	16,432,662,000	
合計	224,722,311,000	230,467,556,902	

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)

[2023年6月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,662,857,630
コール・ローン	1,679,274,887
国債証券	458,062,779,356
派生商品評価勘定	49,092,957
未収入金	1,700,304
未収利息	2,880,530,443
前払費用	354,092,202
流動資産合計	465,690,327,779
資産合計	465,690,327,779
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,352
未払金	243,393
未払解約金	209,131,611
未払利息	4,220
流動負債合計	209,410,576
負債合計	209,410,576
純資産の部	
元本等	
元本	188,907,060,645
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	276,573,856,558
元本等合計	465,480,917,203
純資産合計	465,480,917,203
負債純資産合計	465,690,327,779

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	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

方法	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)

	[2023年6月26日現在]
1. 期首	2022年6月28日
期首元本額	134,553,435,896円
期中追加設定元本額	89,300,349,341円
期中一部解約元本額	34,946,724,592円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	285,722,534円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	622,248,064円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	383,830,766円
三菱UFJ 外国債券オープン	931,592,993円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,204,192,471円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,079,155,537円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,489,962,147円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	552,535,922円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	99,674,408円
ファンド・マネジャー(海外債券)	1,012,928,506円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,790,237,059円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,342,350,351円
eMAXIS バランス(波乗り型)	228,041,042円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	958,679,837円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	397,371,534円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	211,940,405円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	136,774,259円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	29,966,453,006円
海外債券セレクション(ラップ向け)	5,518,769,551円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	10,537,532,578円
つみたて8資産均等バランス	5,025,309,408円
つみたて4資産均等バランス	1,742,921,810円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,929,803円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,980,030円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	465,015円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	206,562,593円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	134,931,065円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	72,016,676円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	633,965,665円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,043,875,638円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,425,195,620円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	1,764,112,573円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	59,643,306円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	156,754,372円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	24,858,531円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,516,128,135円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	12,059,596円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3,628,136,282円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	38,734,454円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	27,841,197円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	62,872,158円
三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金)	3,017,578,315円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	18,016,070,491円
ワールド・インカムオープン	1,041,318,595円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	14,860,913,596円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	428,409,935円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	1,915,977,864円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	724,411,028円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	504,983,953円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	266,560,833円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	294,598,620円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	154,784,072円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	61,291,900円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,162,275,878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)	8,698円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	10,811,300円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	532,640,310円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	11,694,025円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,676,855,524円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,236,756,973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)	39,773,790,523円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	500,033,117円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	397,987円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	101,216円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	1,402,974,236円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	68,735,356円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	114,207,191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)	598,526,410円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	28,918,026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)	2,793,448,426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)	404,404,642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)	728,814,181円
海外債券インデックスファンドS	2,015,309,986円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,693,359円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	3,045,608円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	692,779円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	877,531円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	5,012,319円

三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,729,494円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	9,664,689円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	4,072,355円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	13,757,964円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,755,132,014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)	204,007,476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)	575,996,632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)	463,607,903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)	185,880,418円
合計	188,907,060,645円
2. 受益権の総数	188,907,060,645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 2022年 6月 28日 至 2023年 6月 26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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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	[2023年 6月 26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	[2023年6月26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△6,869,512,160
合計		△6,869,512,160

(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

[2023年6月26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	1,395,853,400	—	1,444,175,680	48,322,280
	オフショア元	41,962,938	—	42,733,615	770,677
	ユーロ	21,935,450	—	21,904,098	△31,352
合計		1,459,751,788	—	1,508,813,393	49,061,605

(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)

	[2023年6月26日現在]
1口当たり純資産額	2.4641円
(1万口当たり純資産額)	(24,641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 240615	7,100,000.00	6,762,791.89	
		0.25 T-NOTE 250531	5,000,000.00	4,588,281.25	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,090,464.87	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,294,652.32	
		0.25 T-NOTE 250831	4,200,000.00	3,823,230.47	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	6,905,460.92	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,328,138.65	
		0.375 T-NOTE 240715	6,200,000.00	5,891,512.67	
		0.375 T-NOTE 240815	7,200,000.00	6,817,078.15	
		0.375 T-NOTE 240915	12,000,000.00	11,321,953.08	
		0.375 T-NOTE 250430	4,670,000.00	4,308,166.20	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,195,067.39	
		0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,688,349.61	
		0.375 T-NOTE 260131	7,700,000.00	6,937,519.51	
		0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,147,882.81	
		0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,245,634.79	
		0.5 T-NOTE 250331	6,500,000.00	6,026,718.75	
		0.5 T-NOTE 260228	7,900,000.00	7,124,040.98	
		0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,598,859.35	
		0.5 T-NOTE 270531	4,280,000.00	3,718,333.58	
		0.5 T-NOTE 270630	4,700,000.00	4,073,302.75	
		0.5 T-NOTE 270831	4,950,000.00	4,269,084.97	
		0.5 T-NOTE 271031	7,900,000.00	6,779,033.21	
		0.625 T-NOTE 241015	7,400,000.00	6,981,292.97	
		0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,093,632.81	
		0.625 T-NOTE 270331	1,800,000.00	1,579,500.00	
		0.625 T-NOTE 271130	7,550,000.00	6,499,488.31	
		0.625 T-NOTE 271231	7,630,000.00	6,554,646.87	
		0.625 T-NOTE 300515	12,090,000.00	9,748,034.73	
		0.625 T-NOTE 300815	15,160,000.00	12,151,687.50	
0.75 T-NOTE 241115	6,700,000.00	6,311,347.67			

0.75 T-NOTE 260331	8,100,000.00	7,349,484.37	
0.75 T-NOTE 260430	9,200,000.00	8,317,734.35	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,395,375.00	
0.75 T-NOTE 260831	7,600,000.00	6,808,382.78	
0.75 T-NOTE 280131	8,850,000.00	7,632,606.47	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,509,392.54	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	8,985,351.60	
0.875 T-NOTE 301115	17,730,000.00	14,443,024.30	
1 T-NOTE 241215	8,000,000.00	7,543,124.96	
1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	7,887,943.33	
1.125 T-BOND 400515	6,020,000.00	3,931,459.78	
1.125 T-BOND 400815	7,350,000.00	4,761,852.51	
1.125 T-NOTE 250115	6,000,000.00	5,654,062.50	
1.125 T-NOTE 250228	4,150,000.00	3,898,892.58	
1.125 T-NOTE 261031	7,600,000.00	6,865,382.78	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,645,723.63	
1.125 T-NOTE 280229	8,660,000.00	7,587,141.00	
1.125 T-NOTE 280831	8,500,000.00	7,362,460.98	
1.125 T-NOTE 310215	14,760,000.00	12,226,584.44	
1.25 T-BOND 500515	8,900,000.00	5,030,412.07	
1.25 T-NOTE 261130	7,200,000.00	6,518,250.00	
1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,414,914.04	
1.25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,753,084.94	
1.25 T-NOTE 280430	8,150,000.00	7,156,241.24	
1.25 T-NOTE 280531	11,250,000.00	9,860,888.70	
1.25 T-NOTE 280630	8,480,000.00	7,420,993.77	
1.25 T-NOTE 280930	12,200,000.00	10,617,812.50	
1.25 T-NOTE 310815	17,720,000.00	14,632,151.60	
1.375 T-BOND 401115	8,800,000.00	5,932,093.72	
1.375 T-BOND 500815	10,130,000.00	5,913,783.17	
1.375 T-NOTE 250131	5,320,000.00	5,028,646.90	
1.375 T-NOTE 260831	3,800,000.00	3,472,324.21	
1.375 T-NOTE 281031	8,250,000.00	7,216,171.87	
1.375 T-NOTE 281231	8,700,000.00	7,587,351.60	
1.375 T-NOTE 311115	16,700,000.00	13,854,150.32	
1.5 T-NOTE 240930	6,000,000.00	5,731,875.00	

1.5 T-NOTE 241031	4,100,000.00	3,907,732.42	
1.5 T-NOTE 241130	6,430,000.00	6,116,663.07	
1.5 T-NOTE 250215	6,300,000.00	5,958,421.87	
1.5 T-NOTE 260815	9,740,000.00	8,944,820.36	
1.5 T-NOTE 270131	11,540,000.00	10,504,555.49	
1.5 T-NOTE 281130	7,650,000.00	6,727,965.84	
1.5 T-NOTE 300215	8,740,000.00	7,535,860.13	
1.625 T-BOND 501115	10,140,000.00	6,325,221.06	
1.625 T-NOTE 260215	9,760,000.00	9,080,993.77	
1.625 T-NOTE 260515	7,670,000.00	7,102,839.47	
1.625 T-NOTE 260930	2,100,000.00	1,932,082.02	
1.625 T-NOTE 261031	3,350,000.00	3,077,747.07	
1.625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,118,769.54	
1.625 T-NOTE 290815	7,050,000.00	6,183,345.68	
1.625 T-NOTE 310515	15,460,000.00	13,221,319.49	
1.75 T-BOND 410815	11,370,000.00	8,045,385.39	
1.75 T-NOTE 240630	3,500,000.00	3,377,802.29	
1.75 T-NOTE 240731	5,150,000.00	4,959,188.48	
1.75 T-NOTE 241231	3,350,000.00	3,191,529.28	
1.75 T-NOTE 250315	9,030,000.00	8,564,743.33	
1.75 T-NOTE 261231	4,300,000.00	3,957,595.68	
1.75 T-NOTE 290131	7,300,000.00	6,490,013.68	
1.75 T-NOTE 291115	5,150,000.00	4,543,265.62	
1.875 T-BOND 410215	10,100,000.00	7,387,203.12	
1.875 T-BOND 510215	11,310,000.00	7,522,254.52	
1.875 T-BOND 511115	10,450,000.00	6,920,063.46	
1.875 T-NOTE 260630	3,500,000.00	3,261,904.31	
1.875 T-NOTE 260731	2,500,000.00	2,324,853.52	
1.875 T-NOTE 270228	7,700,000.00	7,093,625.00	
1.875 T-NOTE 290228	8,800,000.00	7,870,500.00	
1.875 T-NOTE 320215	15,360,000.00	13,235,700.01	
2 T-BOND 411115	9,750,000.00	7,182,055.62	
2 T-BOND 500215	8,090,000.00	5,575,937.67	
2 T-BOND 510815	11,240,000.00	7,689,960.19	
2 T-NOTE 240531	1,730,000.00	1,678,243.19	
2 T-NOTE 240630	3,000,000.00	2,902,759.38	

2 T-NOTE 250215	8,110,000.00	7,738,872.45	
2 T-NOTE 250815	11,490,000.00	10,875,554.32	
2 T-NOTE 261115	9,550,000.00	8,875,531.25	
2.125 T-NOTE 240731	3,450,000.00	3,335,449.23	
2.125 T-NOTE 240930	6,800,000.00	6,548,453.10	
2.125 T-NOTE 241130	1,900,000.00	1,823,369.14	
2.125 T-NOTE 250515	6,970,000.00	6,638,516.62	
2.125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,695,312.50	
2.25 T-BOND 410515	8,940,000.00	6,930,769.95	
2.25 T-BOND 460815	5,040,000.00	3,706,270.27	
2.25 T-BOND 490815	6,580,000.00	4,806,612.86	
2.25 T-BOND 520215	9,580,000.00	6,947,558.16	
2.25 T-NOTE 241031	2,380,000.00	2,291,121.87	
2.25 T-NOTE 241115	6,450,000.00	6,205,479.46	
2.25 T-NOTE 241231	6,900,000.00	6,621,843.75	
2.25 T-NOTE 251115	10,290,000.00	9,758,618.02	
2.25 T-NOTE 260331	4,500,000.00	4,251,972.64	
2.25 T-NOTE 270215	6,810,000.00	6,366,019.93	
2.25 T-NOTE 270815	6,190,000.00	5,753,314.81	
2.25 T-NOTE 271115	7,290,000.00	6,752,931.99	
2.375 T-BOND 420215	7,780,000.00	6,093,928.12	
2.375 T-BOND 491115	6,100,000.00	4,578,455.10	
2.375 T-BOND 510515	11,620,000.00	8,677,552.69	
2.375 T-NOTE 240815	7,590,000.00	7,351,774.79	
2.375 T-NOTE 260430	2,000,000.00	1,893,906.24	
2.375 T-NOTE 270515	7,070,000.00	6,617,906.65	
2.375 T-NOTE 290331	6,200,000.00	5,694,554.66	
2.375 T-NOTE 290515	7,480,000.00	6,860,708.58	
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	3,928,051.75	
2.5 T-BOND 460215	4,030,000.00	3,120,258.97	
2.5 T-BOND 460515	3,830,000.00	2,963,537.29	
2.5 T-NOTE 240531	6,000,000.00	5,846,747.58	
2.5 T-NOTE 250131	3,350,000.00	3,223,066.42	
2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,283,564.44	
2.5 T-NOTE 270331	9,200,000.00	8,665,429.67	
2.625 T-NOTE 250331	1,960,000.00	1,886,385.16	

2.625 T-NOTE 250415	9,000,000.00	8,657,226.54	
2.625 T-NOTE 251231	3,200,000.00	3,059,750.01	
2.625 T-NOTE 260131	3,900,000.00	3,726,480.45	
2.625 T-NOTE 270531	7,900,000.00	7,461,179.64	
2.625 T-NOTE 290215	10,420,000.00	9,709,119.88	
2.625 T-NOTE 290731	5,600,000.00	5,203,624.99	
2.75 T-BOND 420815	2,120,000.00	1,757,736.71	
2.75 T-BOND 421115	3,100,000.00	2,564,826.16	
2.75 T-BOND 470815	5,160,000.00	4,177,685.16	
2.75 T-BOND 471115	5,110,000.00	4,138,002.16	
2.75 T-NOTE 250228	3,440,000.00	3,322,220.31	
2.75 T-NOTE 250515	6,400,000.00	6,165,500.03	
2.75 T-NOTE 250630	2,370,000.00	2,281,171.28	
2.75 T-NOTE 250831	8,250,000.00	7,930,312.50	
2.75 T-NOTE 270430	9,700,000.00	9,209,695.26	
2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,251,064.43	
2.75 T-NOTE 280215	9,990,000.00	9,440,159.79	
2.75 T-NOTE 290531	5,500,000.00	5,151,308.58	
2.75 T-NOTE 320815	15,810,000.00	14,575,770.05	
2.875 T-BOND 430515	4,680,000.00	3,937,141.39	
2.875 T-BOND 450815	3,500,000.00	2,904,521.48	
2.875 T-BOND 461115	2,340,000.00	1,940,234.77	
2.875 T-BOND 490515	7,270,000.00	6,041,909.57	
2.875 T-BOND 520515	8,920,000.00	7,419,802.37	
2.875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	5,794,804.68	
2.875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,084,180.64	
2.875 T-NOTE 250615	7,800,000.00	7,527,304.66	
2.875 T-NOTE 250731	6,100,000.00	5,882,925.76	
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,656,609.35	
2.875 T-NOTE 280515	10,090,000.00	9,574,069.93	
2.875 T-NOTE 280815	9,110,000.00	8,628,522.28	
2.875 T-NOTE 290430	7,000,000.00	6,603,515.66	
2.875 T-NOTE 320515	15,480,000.00	14,435,402.32	
3 T-BOND 420515	1,920,000.00	1,660,312.49	
3 T-BOND 441115	3,560,000.00	3,029,824.22	
3 T-BOND 450515	2,190,000.00	1,859,917.37	

3 T-BOND 451115	2,300,000.00	1,950,148.42	
3 T-BOND 470215	4,210,000.00	3,567,234.96	
3 T-BOND 470515	3,390,000.00	2,871,899.41	
3 T-BOND 480215	5,800,000.00	4,919,238.27	
3 T-BOND 480815	6,770,000.00	5,743,525.21	
3 T-BOND 490215	7,090,000.00	6,028,854.08	
3 T-BOND 520815	8,670,000.00	7,401,165.78	
3 T-NOTE 240630	4,100,000.00	4,006,824.71	
3 T-NOTE 240731	6,000,000.00	5,856,679.68	
3 T-NOTE 250715	6,700,000.00	6,479,632.84	
3 T-NOTE 250930	5,400,000.00	5,216,273.42	
3 T-NOTE 251031	3,300,000.00	3,186,046.87	
3.125 T-BOND 411115	1,990,000.00	1,764,686.90	
3.125 T-BOND 420215	2,200,000.00	1,944,550.78	
3.125 T-BOND 430215	2,850,000.00	2,500,596.66	
3.125 T-BOND 440815	4,130,000.00	3,594,148.63	
3.125 T-BOND 480515	6,010,000.00	5,214,027.12	
3.125 T-NOTE 250815	5,000,000.00	4,845,605.45	
3.125 T-NOTE 270831	7,300,000.00	7,019,833.95	
3.125 T-NOTE 281115	8,280,000.00	7,931,981.25	
3.125 T-NOTE 290831	5,900,000.00	5,638,648.40	
3.25 T-BOND 420515	6,580,000.00	5,906,192.60	
3.25 T-NOTE 240831	7,400,000.00	7,233,355.47	
3.25 T-NOTE 270630	6,300,000.00	6,091,312.50	
3.25 T-NOTE 290630	6,700,000.00	6,447,703.12	
3.375 T-BOND 420815	6,300,000.00	5,751,826.16	
3.375 T-BOND 440515	3,160,000.00	2,866,527.35	
3.375 T-BOND 481115	6,920,000.00	6,285,982.05	
3.375 T-NOTE 330515	5,100,000.00	4,946,601.58	
3.5 T-BOND 390215	1,360,000.00	1,312,479.67	
3.5 T-NOTE 250915	5,100,000.00	4,980,767.55	
3.5 T-NOTE 280131	8,300,000.00	8,105,144.55	
3.5 T-NOTE 280430	6,900,000.00	6,740,437.50	
3.5 T-NOTE 300131	5,100,000.00	4,979,871.07	
3.5 T-NOTE 300430	5,700,000.00	5,569,968.75	
3.5 T-NOTE 330215	15,100,000.00	14,793,281.25	

3. 625 T-BOND 430815	3,500,000.00	3,310,029.30	
3. 625 T-BOND 440215	3,770,000.00	3,556,391.19	
3. 625 T-BOND 530215	8,690,000.00	8,378,381.94	
3. 625 T-BOND 530515	3,200,000.00	3,089,500.00	
3. 625 T-NOTE 260515	7,000,000.00	6,860,273.42	
3. 625 T-NOTE 280331	6,000,000.00	5,893,359.36	
3. 625 T-NOTE 280531	3,000,000.00	2,950,546.86	
3. 625 T-NOTE 300331	5,500,000.00	5,414,921.87	
3. 75 T-BOND 410815	2,060,000.00	2,003,631.64	
3. 75 T-BOND 431115	3,450,000.00	3,320,355.48	
3. 75 T-NOTE 260415	7,000,000.00	6,881,328.16	
3. 875 T-BOND 400815	1,870,000.00	1,867,479.86	
3. 875 T-BOND 430215	5,390,000.00	5,282,200.00	
3. 875 T-BOND 430515	2,300,000.00	2,255,796.87	
3. 875 T-NOTE 250331	5,000,000.00	4,916,210.95	
3. 875 T-NOTE 250430	2,000,000.00	1,967,226.56	
3. 875 T-NOTE 260115	6,700,000.00	6,601,986.30	
3. 875 T-NOTE 271130	6,900,000.00	6,840,972.63	
3. 875 T-NOTE 271231	7,000,000.00	6,940,527.37	
3. 875 T-NOTE 290930	5,100,000.00	5,081,472.66	
3. 875 T-NOTE 291130	5,100,000.00	5,085,656.25	
3. 875 T-NOTE 291231	5,700,000.00	5,685,972.64	
4 T-BOND 421115	6,370,000.00	6,365,023.43	
4 T-BOND 521115	8,650,000.00	8,923,015.62	
4 T-NOTE 251215	5,700,000.00	5,633,871.10	
4 T-NOTE 260215	8,000,000.00	7,909,531.28	
4 T-NOTE 280229	6,000,000.00	5,989,921.86	
4 T-NOTE 291031	5,500,000.00	5,520,195.34	
4 T-NOTE 300228	5,700,000.00	5,732,285.14	
4. 125 T-NOTE 250131	5,000,000.00	4,933,789.05	
4. 125 T-NOTE 270930	5,900,000.00	5,899,654.31	
4. 125 T-NOTE 271031	6,500,000.00	6,502,031.25	
4. 125 T-NOTE 321115	15,100,000.00	15,521,148.35	
4. 25 T-BOND 390515	1,770,000.00	1,862,786.72	
4. 25 T-BOND 401115	2,180,000.00	2,280,441.79	
4. 25 T-NOTE 240930	2,200,000.00	2,174,820.31	

		4. 25 T-NOTE 241231	5,200,000.00	5,139,062.50	
		4. 25 T-NOTE 250531	9,000,000.00	8,917,382.79	
		4. 25 T-NOTE 251015	6,000,000.00	5,956,289.04	
		4. 375 T-BOND 380215	1,000,000.00	1,070,566.40	
		4. 375 T-BOND 391115	1,930,000.00	2,056,656.25	
		4. 375 T-BOND 400515	2,080,000.00	2,212,071.86	
		4. 375 T-BOND 410515	1,760,000.00	1,862,884.37	
		4. 375 T-NOTE 241031	4,000,000.00	3,959,140.64	
		4. 5 T-BOND 360215	1,160,000.00	1,259,710.15	
		4. 5 T-BOND 380515	1,330,000.00	1,441,049.79	
		4. 5 T-BOND 390815	1,880,000.00	2,035,246.86	
		4. 5 T-NOTE 241130	9,000,000.00	8,925,117.21	
		4. 5 T-NOTE 251115	4,700,000.00	4,693,757.83	
		4. 625 T-BOND 400215	2,100,000.00	2,303,437.50	
		4. 625 T-NOTE 250228	8,000,000.00	7,960,624.96	
		4. 625 T-NOTE 260315	6,000,000.00	6,032,578.14	
		4. 75 T-BOND 410215	2,010,000.00	2,231,845.88	
		5 T-BOND 370515	1,020,000.00	1,162,182.42	
		5. 25 T-BOND 281115	2,690,000.00	2,844,990.24	
		5. 375 T-BOND 310215	2,300,000.00	2,535,929.67	
		6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,246,265.62	
		6. 125 T-BOND 271115	1,160,000.00	1,254,204.69	
		6. 25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,313,201.16	
		アメリカドル合計	1,738,690,000.00	1,565,228,455.69 (224,594,631,106)	
カナダドル	国債証券	0. 25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	1,978,840.02	
		0. 5 CAN GOVT 250901	2,900,000.00	2,661,402.73	
		0. 5 CAN GOVT 301201	5,800,000.00	4,690,302.41	
		0. 75 CAN GOVT 241001	3,500,000.00	3,322,588.32	
		1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,737,134.17	
		1. 25 CAN GOVT 250301	2,100,000.00	1,984,855.46	
		1. 25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,272,789.82	
		1. 25 CAN GOVT 300601	3,510,000.00	3,035,781.09	
		1. 5 CAN GOVT 240901	2,000,000.00	1,921,357.82	
		1. 5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	946,239.69	
		1. 5 CAN GOVT 260601	4,070,000.00	3,779,311.68	

		1. 5 CAN GOVT 310601	5,900,000.00	5,116,660.59	
		1. 5 CAN GOVT 311201	4,270,000.00	3,677,445.99	
		1. 75 CAN GOVT 531201	4,500,000.00	3,235,878.27	
		2 CAN GOVT 280601	670,000.00	621,744.99	
		2 CAN GOVT 320601	3,750,000.00	3,350,336.25	
		2 CAN GOVT 511201	6,060,000.00	4,685,551.88	
		2. 25 CAN GOVT 250601	4,360,000.00	4,176,933.45	
		2. 25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,064,730.09	
		2. 25 CAN GOVT 291201	1,000,000.00	929,884.56	
		2. 5 CAN GOVT 240601	4,000,000.00	3,909,580.00	
		2. 5 CAN GOVT 321201	3,500,000.00	3,253,948.83	
		2. 75 CAN GOVT 270901	2,000,000.00	1,916,592.48	
		2. 75 CAN GOVT 330601	3,000,000.00	2,847,582.92	
		2. 75 CAN GOVT 481201	1,680,000.00	1,537,031.14	
		2. 75 CAN GOVT 551201	450,000.00	408,024.25	
		2. 75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,112,975.51	
		3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,906,479.23	
		3. 5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	1,977,592.50	
		3. 5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,702,680.30	
		3. 75 CAN GOVT 250501	3,500,000.00	3,443,989.08	
		4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,304,529.68	
		5 CAN GOVT 370601	830,000.00	980,993.71	
		5. 75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,062,022.06	
		5. 75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,712,902.07	
			94,670,000.00	86,266,693.04	
		カナダドル合計		(9,398,756,206)	
オーストラリアドル	国債証券	0. 25 AUST GOVT 251121	5,450,000.00	4,977,451.04	
		0. 5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,669,273.76	
		1 AUST GOVT 301221	3,010,000.00	2,436,252.70	
		1 AUST GOVT 311121	4,250,000.00	3,353,049.48	
		1. 25 AUST GOVT 320521	4,530,000.00	3,609,347.48	
		1. 5 AUST GOVT 310621	4,740,000.00	3,943,519.45	
		1. 75 AUST GOVT 321121	3,980,000.00	3,287,101.93	
		1. 75 AUST GOVT 510621	3,070,000.00	1,826,274.32	
		2. 25 AUST GOVT 280521	1,900,000.00	1,758,651.72	
		2. 5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,595,745.29	

		2. 75 AUST GOVT 271121	2,490,000.00	2,371,084.94	
		2. 75 AUST GOVT 281121	1,940,000.00	1,829,310.29	
		2. 75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,779,095.90	
		2. 75 AUST GOVT 350621	1,520,000.00	1,333,858.03	
		2. 75 AUST GOVT 410521	1,370,000.00	1,115,496.03	
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,754,424.65	
		3 AUST GOVT 470321	2,020,000.00	1,642,784.89	
		3. 25 AUST GOVT 250421	5,460,000.00	5,370,564.27	
		3. 25 AUST GOVT 290421	2,660,000.00	2,564,618.38	
		3. 25 AUST GOVT 390621	2,130,000.00	1,895,806.79	
		3. 5 AUST GOVT 341221	2,300,000.00	2,189,396.31	
		3. 75 AUST GOVT 340521	1,700,000.00	1,661,473.47	
		3. 75 AUST GOVT 370421	2,150,000.00	2,066,938.12	
		4. 25 AUST GOVT 260421	2,490,000.00	2,505,015.44	
		4. 5 AUST GOVT 330421	3,100,000.00	3,227,790.68	
		4. 75 AUST GOVT 270421	3,050,000.00	3,134,028.41	
オーストラリアドル合計			80,430,000.00	71,898,353.77	(6,885,705,340)
イギリス ポンド	国債証券	0. 125 GILT 260130	2,600,000.00	2,298,515.44	
		0. 125 GILT 280131	2,300,000.00	1,874,638.00	
		0. 25 GILT 250131	4,100,000.00	3,782,233.60	
		0. 25 GILT 310731	4,460,000.00	3,238,004.60	
		0. 375 GILT 261022	3,750,000.00	3,224,062.50	
		0. 375 GILT 301022	2,390,000.00	1,802,490.20	
		0. 5 GILT 290131	4,900,000.00	3,923,185.00	
		0. 5 GILT 611022	2,950,000.00	910,458.50	
		0. 625 GILT 250607	2,880,000.00	2,642,901.12	
		0. 625 GILT 350731	4,030,000.00	2,627,987.18	
		0. 625 GILT 501022	1,590,000.00	644,283.90	
		0. 875 GILT 291022	2,320,000.00	1,871,780.17	
		0. 875 GILT 330731	2,350,000.00	1,697,452.00	
		0. 875 GILT 460131	2,420,000.00	1,194,179.85	
		1 GILT 320131	5,100,000.00	3,901,755.00	
		1. 125 GILT 390131	3,550,000.00	2,230,530.32	
		1. 125 GILT 731022	1,500,000.00	571,575.00	
1. 25 GILT 270722	2,100,000.00	1,833,316.80			

1. 25 GILT 411022	3, 750, 000. 00	2, 261, 311. 98	
1. 25 GILT 510731	4, 180, 000. 00	2, 068, 447. 92	
1. 5 GILT 260722	2, 490, 000. 00	2, 249, 485. 92	
1. 5 GILT 470722	3, 160, 000. 00	1, 788, 560. 00	
1. 5 GILT 530731	1, 250, 000. 00	649, 494. 75	
1. 625 GILT 281022	1, 790, 000. 00	1, 545, 557. 60	
1. 625 GILT 541022	2, 060, 000. 00	1, 103, 128. 35	
1. 625 GILT 711022	2, 530, 000. 00	1, 228, 472. 87	
1. 75 GILT 370907	3, 340, 000. 00	2, 403, 214. 16	
1. 75 GILT 490122	1, 780, 000. 00	1, 053, 368. 40	
1. 75 GILT 570722	2, 830, 000. 00	1, 555, 424. 60	
2 GILT 250907	2, 100, 000. 00	1, 960, 433. 47	
2. 5 GILT 650722	2, 480, 000. 00	1, 652, 399. 20	
3. 25 GILT 330131	2, 800, 000. 00	2, 571, 464. 00	
3. 25 GILT 440122	3, 060, 000. 00	2, 552, 958. 00	
3. 5 GILT 251022	2, 500, 000. 00	2, 393, 387. 10	
3. 5 GILT 450122	3, 190, 000. 00	2, 752, 810. 50	
3. 5 GILT 680722	2, 250, 000. 00	1, 932, 114. 15	
3. 75 GILT 380129	1, 250, 000. 00	1, 153, 850. 00	
3. 75 GILT 520722	1, 810, 000. 00	1, 611, 667. 20	
3. 75 GILT 531022	2, 150, 000. 00	1, 908, 168. 00	
4 GILT 600122	1, 980, 000. 00	1, 877, 116. 03	
4 GILT 631022	650, 000. 00	617, 110. 00	
4. 125 GILT 270129	4, 900, 000. 00	4, 753, 245. 00	
4. 25 GILT 271207	2, 450, 000. 00	2, 404, 748. 50	
4. 25 GILT 320607	2, 770, 000. 00	2, 773, 102. 40	
4. 25 GILT 360307	2, 410, 000. 00	2, 383, 441. 80	
4. 25 GILT 390907	2, 320, 000. 00	2, 262, 440. 80	
4. 25 GILT 401207	2, 120, 000. 00	2, 062, 474. 33	
4. 25 GILT 461207	2, 680, 000. 00	2, 585, 595. 92	
4. 25 GILT 491207	1, 990, 000. 00	1, 923, 140. 37	
4. 25 GILT 551207	2, 770, 000. 00	2, 711, 996. 20	
4. 5 GILT 340907	1, 990, 000. 00	2, 021, 686. 37	
4. 5 GILT 421207	2, 790, 000. 00	2, 801, 355. 30	
4. 75 GILT 301207	3, 650, 000. 00	3, 752, 747. 50	
4. 75 GILT 381207	2, 310, 000. 00	2, 388, 728. 49	

		5 GILT 250307	2,490,000.00	2,480,043.48	
		6 GILT 281207	1,890,000.00	2,015,911.80	
イギリスポンド合計			150,200,000.00	120,479,951.64 (22,010,482,365)	
シンガポールドル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	700,000.00	655,900.00	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1,050,000.00	947,100.00	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	700,000.00	625,800.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00	860,866.25	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00	1,479,816.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,300,000.00	1,218,750.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,560,000.00	1,528,620.60	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	380,000.00	364,509.30	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00	783,532.00	
		2.625 SINGAPORGOV 320801	700,000.00	678,678.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	980,000.00	1,015,010.50	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,140,000.00	1,195,860.00	
		2.875 SINGAPORGOV 270901	1,000,000.00	990,900.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	920,000.00	911,076.00	
		2.875 SINGAPORGOVT 300901	1,340,000.00	1,326,868.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,500,000.00	1,487,564.28	
		3 SINGAPORGOVT 720801	560,000.00	670,040.00	
3.375 SINGAPORGOV 330901	780,000.00	806,910.00			
3.5 SINGAPORGOVT 270301	1,000,000.00	1,010,500.00			
シンガポールドル合計			18,890,000.00	18,558,300.93 (1,970,705,975)	
マレーシアリングgit	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	2,800,000.00	2,562,324.43	
		3.478 MALAYSIAGOV 240614	1,300,000.00	1,302,393.82	
		3.502 MALAYSIAGOV 270531	3,000,000.00	2,987,556.45	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	2,100,000.00	2,058,082.08	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,808,632.96	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3,630,000.00	3,428,524.58	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	2,300,000.00	2,258,928.90	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	2,400,000.00	2,386,098.76	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	2,410,000.00	2,431,303.43	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3,600,000.00	3,615,877.80	
3.892 MALAYSIAGOV 270315	5,100,000.00	5,144,523.00			

		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	5,640,000.00	5,697,499.23	
		3. 9 MALAYSIAGOV 261130	1,100,000.00	1,112,455.52	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	1,400,000.00	1,417,106.60	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	4,270,000.00	4,311,377.58	
		4. 059 MALAYSIAGOV 240930	2,000,000.00	2,015,123.80	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	5,250,000.00	5,083,168.33	
		4. 181 MALAYSIAGOV 240715	2,500,000.00	2,518,088.25	
		4. 232MALAYSIAGOV 310630	2,550,000.00	2,608,433.76	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	2,150,000.00	2,187,377.32	
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	900,000.00	922,072.86	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	600,000.00	621,865.92	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	2,240,000.00	2,341,743.48	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	1,500,000.00	1,556,473.80	
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	1,200,000.00	1,274,961.12	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	1,900,000.00	2,018,489.51	
		4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1,650,000.00	1,759,324.05	
		4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4,440,000.00	4,747,508.62	
		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	2,750,000.00	3,001,551.85	
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	2,020,000.00	2,227,229.78	
		4. 935 MALAYSIAGOV 430930	1,000,000.00	1,089,568.90	
マレーシアリングット合計			78,500,000.00	79,495,666.49	(2,439,213,232)
ニュージーランドドル	国債証券	0. 25 NZ GOVT 280515	2,000,000.00	1,629,172.92	
		1. 75 NZ GOVT 410515	600,000.00	386,286.48	
		2 NZ GOVT 320515	2,300,000.00	1,877,294.98	
		2. 75 NZ GOVT 250415	1,400,000.00	1,342,943.60	
		2. 75 NZ GOVT 370415	1,450,000.00	1,171,830.99	
		2. 75 NZ GOVT 510515	680,000.00	482,137.97	
		3 NZ GOVT 290420	1,700,000.00	1,569,139.86	
		3. 5 NZ GOVT 330414	800,000.00	734,355.94	
		4. 5 NZ GOVT 270415	1,800,000.00	1,792,339.41	
ニュージーランドドル合計			12,730,000.00	10,985,502.15	(970,239,549)
スウェーデンクローネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	9,450,000.00	7,812,862.53	
		0. 75 SWD GOVT 280512	8,000,000.00	7,271,091.92	
		0. 75 SWD GOVT 291112	12,200,000.00	10,860,045.81	

		1 SWD GOVT 261112	11,960,000.00	11,180,259.42	
		1.75 SWD GOVT 331111	9,000,000.00	8,334,627.84	
		2.25 SWD GOVT 320601	6,750,000.00	6,564,667.54	
		2.5 SWD GOVT 250512	8,840,000.00	8,692,752.73	
		3.5 SWD GOVT 390330	6,470,000.00	7,073,780.40	
スウェーデンクローネ合計			72,670,000.00	67,790,088.19	(908,387,181)
ノルウェークローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	4,700,000.00	3,947,027.10	
		1.375 NORWE GOVT 300819	8,770,000.00	7,591,313.75	
		1.5 NORWE GOVT 260219	6,040,000.00	5,688,774.00	
		1.75 NORWE GOVT 250313	10,200,000.00	9,822,345.00	
		1.75 NORWE GOVT 270217	5,120,000.00	4,785,024.00	
		1.75 NORWE GOVT 290906	4,600,000.00	4,143,896.20	
		2 NORWE GOVT 280426	6,900,000.00	6,405,380.40	
		2.125 NORWE GOVT 320518	5,500,000.00	4,923,616.50	
		3 NORWE GOVT 330815	4,500,000.00	4,319,462.70	
ノルウェークローネ合計			56,330,000.00	51,626,839.65	(685,604,430)
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 241115	4,800,000.00	4,584,480.62	
		0 DMK GOVT 311115	14,550,000.00	11,755,988.23	
		0.25 DMK GOVT 521115	8,900,000.00	4,733,328.47	
		0.5 DMK GOVT 271115	10,200,000.00	9,274,912.02	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	9,250,345.50	
		1.75 DMK GOVT 251115	7,490,000.00	7,263,093.44	
		4.5 DMK GOVT 391115	15,650,000.00	19,397,987.20	
デンマーククローネ合計			72,140,000.00	66,260,135.48	(1,392,125,446)
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	58,650,000.00	58,293,417.38	
		10 MEXICAN BONOS 361120	12,350,000.00	13,688,122.50	
		5 MEXICAN BONOS 250306	49,000,000.00	45,268,160.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	34,000,000.00	30,360,640.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	65,500,000.00	59,909,957.52	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	48,750,000.00	46,477,762.50	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	20,000,000.00	18,512,200.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	68,050,000.00	64,684,927.50	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	13,400,000.00	12,551,244.00	

		7.75 MEXICAN BONO 421113	35,190,000.00	31,504,551.30	
		8 MEXICAN BONOS 240905	12,000,000.00	11,627,066.76	
		8 MEXICAN BONOS 471107	39,100,000.00	35,716,286.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	20,500,000.00	18,486,285.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	39,150,000.00	38,965,212.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	39,700,000.00	38,547,509.00	
メキシコペソ合計			555,340,000.00	524,593,341.46 (4,394,675,799)	
イスラエル シェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	6,500,000.00	6,088,875.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,370,000.00	2,846,470.50	
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1,300,000.00	1,070,615.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	4,900,000.00	3,671,080.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	3,080,000.00	2,935,548.00	
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	636,360.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3,790,000.00	3,669,667.50	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	3,130,000.00	3,833,780.50	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	5,000,000.00	5,573,500.00	
イスラエルシェケル合計			31,870,000.00	30,325,896.50 (1,200,380,863)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	3,000,000.00	2,507,100.00	
		0.75 POLAND 250425	3,500,000.00	3,201,100.00	
		1.25 POLAND 301025	5,890,000.00	4,364,195.50	
		1.75 POLAND 320425	7,600,000.00	5,522,160.00	
		2.25 POLAND 241025	4,000,000.00	3,813,200.00	
		2.5 POLAND 260725	7,840,000.00	7,127,892.80	
		2.5 POLAND 270725	6,110,000.00	5,401,851.00	
		2.75 POLAND 280425	5,760,000.00	5,049,273.60	
		2.75 POLAND 291025	7,900,000.00	6,712,630.00	
		3.25 POLAND 250725	8,700,000.00	8,267,653.50	
		3.75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,711,920.00	
		5.75 POLAND 290425	1,450,000.00	1,458,917.50	
		7.5 POLAND 280725	3,500,000.00	3,770,289.25	
ポーランドズロチ合計			69,250,000.00	60,908,183.15 (2,146,221,649)	
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 240915	14,000,000.00	13,979,396.90	
		1.99 CHINA GOVT 250409	20,000,000.00	19,927,200.00	

2. 18 CHINA GOVT 240625	26,000,000.00	26,027,963.00	
2. 18 CHINA GOVT 250825	16,000,000.00	15,971,008.32	
2. 24 CHINA GOVT 250525	9,000,000.00	9,002,286.90	
2. 26 CHINA GOVT 250224	14,000,000.00	14,007,238.00	
2. 28 CHINA GOVT 251125	22,000,000.00	21,998,487.72	
2. 29 CHINA GOVT 241225	33,000,000.00	33,066,429.00	
2. 3 CHINA GOVT 260515	10,000,000.00	10,002,603.00	
2. 35 CHINA GOVT 250315	22,000,000.00	22,066,462.00	
2. 37 CHINA GOVT 270120	21,000,000.00	20,969,744.67	
2. 44 CHINA GOVT 271015	15,000,000.00	14,984,019.90	
2. 46 CHINA GOVT 260215	20,000,000.00	20,090,864.00	
2. 47 CHINA GOVT 240902	16,000,000.00	16,072,859.20	
2. 48 CHINA GOVT 270415	13,000,000.00	13,017,209.40	
2. 5 CHINA GOVT 270725	25,000,000.00	25,040,477.50	
2. 6 CHINA GOVT 320901	17,000,000.00	16,819,216.90	
2. 62 CHINA GOVT 280415	18,000,000.00	18,121,028.40	
2. 62 CHINA GOVT 290925	14,000,000.00	13,975,866.38	
2. 64 CHINA GOVT 280115	19,000,000.00	19,131,668.10	
2. 67 CHINA GOVT 330525	7,000,000.00	7,007,562.10	
2. 68 CHINA GOVT 300521	27,000,000.00	27,034,414.20	
2. 69 CHINA GOVT 260812	34,000,000.00	34,343,070.20	
2. 69 CHINA GOVT 320815	17,000,000.00	16,941,007.62	
2. 74 CHINA GOVT 260804	5,000,000.00	5,057,525.50	
2. 75 CHINA GOVT 290615	20,000,000.00	20,133,886.00	
2. 75 CHINA GOVT 320217	20,000,000.00	20,030,508.00	
2. 76 CHINA GOVT 320515	16,000,000.00	16,062,592.00	
2. 79 CHINA GOVT 291215	19,000,000.00	19,134,622.60	
2. 8 CHINA GOVT 290324	14,000,000.00	14,164,319.40	
2. 8 CHINA GOVT 300325	25,000,000.00	25,208,595.00	
2. 8 CHINA GOVT 321115	17,000,000.00	17,082,885.20	
2. 85 CHINA GOVT 270604	22,000,000.00	22,339,592.00	
2. 88 CHINA GOVT 330225	20,000,000.00	20,322,874.00	
2. 89 CHINA GOVT 311118	18,000,000.00	18,222,980.40	
2. 9 CHINA GOVT 260505	17,000,000.00	17,271,580.10	
2. 91 CHINA GOVT 281014	24,000,000.00	24,465,669.60	
2. 94 CHINA GOVT 241017	10,000,000.00	10,114,531.00	

		2.99 CHINA GOVT 251015	9,000,000.00	9,150,394.50	
		3.01 CHINA GOVT 280513	21,000,000.00	21,516,096.00	
		3.02 CHINA GOVT 251022	27,000,000.00	27,484,901.10	
		3.02 CHINA GOVT 310527	30,000,000.00	30,740,880.00	
		3.03 CHINA GOVT 260311	28,000,000.00	28,554,750.00	
		3.12 CHINA GOVT 261205	17,000,000.00	17,432,609.20	
		3.12 CHINA GOVT 521025	11,000,000.00	11,072,360.20	
		3.13 CHINA GOVT 291121	21,000,000.00	21,654,488.10	
		3.19 CHINA GOVT 530415	4,000,000.00	4,113,771.60	
		3.22 CHINA GOVT 251206	13,000,000.00	13,304,258.50	
		3.25 CHINA GOVT 260606	18,000,000.00	18,515,939.40	
		3.25 CHINA GOVT 281122	17,000,000.00	17,718,625.70	
		3.27 CHINA GOVT 301119	27,000,000.00	28,353,510.00	
		3.28 CHINA GOVT 271203	24,000,000.00	24,876,943.20	
		3.29 CHINA GOVT 290523	25,000,000.00	26,108,945.00	
		3.32 CHINA GOVT 520415	13,000,000.00	13,490,305.40	
		3.39 CHINA GOVT 500316	23,000,000.00	24,073,255.90	
		3.52 CHINA GOVT 270504	19,000,000.00	19,878,875.40	
		3.53 CHINA GOVT 511018	12,000,000.00	12,906,615.60	
		3.54 CHINA GOVT 280816	13,000,000.00	13,744,838.90	
		3.57 CHINA GOVT 240622	10,000,000.00	10,166,115.00	
		3.59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,356,192.90	
		3.6 CHINA GOVT 250906	8,000,000.00	8,269,398.40	
		3.61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,316,641.00	
		3.69 CHINA GOVT 240921	20,000,000.00	20,473,192.00	
		3.69 CHINA GOVT 280517	15,000,000.00	15,996,925.50	
		3.72 CHINA GOVT 510412	14,000,000.00	15,540,803.60	
		3.77 CHINA GOVT 250308	11,000,000.00	11,346,424.10	
		3.81 CHINA GOVT 500914	23,000,000.00	25,872,725.30	
		3.86 CHINA GOVT 490722	18,000,000.00	20,351,358.00	
		4.08 CHINA GOVT 481022	18,000,000.00	20,986,088.40	
	中国元合計		1,222,000,000.00	1,250,578,472.11 (24,977,303,592)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	800,000.00	755,471.20	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	900,000.00	773,477.10	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	2,150,000.00	1,778,344.55	

0 AUSTRIA GOVT 310220	2,130,000.00	1,708,888.35	
0 AUSTRIA GOVT 401020	810,000.00	480,475.80	
0 BEL GOVT 271022	1,800,000.00	1,593,662.40	
0 BEL GOVT 311022	1,700,000.00	1,339,154.60	
0 BUND 260815	5,930,000.00	5,450,974.60	
0 BUND 271115	3,100,000.00	2,779,382.50	
0 BUND 281115	4,400,000.00	3,868,717.60	
0 BUND 290815	4,550,000.00	3,939,299.00	
0 BUND 300215	4,120,000.00	3,530,947.12	
0 BUND 300815	4,960,000.00	4,207,245.60	
0 BUND 300815	650,000.00	552,405.75	
0 BUND 310215	3,700,000.00	3,104,751.40	
0 BUND 310815	5,400,000.00	4,485,823.20	
0 BUND 310815	1,900,000.00	1,579,929.80	
0 BUND 320215	4,690,000.00	3,851,493.66	
0 BUND 350515	3,630,000.00	2,738,925.75	
0 BUND 360515	3,800,000.00	2,790,473.00	
0 BUND 500815	5,650,000.00	3,037,762.05	
0 BUND 500815	1,560,000.00	841,593.48	
0 BUND 520815	3,290,000.00	1,684,595.15	
0 FINNISH GOVT 240915	850,000.00	816,641.92	
0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	612,558.75	
0 IRISH GOVT 311018	1,350,000.00	1,081,798.20	
0 ITALY GOVT 240815	2,500,000.00	2,399,556.02	
0 ITALY GOVT 241215	2,000,000.00	1,897,501.48	
0 ITALY GOVT 260401	3,300,000.00	2,989,974.90	
0 ITALY GOVT 260801	2,500,000.00	2,240,185.00	
0 NETH GOVT 260115	2,200,000.00	2,041,065.18	
0 NETH GOVT 270115	1,950,000.00	1,766,844.30	
0 NETH GOVT 290115	1,300,000.00	1,121,943.16	
0 NETH GOVT 300715	2,650,000.00	2,207,291.00	
0 NETH GOVT 310715	1,620,000.00	1,316,502.07	
0 NETH GOVT 380115	1,540,000.00	1,037,836.80	
0 NETH GOVT 520115	2,830,000.00	1,379,910.83	
0 O. A. T 250225	2,900,000.00	2,749,127.50	
0 O. A. T 250325	7,380,000.00	6,982,365.60	

0 O. A. T 260225	6,600,000.00	6,093,931.80	
0 O. A. T 270225	6,130,000.00	5,521,100.97	
0 O. A. T 291125	6,380,000.00	5,357,097.79	
0 O. A. T 301125	8,390,000.00	6,848,488.52	
0 O. A. T 311125	7,900,000.00	6,266,651.30	
0 O. A. T 320525	5,430,000.00	4,240,357.59	
0 OBL 241018	4,400,000.00	4,216,685.00	
0 OBL 250411	2,800,000.00	2,651,098.80	
0 OBL 251010	4,000,000.00	3,740,460.00	
0 OBL 251010	1,000,000.00	936,640.60	
0 OBL 260410	5,200,000.00	4,810,712.40	
0 OBL 261009	2,900,000.00	2,654,791.66	
0 OBL 270416	3,050,000.00	2,764,132.65	
0 SPAIN GOVT 240531	5,600,000.00	5,421,836.00	
0 SPAIN GOVT 250131	3,630,000.00	3,444,909.93	
0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,345,114.00	
0 SPAIN GOVT 260131	6,500,000.00	5,983,022.50	
0 SPAIN GOVT 270131	2,800,000.00	2,501,570.40	
0 SPAIN GOVT 280131	3,800,000.00	3,297,355.00	
0.1 BEL GOVT 300622	2,520,000.00	2,091,577.32	
0.1 SPAIN GOVT 310430	4,360,000.00	3,440,938.16	
0.125 FINNISH GOV 310915	1,070,000.00	856,906.29	
0.125 FINNISH GOV 360415	510,000.00	353,397.36	
0.125 FINNISH GOV 520415	750,000.00	354,504.00	
0.2 IRISH GOVT 270515	500,000.00	450,976.50	
0.2 IRISH GOVT 301018	620,000.00	516,089.86	
0.2 SCHATS 240614	3,800,000.00	3,685,739.70	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	1,050,000.00	732,741.45	
0.25 BUND 270215	4,490,000.00	4,124,307.46	
0.25 BUND 280815	4,170,000.00	3,734,084.88	
0.25 BUND 290215	4,050,000.00	3,595,533.30	
0.25 FINNISH GOVT 400915	540,000.00	339,220.44	
0.25 ITALY GOVT 280315	2,700,000.00	2,314,801.58	
0.25 NETH GOVT 250715	1,930,000.00	1,822,994.23	
0.25 NETH GOVT 290715	2,950,000.00	2,560,623.60	
0.25 O. A. T 261125	5,680,000.00	5,192,430.21	

0. 25 SPAIN GOVT 240730	2, 700, 000. 00	2, 606, 509. 80	
0. 35 BEL GOVT 320622	2, 450, 000. 00	1, 954, 382. 15	
0. 35 IRISH GOVT 321018	400, 000. 00	322, 494. 24	
0. 35 ITALY GOVT 250201	3, 060, 000. 00	2, 905, 417. 98	
0. 4 BEL GOVT 400622	1, 300, 000. 00	816, 084. 10	
0. 4 IRISH GOVT 350515	700, 000. 00	527, 278. 50	
0. 45 ITALY GOVT 290215	2, 300, 000. 00	1, 930, 859. 20	
0. 5 AUSTRIA GOVT 270420	2, 100, 000. 00	1, 917, 520. 50	
0. 5 AUSTRIA GOVT 290220	2, 050, 000. 00	1, 797, 165. 30	
0. 5 BEL GOVT 241022	2, 190, 000. 00	2, 110, 533. 66	
0. 5 BUND 250215	7, 110, 000. 00	6, 814, 444. 41	
0. 5 BUND 260215	3, 160, 000. 00	2, 973, 108. 12	
0. 5 BUND 270815	5, 120, 000. 00	4, 713, 303. 04	
0. 5 BUND 280215	4, 280, 000. 00	3, 912, 450. 72	
0. 5 FINNISH GOVT 260415	1, 670, 000. 00	1, 561, 254. 61	
0. 5 FINNISH GOVT 270915	700, 000. 00	634, 827. 90	
0. 5 FINNISH GOVT 280915	1, 480, 000. 00	1, 314, 315. 48	
0. 5 FINNISH GOVT 290915	720, 000. 00	625, 635. 18	
0. 5 FINNISH GOVT 430415	480, 000. 00	300, 787. 89	
0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 450, 000. 00	2, 263, 145. 85	
0. 5 ITALY GOVT 280715	2, 400, 000. 00	2, 061, 345. 60	
0. 5 NETH GOVT 260715	3, 970, 000. 00	3, 696, 755. 21	
0. 5 NETH GOVT 320715	2, 300, 000. 00	1, 909, 687. 57	
0. 5 NETH GOVT 400115	2, 630, 000. 00	1, 857, 437. 50	
0. 5 O. A. T 250525	6, 490, 000. 00	6, 169, 305. 93	
0. 5 O. A. T 260525	7, 530, 000. 00	7, 012, 658. 88	
0. 5 O. A. T 290525	9, 570, 000. 00	8, 398, 947. 81	
0. 5 O. A. T 400525	4, 390, 000. 00	2, 875, 410. 49	
0. 5 O. A. T 440625	2, 730, 000. 00	1, 623, 134. 60	
0. 5 O. A. T 720525	1, 750, 000. 00	690, 628. 75	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	3, 580, 000. 00	3, 007, 307. 40	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	3, 190, 000. 00	2, 567, 618. 24	
0. 55 IRISH GOVT 410422	1, 000, 000. 00	653, 741. 00	
0. 6 ITALY GOVT 310801	3, 100, 000. 00	2, 423, 001. 32	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	3, 680, 000. 00	3, 154, 737. 51	
0. 65 BEL GOVT 710622	910, 000. 00	380, 316. 60	

0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	680,000.00	311,219.68	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	3,800,000.00	3,072,026.40	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	2,480,000.00	2,308,217.84	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	1,690,000.00	1,533,958.92	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	1,180,000.00	687,387.76	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	1,050,000.00	897,668.10	
0. 75 NETH GOVT 270715	2,670,000.00	2,466,651.73	
0. 75 NETH GOVT 280715	3,020,000.00	2,746,388.00	
0. 75 O. A. T 280225	7,400,000.00	6,733,726.20	
0. 75 O. A. T 280525	8,850,000.00	8,023,221.93	
0. 75 O. A. T 281125	8,360,000.00	7,517,041.71	
0. 75 O. A. T 520525	4,710,000.00	2,575,333.80	
0. 75 O. A. T 530525	5,090,000.00	2,719,119.73	
0. 8 BEL GOVT 250622	2,970,000.00	2,838,691.84	
0. 8 BEL GOVT 270622	2,880,000.00	2,655,737.28	
0. 8 BEL GOVT 280622	2,250,000.00	2,043,207.00	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	4,850,000.00	4,419,450.95	
0. 8 SPAIN GOVT 290730	3,530,000.00	3,075,233.63	
0. 85 AUSTRIA GOVT 200630	650,000.00	270,432.50	
0. 85 ITALY GOVT 270115	3,060,000.00	2,786,907.24	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	1,850,000.00	1,296,872.89	
0. 875 FINNISH GOV 250915	630,000.00	600,698.70	
0. 9 AUSTRIA GOVT 320220	2,120,000.00	1,794,590.60	
0. 9 BEL GOVT 290622	3,090,000.00	2,772,125.52	
0. 9 IRISH GOVT 280515	1,640,000.00	1,500,316.69	
0. 9 ITALY GOVT 310401	3,530,000.00	2,861,456.83	
0. 95 ITALY GOVT 270915	4,000,000.00	3,596,659.68	
0. 95 ITALY GOVT 300801	2,500,000.00	2,072,865.00	
0. 95 ITALY GOVT 311201	2,730,000.00	2,177,699.16	
0. 95 ITALY GOVT 320601	2,600,000.00	2,044,770.00	
0. 95 ITALY GOVT 370301	2,560,000.00	1,737,254.93	
1 BEL GOVT 260622	2,760,000.00	2,605,856.20	
1 BEL GOVT 310622	2,850,000.00	2,473,549.20	
1 BUND 240815	3,600,000.00	3,509,086.03	
1 BUND 250815	5,580,000.00	5,350,249.08	
1 BUND 380515	2,860,000.00	2,340,595.40	

1 IRISH GOVT 260515	1, 850, 000. 00	1, 751, 990. 33	
1 O. A. T 251125	6, 580, 000. 00	6, 268, 108. 00	
1 O. A. T 270525	6, 260, 000. 00	5, 829, 086. 64	
1 SPAIN GOVT 420730	1, 350, 000. 00	858, 265. 20	
1 SPAIN GOVT 501031	3, 100, 000. 00	1, 674, 139. 50	
1. 1 IRISH GOVT 290515	1, 610, 000. 00	1, 466, 281. 74	
1. 1 ITALY GOVT 270401	3, 300, 000. 00	3, 016, 491. 39	
1. 125 FINNISH GOV 340415	730, 000. 00	607, 704. 92	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	2, 710, 000. 00	2, 598, 707. 07	
1. 2 ITALY GOVT 250815	2, 100, 000. 00	1, 996, 239. 79	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	2, 730, 000. 00	1, 877, 093. 40	
1. 25 BEL GOVT 330422	1, 770, 000. 00	1, 523, 265. 54	
1. 25 BUND 480815	5, 740, 000. 00	4, 558, 931. 86	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2, 680, 000. 00	2, 483, 070. 92	
1. 25 O. A. T 340525	6, 390, 000. 00	5, 390, 572. 05	
1. 25 O. A. T 360525	7, 070, 000. 00	5, 730, 517. 80	
1. 25 O. A. T 380525	2, 000, 000. 00	1, 556, 711. 20	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	3, 230, 000. 00	2, 830, 179. 10	
1. 3 IRISH GOVT 330515	860, 000. 00	750, 513. 40	
1. 3 OBL 271015	5, 750, 000. 00	5, 459, 622. 26	
1. 3 OBL 271015	800, 000. 00	761, 716. 00	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	3, 650, 000. 00	3, 437, 982. 45	
1. 35 IRISH GOVT 310318	1, 070, 000. 00	970, 607. 70	
1. 35 ITALY GOVT 300401	3, 610, 000. 00	3, 108, 274. 98	
1. 375 FINNISH GOV 270415	800, 000. 00	756, 476. 80	
1. 375 FINNISH GOV 470415	840, 000. 00	619, 542. 20	
1. 4 BEL GOVT 530622	1, 720, 000. 00	1, 101, 113. 04	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	3, 740, 000. 00	3, 455, 121. 58	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	4, 240, 000. 00	3, 902, 752. 25	
1. 45 BEL GOVT 370622	1, 220, 000. 00	986, 858. 00	
1. 45 ITALY GOVT 241115	2, 400, 000. 00	2, 330, 414. 40	
1. 45 ITALY GOVT 250515	2, 300, 000. 00	2, 211, 070. 50	
1. 45 ITALY GOVT 360301	2, 140, 000. 00	1, 594, 779. 36	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	3, 330, 000. 00	3, 104, 618. 94	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	3, 300, 000. 00	3, 011, 823. 90	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	950, 000. 00	464, 225. 10	

1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1, 810, 000. 00	1, 341, 332. 54	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	460, 000. 00	278, 224. 92	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	750, 000. 00	665, 881. 50	
1. 5 IRISH GOVT 500515	1, 160, 000. 00	819, 052. 80	
1. 5 ITALY GOVT 250601	3, 300, 000. 00	3, 169, 993. 20	
1. 5 ITALY GOVT 450430	2, 010, 000. 00	1, 253, 958. 60	
1. 5 O. A. T 310525	9, 560, 000. 00	8, 722, 142. 48	
1. 5 O. A. T 500525	5, 230, 000. 00	3, 647, 030. 67	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	3, 290, 000. 00	3, 096, 633. 27	
1. 6 BEL GOVT 470622	1, 570, 000. 00	1, 128, 054. 93	
1. 6 ITALY GOVT 260601	2, 620, 000. 00	2, 476, 759. 36	
1. 6 SPAIN GOVT 250430	3, 510, 000. 00	3, 403, 983. 96	
1. 65 AUSTRIA GOVT 241021	2, 510, 000. 00	2, 458, 703. 13	
1. 65 ITALY GOVT 301201	3, 870, 000. 00	3, 350, 104. 20	
1. 65 ITALY GOVT 320301	4, 450, 000. 00	3, 759, 128. 60	
1. 7 BEL GOVT 500622	1, 840, 000. 00	1, 313, 135. 46	
1. 7 BUND 320815	3, 750, 000. 00	3, 560, 122. 50	
1. 7 IRISH GOVT 370515	1, 190, 000. 00	1, 009, 279. 46	
1. 7 ITALY GOVT 510901	2, 390, 000. 00	1, 449, 460. 36	
1. 75 ITALY GOVT 240701	3, 000, 000. 00	2, 942, 497. 86	
1. 75 O. A. T 241125	5, 020, 000. 00	4, 914, 007. 72	
1. 75 O. A. T 390625	4, 550, 000. 00	3, 788, 370. 95	
1. 75 O. A. T 660525	2, 590, 000. 00	1, 778, 042. 77	
1. 8 BUND 530815	2, 250, 000. 00	1, 963, 993. 50	
1. 8 ITALY GOVT 410301	2, 240, 000. 00	1, 586, 164. 16	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	870, 000. 00	685, 803. 60	
1. 85 ITALY GOVT 250701	2, 400, 000. 00	2, 319, 441. 60	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	4, 200, 000. 00	3, 549, 037. 80	
1. 9 BEL GOVT 380622	1, 360, 000. 00	1, 148, 499. 60	
1. 9 SPAIN GOVT 521031	1, 700, 000. 00	1, 131, 244. 26	
1. 95 SPAIN GOVT 260430	3, 520, 000. 00	3, 399, 978. 56	
1. 95 SPAIN GOVT 300730	3, 790, 000. 00	3, 503, 701. 38	
2 AUSTRIA GOVT 260715	1, 000, 000. 00	970, 969. 75	
2 IRISH GOVT 450218	1, 640, 000. 00	1, 340, 732. 80	
2 ITALY GOVT 251201	3, 530, 000. 00	3, 400, 438. 41	
2 ITALY GOVT 280201	4, 580, 000. 00	4, 279, 105. 95	

2 NETH GOVT 240715	2,900,000.00	2,861,142.90	
2 NETH GOVT 540115	960,000.00	833,716.80	
2 O. A. T 321125	7,450,000.00	6,938,877.85	
2 O. A. T 480525	4,650,000.00	3,691,155.12	
2.05 ITALY GOVT 270801	3,650,000.00	3,442,147.10	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	810,000.00	599,438.07	
2.1 BUND 291115	3,800,000.00	3,731,319.56	
2.1 ITALY GOVT 260715	2,350,000.00	2,250,552.70	
2.15 BEL GOVT 660622	1,090,000.00	821,781.52	
2.15 ITALY GOVT 520901	2,150,000.00	1,424,486.80	
2.15 ITALY GOVT 720301	850,000.00	507,151.05	
2.15 SPAIN GOVT 251031	3,000,000.00	2,929,623.00	
2.2 ITALY GOVT 270601	2,000,000.00	1,902,150.00	
2.2 OBL 280413	3,450,000.00	3,402,545.25	
2.25 BEL GOVT 570622	1,020,000.00	805,688.82	
2.25 ITALY GOVT 360901	2,720,000.00	2,223,018.51	
2.3 BUND 330215	4,850,000.00	4,829,765.80	
2.3 BUND 330215	700,000.00	697,903.78	
2.35 SPAIN GOVT 330730	3,110,000.00	2,855,913.00	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	1,300,000.00	1,228,609.20	
2.4 IRISH GOVT 300515	2,090,000.00	2,048,990.02	
2.45 ITALY GOVT 330901	2,870,000.00	2,524,035.85	
2.45 ITALY GOVT 500901	2,490,000.00	1,802,548.35	
2.5 BUND 440704	4,730,000.00	4,778,752.11	
2.5 BUND 460815	4,600,000.00	4,688,660.40	
2.5 ITALY GOVT 241201	3,360,000.00	3,307,237.58	
2.5 ITALY GOVT 251115	2,330,000.00	2,273,730.50	
2.5 ITALY GOVT 321201	2,850,000.00	2,551,747.50	
2.5 NETH GOVT 330115	2,250,000.00	2,222,325.00	
2.5 NETH GOVT 330715	650,000.00	641,934.80	
2.5 O. A. T 260924	2,800,000.00	2,755,838.40	
2.5 O. A. T 300525	9,590,000.00	9,439,890.99	
2.5 O. A. T 430525	1,330,000.00	1,188,016.11	
2.5 SCHATS 250313	1,000,000.00	989,193.00	
2.55 SPAIN GOVT 321031	4,190,000.00	3,951,718.89	
2.6 BEL GOVT 240622	2,180,000.00	2,162,189.40	

2.625 FINNISH GOV 420704	940,000.00	887,365.64	
2.65 ITALY GOVT 271201	2,800,000.00	2,694,916.00	
2.7 ITALY GOVT 470301	2,630,000.00	2,060,289.40	
2.7 SPAIN GOVT 481031	2,910,000.00	2,411,808.00	
2.75 BEL GOVT 390422	950,000.00	890,935.65	
2.75 FINNISH GOVT 280704	1,110,000.00	1,106,892.00	
2.75 FINNISH GOVT 380415	680,000.00	652,524.05	
2.75 NETH GOVT 470115	3,270,000.00	3,336,740.70	
2.75 O.A.T 271025	8,490,000.00	8,458,077.60	
2.75 O.A.T 290225	1,500,000.00	1,494,240.37	
2.75 SPAIN GOVT 241031	5,400,000.00	5,361,974.54	
2.8 ITALY GOVT 281201	4,680,000.00	4,501,996.20	
2.8 ITALY GOVT 290615	3,200,000.00	3,055,059.20	
2.8 ITALY GOVT 670301	1,620,000.00	1,164,272.97	
2.8 SPAIN GOVT 260531	1,500,000.00	1,480,435.50	
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	700,000.00	700,745.50	
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	1,000,000.00	994,079.00	
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,990,000.00	2,599,506.00	
2.95 ITALY GOVT 380901	2,380,000.00	2,063,012.56	
3 BEL GOVT 330622	1,300,000.00	1,299,855.25	
3 BEL GOVT 340622	1,230,000.00	1,224,751.98	
3 FINNISH GOVT 330915	550,000.00	552,642.20	
3 IRISH GOVT 431018	450,000.00	444,942.45	
3 ITALY GOVT 290801	3,400,000.00	3,284,291.20	
3 O.A.T 330525	1,000,000.00	1,010,630.00	
3 O.A.T 540525	1,530,000.00	1,450,074.33	
3.1 ITALY GOVT 400301	1,890,000.00	1,645,524.72	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	1,250,000.00	1,266,986.25	
3.15 SPAIN GOVT 330430	3,000,000.00	2,959,428.00	
3.25 BUND 420704	2,880,000.00	3,213,863.42	
3.25 ITALY GOVT 380301	1,340,000.00	1,206,420.89	
3.25 ITALY GOVT 460901	2,740,000.00	2,365,056.53	
3.25 O.A.T 450525	4,710,000.00	4,740,230.66	
3.3 BEL GOVT 540622	800,000.00	785,073.60	
3.35 ITALY GOVT 350301	3,110,000.00	2,911,127.94	
3.4 ITALY GOVT 250328	2,300,000.00	2,288,749.55	

3. 4 ITALY GOVT 280401	1, 500, 000. 00	1, 487, 461. 80	
3. 45 BEL GOVT 430622	800, 000. 00	812, 657. 60	
3. 45 ITALY GOVT 480301	2, 820, 000. 00	2, 499, 767. 25	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	1, 820, 000. 00	1, 740, 562. 46	
3. 45 SPAIN GOVT 660730	2, 230, 000. 00	2, 045, 703. 88	
3. 5 ITALY GOVT 260115	2, 500, 000. 00	2, 492, 864. 12	
3. 5 ITALY GOVT 300301	3, 670, 000. 00	3, 636, 324. 08	
3. 5 O. A. T 260425	6, 690, 000. 00	6, 776, 327. 76	
3. 7 ITALY GOVT 300615	750, 000. 00	747, 823. 69	
3. 75 BEL GOVT 450622	1, 620, 000. 00	1, 731, 870. 72	
3. 75 ITALY GOVT 240901	4, 230, 000. 00	4, 233, 663. 18	
3. 75 NETH GOVT 420115	2, 690, 000. 00	3, 091, 356. 07	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	700, 000. 00	818, 944. 98	
3. 8 ITALY GOVT 260415	1, 500, 000. 00	1, 506, 674. 55	
3. 85 ITALY GOVT 291215	2, 600, 000. 00	2, 621, 847. 54	
3. 85 ITALY GOVT 490901	1, 950, 000. 00	1, 834, 938. 14	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	1, 050, 000. 00	1, 078, 124. 35	
4 BEL GOVT 320328	1, 250, 000. 00	1, 351, 060. 00	
4 BUND 370104	4, 040, 000. 00	4, 757, 657. 52	
4 FINNISH GOVT 250704	240, 000. 00	243, 932. 88	
4 ITALY GOVT 311030	1, 650, 000. 00	1, 676, 705. 91	
4 ITALY GOVT 350430	1, 150, 000. 00	1, 146, 389. 79	
4 ITALY GOVT 370201	4, 300, 000. 00	4, 263, 591. 90	
4 NETH GOVT 370115	3, 100, 000. 00	3, 532, 518. 20	
4 O. A. T 381025	4, 020, 000. 00	4, 446, 747. 12	
4 O. A. T 550425	3, 090, 000. 00	3, 547, 018. 72	
4 O. A. T 600425	2, 740, 000. 00	3, 189, 664. 14	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	2, 190, 000. 00	2, 449, 703. 34	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	3, 460, 000. 00	3, 708, 171. 61	
4. 25 BEL GOVT 410328	2, 780, 000. 00	3, 139, 577. 43	
4. 25 BUND 390704	2, 710, 000. 00	3, 337, 446. 30	
4. 35 ITALY GOVT 331101	1, 200, 000. 00	1, 240, 399. 44	
4. 4 ITALY GOVT 330501	2, 900, 000. 00	3, 023, 250. 00	
4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 200, 000. 00	1, 226, 409. 36	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 610, 000. 00	1, 672, 118. 14	
4. 5 ITALY GOVT 260301	3, 740, 000. 00	3, 824, 744. 66	

4. 5 ITALY GOVT 531001	700,000.00	721,539.00	
4. 5 O. A. T 410425	5,580,000.00	6,580,103.40	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	2,890,000.00	2,967,960.64	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	3,300,000.00	3,748,932.00	
4. 75 BUND 280704	2,340,000.00	2,591,341.74	
4. 75 BUND 340704	3,650,000.00	4,482,906.99	
4. 75 BUND 400704	3,430,000.00	4,500,057.10	
4. 75 ITALY GOVT 280901	3,930,000.00	4,144,605.51	
4. 75 ITALY GOVT 440901	2,900,000.00	3,094,075.54	
4. 75 O. A. T 350425	4,800,000.00	5,628,727.68	
4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1,370,000.00	1,433,778.98	
4. 9 SPAIN GOVT 400730	2,930,000.00	3,397,359.31	
5 BEL GOVT 350328	2,950,000.00	3,495,997.80	
5 ITALY GOVT 250301	4,280,000.00	4,371,326.64	
5 ITALY GOVT 340801	3,850,000.00	4,193,130.09	
5 ITALY GOVT 390801	3,980,000.00	4,352,854.36	
5 ITALY GOVT 400901	3,600,000.00	3,949,056.00	
5. 15 SPAIN GOVT 281031	2,500,000.00	2,745,362.50	
5. 15 SPAIN GOVT 441031	2,390,000.00	2,886,560.97	
5. 25 ITALY GOVT 291101	4,110,000.00	4,490,943.57	
5. 4 IRISH GOVT 250313	2,100,000.00	2,180,024.28	
5. 5 BEL GOVT 280328	3,380,000.00	3,779,826.96	
5. 5 BUND 310104	4,280,000.00	5,195,346.48	
5. 5 NETH GOVT 280115	1,480,000.00	1,651,079.12	
5. 5 O. A. T 290425	5,820,000.00	6,651,224.04	
5. 625 BUND 280104	2,540,000.00	2,877,259.16	
5. 75 ITALY GOVT 330201	3,820,000.00	4,384,947.44	
5. 75 O. A. T 321025	5,690,000.00	7,030,245.36	
5. 75 SPAIN GOVT 320730	3,480,000.00	4,169,568.96	
5. 9 SPAIN GOVT 260730	4,650,000.00	5,010,835.35	
6 ITALY GOVT 310501	5,230,000.00	6,037,982.70	
6 O. A. T 251025	5,760,000.00	6,129,792.00	
6 SPAIN GOVT 290131	4,230,000.00	4,848,121.44	
6. 25 AUSTRIA GOVT 270715	1,630,000.00	1,832,905.66	
6. 25 BUND 300104	1,700,000.00	2,093,716.26	
6. 5 BUND 270704	1,750,000.00	2,007,844.12	

	6.5 ITALY GOVT 271101	3,900,000.00	4,363,878.87	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,564,941.60	
ユーロ合計		1,069,140,000.00	984,715,916.56 (154,088,346,623)	
	合計		458,062,779,356 (458,062,779,356)	

(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 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	国債証券 270 銘柄	100.00%	49.03%
カナダドル	国債証券 35 銘柄	100.00%	2.05%
オーストラリアドル	国債証券 26 銘柄	100.00%	1.50%
イギリスポンド	国債証券 56 銘柄	100.00%	4.81%
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 31 銘柄	100.00%	0.53%
ニュージーランドドル	国債証券 9 銘柄	100.00%	0.21%
スウェーデンクローネ	国債証券 8 銘柄	100.00%	0.20%
ノルウェークローネ	国債証券 9 銘柄	100.00%	0.15%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.30%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.00%	0.96%
イスラエルシェケル	国債証券 9 銘柄	100.00%	0.26%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.47%
中国元	国債証券 69 銘柄	100.00%	5.45%
ユーロ	国債証券 365 銘柄	100.00%	33.64%

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。

ヘッジ付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)

[2023年6月26日現在]

資産の部

流動資産	
預金	534,915,738
コール・ローン	1,928,232,444
国債証券	331,586,206,953
派生商品評価勘定	30,932
未収入金	397,440
未収利息	1,821,903,169
前払費用	523,225,416
流動資産合計	336,394,912,092
資産合計	336,394,912,092
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,127,321,638
未払金	1,643,947,366
未払解約金	6,963,842
未払利息	4,846
流動負債合計	13,778,237,692
負債合計	13,778,237,692
純資産の部	
元本等	
元本	284,113,964,774
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	38,502,709,626
元本等合計	322,616,674,400
純資産合計	322,616,674,400
負債純資産合計	336,394,912,092

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)

	[2023年6月26日現在]
1. 期首	2022年6月28日
期首元本額	139,791,690,714円
期中追加設定元本額	362,180,528,461円
期中一部解約元本額	217,858,254,401円
元本の内訳※	
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	667,862,614円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	15,947,260,113円

ラップ向けインデックスf 先進国債券 (為替ヘッジあり)	3,904,352,619円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	176,303,719円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	14,162,676円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	30,805,251円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	4,135,680,137円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	4,477,102,697円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	201,840,974円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	4,337,742,910円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	2,364,631,793円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	87,763,790円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド (適格機関投資家転売制限付)	106,233,411,977円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	9,836,825,944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)	12,019,569,874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)	3,775,881,417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)	692,681,446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)	10,927,665,460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)	822,072,485円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	17,692,643,994円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン (適格機関投資家限定)	8,043,428,594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)	470,046,187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)	59,626,019,138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)	323,295,644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)	1,667,611円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	2,365,420,715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)	325,643,502円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	2,343,030,209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)	322,196,277円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	2,337,540,561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)	322,720,012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)	321,351,725円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	2,068,605,531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)	315,633,120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)	316,748,113円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	2,036,651,970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)	312,894,225円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適	315,490,691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2021-11 (適格機関投資家限定)		315,059,067 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)		329,350,862 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)		336,722,167 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)		352,830,037 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)		359,565,752 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)		371,026,379 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)		388,518,761 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)		376,017,480 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)		388,520,282 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)		381,708,272 円
合計		284,113,964,774 円
2. 受益権の総数		284,113,964,774 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 2022 年 6 月 28 日 至 2023 年 6 月 26 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	[2023 年 6 月 26 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。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。 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	[2023年6月26日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△5,443,853,241
合計		△5,443,853,241

(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

[2023年6月26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	784,666,030	—	784,649,620	△16,410
	カナダドル	270,130,280	—	270,121,600	△8,680
	オーストラリアドル	111,070,000	—	111,064,548	△5,452
	イギリスポンド	52,965,890	—	52,964,643	△1,247
	中国元	4,779,984	—	4,793,112	13,128
	ユーロ	486,562,610	—	486,551,103	△11,507
	売建				
	アメリカドル	160,336,686,472	—	165,254,781,500	△4,918,095,028
	カナダドル	6,686,012,916	—	7,100,288,000	△414,275,084
	オーストラリアドル	4,935,856,275	—	5,200,311,079	△264,454,804
	イギリスポンド	15,283,574,810	—	16,126,219,720	△842,644,910
	シンガポールドル	1,438,235,980	—	1,480,597,600	△42,361,620
	マレーシアリンギット	1,728,641,200	—	1,753,534,640	△24,893,440
	ニュージーランドドル	599,554,368	—	629,557,362	△30,002,994
スウェーデンクローネ	604,709,100	—	631,316,772	△26,607,672	

ノルウェークロ ーネ	461,588,226	—	491,670,531	△30,082,305
デンマーククロ ーネ	952,645,779	—	995,555,700	△42,909,921
メキシコペソ	2,945,689,684	—	3,147,308,728	△201,619,044
イスラエルシェ ケル	884,771,001	—	934,145,886	△49,374,885
ポーランドズロ チ	1,501,068,958	—	1,607,848,508	△106,779,550
中国元	17,921,305,621	—	18,215,381,120	△294,075,499
ユーロ	107,146,200,098	—	111,985,283,880	△4,839,083,782
合計	325,136,715,282	—	337,263,945,652	△12,127,290,706

(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)

	[2023年6月26日現在]
1口当たり純資産額	1.1355円
(1万口当たり純資産額)	(11,355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 240615	6,500,000.00	6,191,288.35	
		0.25 T-NOTE 250531	5,200,000.00	4,771,812.50	
		0.25 T-NOTE 250630	4,000,000.00	3,663,437.52	
		0.25 T-NOTE 250731	5,000,000.00	4,564,355.45	
		0.25 T-NOTE 250831	1,900,000.00	1,729,556.64	

0.25 T-NOTE 250930	5,050,000.00	4,588,497.06	
0.25 T-NOTE 251031	4,000,000.00	3,622,578.12	
0.375 T-NOTE 240715	1,000,000.00	950,243.98	
0.375 T-NOTE 240815	3,600,000.00	3,408,539.07	
0.375 T-NOTE 240915	12,300,000.00	11,605,001.90	
0.375 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,690,078.12	
0.375 T-NOTE 251130	4,000,000.00	3,623,671.88	
0.375 T-NOTE 251231	6,000,000.00	5,427,070.32	
0.375 T-NOTE 260131	6,600,000.00	5,946,445.29	
0.375 T-NOTE 270731	4,000,000.00	3,439,375.00	
0.375 T-NOTE 270930	4,200,000.00	3,593,378.92	
0.5 T-NOTE 260228	4,700,000.00	4,238,353.49	
0.5 T-NOTE 270430	4,200,000.00	3,658,183.57	
0.5 T-NOTE 270531	4,200,000.00	3,648,832.02	
0.5 T-NOTE 270630	5,000,000.00	4,333,300.80	
0.5 T-NOTE 270831	3,850,000.00	3,320,399.42	
0.5 T-NOTE 271031	5,200,000.00	4,462,148.44	
0.625 T-NOTE 241015	4,200,000.00	3,962,355.47	
0.625 T-NOTE 260731	6,700,000.00	5,993,359.37	
0.625 T-NOTE 270331	1,500,000.00	1,316,250.00	
0.625 T-NOTE 271130	4,500,000.00	3,873,867.21	
0.625 T-NOTE 271231	5,480,000.00	4,707,662.50	
0.625 T-NOTE 300515	9,050,000.00	7,296,915.98	
0.625 T-NOTE 300815	11,200,000.00	8,977,500.00	
0.75 T-NOTE 241115	5,600,000.00	5,275,156.26	
0.75 T-NOTE 260331	4,300,000.00	3,901,578.12	
0.75 T-NOTE 260430	6,400,000.00	5,786,249.97	
0.75 T-NOTE 260531	9,200,000.00	8,297,250.00	
0.75 T-NOTE 260831	6,000,000.00	5,375,039.04	
0.75 T-NOTE 280131	7,300,000.00	6,295,822.29	
0.875 T-NOTE 260630	5,000,000.00	4,523,730.45	
0.875 T-NOTE 260930	7,000,000.00	6,289,746.12	
0.875 T-NOTE 301115	12,050,000.00	9,816,043.02	
1 T-NOTE 241215	6,000,000.00	5,657,343.72	
1 T-NOTE 280731	8,590,000.00	7,405,183.95	
1.125 T-BOND 400515	4,520,000.00	2,951,860.17	

1. 125 T-BOND 400815	5,600,000.00	3,628,078.10	
1. 125 T-NOTE 250115	4,500,000.00	4,240,546.87	
1. 125 T-NOTE 261031	8,100,000.00	7,317,052.70	
1. 125 T-NOTE 270228	1,900,000.00	1,704,025.39	
1. 125 T-NOTE 280229	6,400,000.00	5,607,124.99	
1. 125 T-NOTE 280831	6,900,000.00	5,976,585.97	
1. 125 T-NOTE 310215	11,890,000.00	9,849,193.02	
1. 25 T-BOND 500515	6,750,000.00	3,815,200.17	
1. 25 T-NOTE 240831	1,200,000.00	1,145,929.69	
1. 25 T-NOTE 261130	5,700,000.00	5,160,281.25	
1. 25 T-NOTE 261231	6,150,000.00	5,561,185.52	
1. 25 T-NOTE 280331	5,590,000.00	4,917,562.29	
1. 25 T-NOTE 280430	7,100,000.00	6,234,271.50	
1. 25 T-NOTE 280531	9,650,000.00	8,458,451.19	
1. 25 T-NOTE 280630	6,200,000.00	5,425,726.57	
1. 25 T-NOTE 280930	7,300,000.00	6,353,281.25	
1. 25 T-NOTE 310815	12,760,000.00	10,536,470.33	
1. 375 T-BOND 401115	5,900,000.00	3,977,199.20	
1. 375 T-BOND 500815	7,190,000.00	4,197,443.33	
1. 375 T-NOTE 250131	4,000,000.00	3,780,937.52	
1. 375 T-NOTE 260831	2,200,000.00	2,010,292.96	
1. 375 T-NOTE 281031	4,840,000.00	4,233,487.50	
1. 375 T-NOTE 281231	6,000,000.00	5,232,656.28	
1. 375 T-NOTE 311115	11,930,000.00	9,897,006.79	
1. 5 T-NOTE 240930	4,000,000.00	3,821,250.00	
1. 5 T-NOTE 241031	2,000,000.00	1,906,210.94	
1. 5 T-NOTE 241130	4,000,000.00	3,805,078.12	
1. 5 T-NOTE 250215	5,000,000.00	4,728,906.25	
1. 5 T-NOTE 260815	5,000,000.00	4,591,796.90	
1. 5 T-NOTE 270131	8,700,000.00	7,919,378.92	
1. 5 T-NOTE 281130	6,300,000.00	5,540,677.75	
1. 5 T-NOTE 300215	7,050,000.00	6,078,697.23	
1. 625 T-BOND 501115	7,100,000.00	4,428,902.32	
1. 625 T-NOTE 260215	7,420,000.00	6,903,788.29	
1. 625 T-NOTE 260515	5,600,000.00	5,185,906.25	
1. 625 T-NOTE 260930	1,950,000.00	1,794,076.16	

1. 625 T-NOTE 261031	1, 600, 000. 00	1, 469, 968. 75	
1. 625 T-NOTE 261130	2, 200, 000. 00	2, 018, 027. 35	
1. 625 T-NOTE 290815	4, 900, 000. 00	4, 297, 644. 51	
1. 625 T-NOTE 310515	11, 280, 000. 00	9, 646, 603. 09	
1. 75 T-BOND 410815	7, 900, 000. 00	5, 590, 021. 51	
1. 75 T-NOTE 240630	4, 850, 000. 00	4, 680, 668. 89	
1. 75 T-NOTE 240731	5, 000, 000. 00	4, 814, 746. 10	
1. 75 T-NOTE 241231	4, 000, 000. 00	3, 810, 781. 24	
1. 75 T-NOTE 250315	6, 200, 000. 00	5, 880, 554. 67	
1. 75 T-NOTE 261231	2, 800, 000. 00	2, 577, 039. 05	
1. 75 T-NOTE 290131	5, 100, 000. 00	4, 534, 119. 14	
1. 75 T-NOTE 291115	4, 000, 000. 00	3, 528, 750. 00	
1. 875 T-BOND 410215	7, 220, 000. 00	5, 280, 753. 12	
1. 875 T-BOND 510215	8, 500, 000. 00	5, 653, 330. 10	
1. 875 T-BOND 511115	7, 450, 000. 00	4, 933, 442. 36	
1. 875 T-NOTE 240831	5, 000, 000. 00	4, 809, 082. 05	
1. 875 T-NOTE 260630	2, 700, 000. 00	2, 516, 326. 18	
1. 875 T-NOTE 260731	2, 700, 000. 00	2, 510, 841. 80	
1. 875 T-NOTE 270228	6, 800, 000. 00	6, 264, 500. 00	
1. 875 T-NOTE 290228	5, 500, 000. 00	4, 919, 062. 50	
1. 875 T-NOTE 320215	11, 450, 000. 00	9, 866, 456. 06	
2 T-BOND 411115	6, 410, 000. 00	4, 721, 741. 17	
2 T-BOND 500215	5, 400, 000. 00	3, 721, 886. 71	
2 T-BOND 510815	8, 350, 000. 00	5, 712, 737. 33	
2 T-NOTE 250215	4, 800, 000. 00	4, 580, 343. 74	
2 T-NOTE 250815	5, 150, 000. 00	4, 874, 595. 71	
2 T-NOTE 261115	5, 000, 000. 00	4, 646, 875. 00	
2. 125 T-NOTE 240930	4, 000, 000. 00	3, 852, 031. 24	
2. 125 T-NOTE 241130	4, 000, 000. 00	3, 838, 671. 88	
2. 125 T-NOTE 250515	5, 100, 000. 00	4, 857, 451. 19	
2. 125 T-NOTE 260531	1, 400, 000. 00	1, 314, 687. 50	
2. 25 T-BOND 410515	6, 340, 000. 00	4, 915, 109. 78	
2. 25 T-BOND 460815	4, 000, 000. 00	2, 941, 484. 35	
2. 25 T-BOND 490815	5, 360, 000. 00	3, 915, 417. 16	
2. 25 T-BOND 520215	6, 990, 000. 00	5, 069, 251. 73	
2. 25 T-NOTE 241031	2, 300, 000. 00	2, 214, 109. 37	

2. 25 T-NOTE 241115	4, 800, 000. 00	4, 618, 031. 23	
2. 25 T-NOTE 241231	3, 600, 000. 00	3, 454, 875. 00	
2. 25 T-NOTE 251115	6, 400, 000. 00	6, 069, 500. 03	
2. 25 T-NOTE 260331	3, 250, 000. 00	3, 070, 869. 13	
2. 25 T-NOTE 270215	4, 200, 000. 00	3, 926, 179. 69	
2. 25 T-NOTE 270815	4, 800, 000. 00	4, 461, 374. 97	
2. 25 T-NOTE 271115	4, 200, 000. 00	3, 890, 578. 10	
2. 375 T-BOND 420215	6, 000, 000. 00	4, 699, 687. 50	
2. 375 T-BOND 491115	4, 160, 000. 00	3, 122, 356. 26	
2. 375 T-BOND 510515	8, 150, 000. 00	6, 086, 235. 32	
2. 375 T-NOTE 240815	10, 600, 000. 00	10, 267, 300. 76	
2. 375 T-NOTE 260430	2, 100, 000. 00	1, 988, 601. 55	
2. 375 T-NOTE 270515	5, 800, 000. 00	5, 429, 117. 20	
2. 375 T-NOTE 290331	4, 650, 000. 00	4, 270, 916. 00	
2. 375 T-NOTE 290515	5, 800, 000. 00	5, 319, 800. 77	
2. 5 T-BOND 450215	3, 380, 000. 00	2, 629, 072. 26	
2. 5 T-BOND 460215	2, 760, 000. 00	2, 136, 951. 54	
2. 5 T-BOND 460515	2, 570, 000. 00	1, 988, 587. 69	
2. 5 T-NOTE 250131	2, 700, 000. 00	2, 597, 695. 32	
2. 5 T-NOTE 260228	3, 000, 000. 00	2, 855, 273. 43	
2. 5 T-NOTE 270331	4, 500, 000. 00	4, 238, 525. 38	
2. 625 T-NOTE 250331	3, 900, 000. 00	3, 753, 521. 49	
2. 625 T-NOTE 250415	3, 100, 000. 00	2, 981, 933. 58	
2. 625 T-NOTE 251231	4, 000, 000. 00	3, 824, 687. 52	
2. 625 T-NOTE 260131	1, 600, 000. 00	1, 528, 812. 49	
2. 625 T-NOTE 270531	4, 900, 000. 00	4, 627, 820. 28	
2. 625 T-NOTE 290215	7, 030, 000. 00	6, 550, 394. 69	
2. 625 T-NOTE 290731	4, 500, 000. 00	4, 181, 484. 37	
2. 75 T-BOND 420815	830, 000. 00	688, 170. 49	
2. 75 T-BOND 421115	2, 900, 000. 00	2, 399, 353. 51	
2. 75 T-BOND 470815	4, 340, 000. 00	3, 513, 789. 46	
2. 75 T-BOND 471115	3, 400, 000. 00	2, 753, 269. 54	
2. 75 T-NOTE 250228	5, 000, 000. 00	4, 828, 808. 60	
2. 75 T-NOTE 250515	4, 000, 000. 00	3, 853, 437. 52	
2. 75 T-NOTE 250831	3, 000, 000. 00	2, 883, 750. 00	
2. 75 T-NOTE 270430	6, 200, 000. 00	5, 886, 609. 34	

2.75 T-NOTE 270731	5,400,000.00	5,118,398.41	
2.75 T-NOTE 280215	6,650,000.00	6,283,990.25	
2.75 T-NOTE 290531	5,000,000.00	4,683,007.80	
2.75 T-NOTE 320815	10,600,000.00	9,772,496.03	
2.875 T-BOND 430515	3,320,000.00	2,793,014.83	
2.875 T-BOND 450815	2,500,000.00	2,074,658.19	
2.875 T-BOND 461115	970,000.00	804,285.35	
2.875 T-BOND 490515	5,000,000.00	4,155,371.10	
2.875 T-BOND 520515	6,500,000.00	5,406,806.65	
2.875 T-NOTE 250430	4,800,000.00	4,635,843.74	
2.875 T-NOTE 250531	6,000,000.00	5,793,164.04	
2.875 T-NOTE 250615	4,100,000.00	3,956,660.14	
2.875 T-NOTE 250731	6,000,000.00	5,786,484.36	
2.875 T-NOTE 251130	4,500,000.00	4,330,195.29	
2.875 T-NOTE 280515	6,600,000.00	6,262,523.45	
2.875 T-NOTE 280815	6,160,000.00	5,834,434.39	
2.875 T-NOTE 290430	4,500,000.00	4,245,117.21	
2.875 T-NOTE 320515	12,100,000.00	11,283,486.31	
3 T-BOND 420515	1,590,000.00	1,374,946.28	
3 T-BOND 441115	2,950,000.00	2,510,668.93	
3 T-BOND 450515	1,800,000.00	1,528,699.21	
3 T-BOND 451115	1,610,000.00	1,365,103.89	
3 T-BOND 470215	3,980,000.00	3,372,350.39	
3 T-BOND 470515	2,050,000.00	1,736,694.33	
3 T-BOND 480215	3,880,000.00	3,290,800.76	
3 T-BOND 480815	4,480,000.00	3,800,737.51	
3 T-BOND 490215	4,700,000.00	3,996,560.53	
3 T-BOND 520815	6,300,000.00	5,378,009.74	
3 T-NOTE 240731	6,000,000.00	5,856,679.68	
3 T-NOTE 250715	4,100,000.00	3,965,148.45	
3 T-NOTE 250930	3,500,000.00	3,380,917.96	
3 T-NOTE 251031	3,000,000.00	2,896,406.25	
3.125 T-BOND 411115	1,550,000.00	1,374,504.87	
3.125 T-BOND 420215	1,340,000.00	1,184,408.20	
3.125 T-BOND 430215	2,150,000.00	1,886,415.02	
3.125 T-BOND 440815	3,090,000.00	2,689,084.57	

3. 125 T-BOND 480515	4,460,000.00	3,869,311.31	
3. 125 T-NOTE 250815	7,300,000.00	7,074,583.95	
3. 125 T-NOTE 270831	5,000,000.00	4,808,105.45	
3. 125 T-NOTE 281115	7,900,000.00	7,567,953.12	
3. 125 T-NOTE 290831	3,250,000.00	3,106,035.14	
3. 25 T-BOND 420515	5,100,000.00	4,577,748.06	
3. 25 T-NOTE 240831	4,500,000.00	4,398,662.11	
3. 25 T-NOTE 270630	4,500,000.00	4,350,937.50	
3. 25 T-NOTE 290630	4,100,000.00	3,945,609.37	
3. 375 T-BOND 420815	5,290,000.00	4,829,707.99	
3. 375 T-BOND 440515	2,450,000.00	2,222,465.82	
3. 375 T-BOND 481115	5,900,000.00	5,359,435.56	
3. 375 T-NOTE 330515	4,200,000.00	4,073,671.89	
3. 5 T-BOND 390215	700,000.00	675,541.01	
3. 5 T-NOTE 250915	3,450,000.00	3,369,342.76	
3. 5 T-NOTE 280131	5,400,000.00	5,273,226.57	
3. 5 T-NOTE 280430	5,100,000.00	4,982,062.50	
3. 5 T-NOTE 300131	3,500,000.00	3,417,558.58	
3. 5 T-NOTE 300430	2,500,000.00	2,442,968.75	
3. 5 T-NOTE 330215	9,650,000.00	9,453,984.37	
3. 625 T-BOND 430815	2,500,000.00	2,364,306.64	
3. 625 T-BOND 440215	2,400,000.00	2,264,015.61	
3. 625 T-BOND 530215	6,650,000.00	6,411,535.10	
3. 625 T-BOND 530515	2,050,000.00	1,979,210.93	
3. 625 T-NOTE 260515	4,300,000.00	4,214,167.95	
3. 625 T-NOTE 280331	5,000,000.00	4,911,132.80	
3. 625 T-NOTE 280531	2,300,000.00	2,262,085.92	
3. 625 T-NOTE 300331	4,430,000.00	4,361,473.43	
3. 75 T-BOND 410815	1,900,000.00	1,848,009.76	
3. 75 T-BOND 431115	2,210,000.00	2,126,952.35	
3. 75 T-NOTE 260415	3,900,000.00	3,833,882.83	
3. 875 T-BOND 400815	1,610,000.00	1,607,830.25	
3. 875 T-BOND 430215	4,000,000.00	3,920,000.00	
3. 875 T-BOND 430515	1,500,000.00	1,471,171.87	
3. 875 T-NOTE 250331	10,000,000.00	9,832,421.90	
3. 875 T-NOTE 250430	1,500,000.00	1,475,419.92	

3. 875 T-NOTE 260115	5,100,000.00	5,025,392.55	
3. 875 T-NOTE 271130	4,480,000.00	4,441,674.98	
3. 875 T-NOTE 271231	6,000,000.00	5,949,023.46	
3. 875 T-NOTE 290930	5,150,000.00	5,131,291.02	
3. 875 T-NOTE 291130	3,060,000.00	3,051,393.75	
3. 875 T-NOTE 291231	4,900,000.00	4,887,941.39	
4 T-BOND 421115	3,980,000.00	3,976,890.61	
4 T-BOND 521115	6,340,000.00	6,540,106.24	
4 T-NOTE 251215	1,800,000.00	1,779,117.19	
4 T-NOTE 260215	3,900,000.00	3,855,896.49	
4 T-NOTE 280229	5,400,000.00	5,390,929.67	
4 T-NOTE 291031	2,840,000.00	2,850,428.13	
4 T-NOTE 300228	4,000,000.00	4,022,656.24	
4. 125 T-NOTE 250131	7,200,000.00	7,104,656.23	
4. 125 T-NOTE 270930	5,700,000.00	5,699,666.03	
4. 125 T-NOTE 271031	5,900,000.00	5,901,843.75	
4. 125 T-NOTE 321115	11,590,000.00	11,913,252.28	
4. 25 T-BOND 390515	1,600,000.00	1,683,875.00	
4. 25 T-BOND 401115	1,410,000.00	1,474,964.65	
4. 25 T-NOTE 240930	4,000,000.00	3,954,218.76	
4. 25 T-NOTE 241231	9,000,000.00	8,894,531.25	
4. 25 T-NOTE 251015	3,000,000.00	2,978,144.52	
4. 375 T-BOND 380215	990,000.00	1,059,860.73	
4. 375 T-BOND 391115	1,680,000.00	1,790,250.00	
4. 375 T-BOND 400515	1,050,000.00	1,116,670.89	
4. 375 T-BOND 410515	1,580,000.00	1,672,362.10	
4. 375 T-NOTE 241031	5,000,000.00	4,948,925.80	
4. 5 T-BOND 360215	900,000.00	977,361.32	
4. 5 T-BOND 380515	550,000.00	595,922.84	
4. 5 T-BOND 390815	1,400,000.00	1,515,609.36	
4. 5 T-NOTE 241130	7,000,000.00	6,941,757.83	
4. 5 T-NOTE 251115	8,000,000.00	7,989,375.04	
4. 625 T-BOND 400215	1,330,000.00	1,458,843.75	
4. 625 T-NOTE 250228	7,000,000.00	6,965,546.84	
4. 625 T-NOTE 260315	8,000,000.00	8,043,437.52	
4. 75 T-BOND 410215	1,260,000.00	1,399,067.57	

		5 T-BOND 370515	740,000.00	843,151.94	
		5.25 T-BOND 281115	1,000,000.00	1,057,617.19	
		5.375 T-BOND 310215	520,000.00	573,340.62	
		6 T-BOND 260215	1,100,000.00	1,142,410.15	
		6.125 T-BOND 271115	800,000.00	864,968.75	
		6.25 T-BOND 300515	660,000.00	753,663.27	
アメリカドル合計			1,263,010,000.00	1,138,009,246.23 (163,292,946,741)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	1,200,000.00	1,079,367.28	
		0.5 CAN GOVT 250901	2,500,000.00	2,294,312.70	
		0.5 CAN GOVT 301201	3,300,000.00	2,668,620.33	
		0.75 CAN GOVT 241001	1,750,000.00	1,661,294.16	
		1 CAN GOVT 260901	1,300,000.00	1,184,053.29	
		1 CAN GOVT 270601	600,000.00	540,041.71	
		1.25 CAN GOVT 250301	850,000.00	803,393.87	
		1.25 CAN GOVT 270301	3,200,000.00	2,909,170.97	
		1.25 CAN GOVT 300601	3,270,000.00	2,828,206.32	
		1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	946,239.69	
		1.5 CAN GOVT 260601	1,150,000.00	1,067,864.48	
		1.5 CAN GOVT 310601	3,700,000.00	3,208,753.25	
		1.5 CAN GOVT 311201	3,400,000.00	2,928,177.13	
		1.75 CAN GOVT 531201	3,630,000.00	2,610,275.13	
		2 CAN GOVT 280601	1,000,000.00	927,977.60	
		2 CAN GOVT 320601	2,250,000.00	2,010,201.75	
		2 CAN GOVT 511201	4,860,000.00	3,757,719.82	
		2.25 CAN GOVT 250601	1,600,000.00	1,532,819.61	
		2.25 CAN GOVT 290601	700,000.00	653,986.90	
		2.25 CAN GOVT 291201	400,000.00	371,953.82	
		2.5 CAN GOVT 240601	1,000,000.00	977,395.00	
		2.5 CAN GOVT 321201	2,700,000.00	2,510,189.10	
		2.75 CAN GOVT 240801	2,000,000.00	1,951,480.88	
		2.75 CAN GOVT 270901	2,300,000.00	2,204,081.35	
2.75 CAN GOVT 330601	1,700,000.00	1,613,630.32			
2.75 CAN GOVT 481201	970,000.00	887,452.50			
2.75 CAN GOVT 551201	300,000.00	272,016.17			
2.75 CANADA GOVER 641201	590,000.00	525,324.44			

		3 CAN GOVT 241101	2,000,000.00	1,949,958.82	
		3 CAN GOVT 251001	3,900,000.00	3,778,422.99	
		3.25 CAN GOVT 280901	1,300,000.00	1,272,808.56	
		3.5 CAN GOVT 280301	700,000.00	692,157.37	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,030,000.00	1,062,885.28	
		3.75 CAN GOVT 250201	2,300,000.00	2,262,656.64	
		3.75 CAN GOVT 250501	2,500,000.00	2,459,992.20	
		4 CAN GOVT 410601	960,000.00	1,043,623.74	
		5 CAN GOVT 370601	700,000.00	827,344.09	
		5.75 CAN GOVT 290601	600,000.00	670,750.77	
		5.75 CAN GOVT 330601	910,000.00	1,090,028.59	
カナダドル合計			70,120,000.00	64,036,628.62 (6,976,790,688)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	1,700,000.00	1,607,839.61	
		0.25 AUST GOVT 251121	1,450,000.00	1,324,275.96	
		0.5 AUST GOVT 260921	2,000,000.00	1,789,889.64	
		1 AUST GOVT 301221	2,900,000.00	2,347,220.21	
		1 AUST GOVT 311121	3,000,000.00	2,366,858.46	
		1.25 AUST GOVT 320521	2,610,000.00	2,079,557.82	
		1.5 AUST GOVT 310621	2,550,000.00	2,121,513.63	
		1.75 AUST GOVT 321121	4,400,000.00	3,633,982.04	
		1.75 AUST GOVT 510621	2,150,000.00	1,278,986.90	
		2.25 AUST GOVT 280521	1,400,000.00	1,295,848.63	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,070,000.00	2,801,760.92	
		2.75 AUST GOVT 271121	1,500,000.00	1,428,364.42	
		2.75 AUST GOVT 281121	3,050,000.00	2,875,977.52	
		2.75 AUST GOVT 291121	1,280,000.00	1,193,705.62	
		2.75 AUST GOVT 350621	2,600,000.00	2,281,599.26	
		2.75 AUST GOVT 410521	1,490,000.00	1,213,203.71	
		3 AUST GOVT 331121	2,100,000.00	1,922,997.99	
		3 AUST GOVT 470321	1,380,000.00	1,122,298.58	
		3.25 AUST GOVT 250421	2,200,000.00	2,163,963.62	
		3.25 AUST GOVT 290421	1,800,000.00	1,735,456.05	
3.25 AUST GOVT 390621	1,150,000.00	1,023,557.66			
3.5 AUST GOVT 341221	650,000.00	618,742.43			
3.75 AUST GOVT 340521	2,400,000.00	2,345,609.60			

		3. 75 AUST GOVT 370421	960,000.00	922,911.90	
		4. 25 AUST GOVT 260421	2,950,000.00	2,967,789.38	
		4. 5 AUST GOVT 330421	1,830,000.00	1,905,437.72	
		4. 75 AUST GOVT 270421	2,800,000.00	2,877,140.84	
オーストラリアドル合計			57,370,000.00	51,246,490.12 (4,907,876,358)	
イギリス ポンド	国債証券	0. 125 GILT 260130	1,900,000.00	1,679,684.36	
		0. 125 GILT 280131	1,210,000.00	986,222.60	
		0. 25 GILT 250131	3,250,000.00	2,998,112.00	
		0. 25 GILT 310731	3,850,000.00	2,795,138.50	
		0. 375 GILT 261022	5,000,000.00	4,298,750.00	
		0. 375 GILT 301022	1,670,000.00	1,259,480.60	
		0. 5 GILT 290131	3,780,000.00	3,026,457.00	
		0. 5 GILT 611022	1,720,000.00	530,843.60	
		0. 625 GILT 250607	2,050,000.00	1,881,231.70	
		0. 625 GILT 350731	3,230,000.00	2,106,302.38	
		0. 625 GILT 501022	1,730,000.00	701,013.30	
		0. 875 GILT 291022	1,280,000.00	1,032,706.30	
		0. 875 GILT 330731	2,200,000.00	1,589,104.00	
		0. 875 GILT 460131	2,530,000.00	1,248,460.75	
		1 GILT 320131	3,450,000.00	2,639,422.50	
		1. 125 GILT 390131	2,420,000.00	1,520,530.52	
		1. 125 GILT 731022	1,610,000.00	613,490.50	
		1. 25 GILT 270722	1,700,000.00	1,484,113.60	
		1. 25 GILT 411022	2,380,000.00	1,435,179.34	
		1. 25 GILT 510731	2,620,000.00	1,296,491.28	
		1. 5 GILT 260722	1,370,000.00	1,237,668.96	
		1. 5 GILT 470722	1,860,000.00	1,052,760.00	
		1. 5 GILT 530731	1,170,000.00	607,927.08	
		1. 625 GILT 281022	1,500,000.00	1,295,160.00	
		1. 625 GILT 541022	1,340,000.00	717,568.92	
		1. 625 GILT 711022	1,170,000.00	568,108.00	
		1. 75 GILT 370907	2,100,000.00	1,511,002.92	
1. 75 GILT 490122	1,340,000.00	792,985.20			
1. 75 GILT 570722	2,640,000.00	1,450,996.80			
2 GILT 250907	1,200,000.00	1,120,247.70			

		2.5 GILT 650722	1,930,000.00	1,285,939.70	
		2.75 GILT 240907	1,050,000.00	1,018,342.50	
		3.25 GILT 330131	1,800,000.00	1,653,084.00	
		3.25 GILT 440122	1,900,000.00	1,585,170.00	
		3.5 GILT 251022	1,000,000.00	957,354.84	
		3.5 GILT 450122	2,530,000.00	2,183,263.50	
		3.5 GILT 680722	1,830,000.00	1,571,452.84	
		3.75 GILT 380129	1,500,000.00	1,384,620.00	
		3.75 GILT 520722	1,250,000.00	1,113,029.82	
		3.75 GILT 531022	1,450,000.00	1,286,904.00	
		4 GILT 600122	1,240,000.00	1,175,567.60	
		4 GILT 631022	300,000.00	284,820.00	
		4.125 GILT 270129	2,330,000.00	2,260,216.50	
		4.25 GILT 271207	1,860,000.00	1,825,645.80	
		4.25 GILT 320607	2,210,000.00	2,212,475.20	
		4.25 GILT 360307	1,610,000.00	1,592,257.80	
		4.25 GILT 390907	1,320,000.00	1,287,250.80	
		4.25 GILT 401207	1,730,000.00	1,683,056.88	
		4.25 GILT 461207	1,630,000.00	1,572,582.59	
		4.25 GILT 491207	1,590,000.00	1,536,579.49	
		4.25 GILT 551207	2,190,000.00	2,144,141.40	
		4.5 GILT 340907	1,180,000.00	1,198,788.90	
		4.5 GILT 421207	2,050,000.00	2,058,343.50	
		4.75 GILT 301207	2,070,000.00	2,128,270.50	
		4.75 GILT 381207	1,840,000.00	1,902,710.14	
		5 GILT 250307	1,830,000.00	1,822,682.56	
		6 GILT 281207	900,000.00	959,958.00	
		イギリスポンド合計	109,390,000.00	87,161,669.27 (15,923,565,358)	
シンガポ ールドル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	550,000.00	515,350.00	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1,250,000.00	1,127,500.00	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	990,000.00	885,060.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	460,000.00	416,840.50	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,000,000.00	967,200.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,000,000.00	937,500.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	800,000.00	783,908.00	

		2. 375 SINGAPORGOV 390701	250,000.00	239,808.75
		2. 625 SINGAPORGOV 280501	250,000.00	244,853.75
		2. 625 SINGAPORGOV 320801	400,000.00	387,816.00
		2. 75 SINGAPORGOVT 420401	700,000.00	725,007.50
		2. 75 SINGAPORGOVT 460301	660,000.00	692,340.00
		2. 875 SINGAPORGOV 270901	1,100,000.00	1,089,990.00
		2. 875 SINGAPORGOV 290701	950,000.00	940,785.00
		2. 875SINGAPORGOVT 300901	800,000.00	792,160.00
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,500,000.00	1,487,564.28
		3 SINGAPORGOVT 720801	270,000.00	323,055.00
		3. 375 SINGAPORGOV 330901	600,000.00	620,700.00
		3. 5 SINGAPORGOVT 270301	570,000.00	575,985.00
シンガポールドル合計			14,100,000.00	13,753,423.78 (1,460,476,071)
マレーシア アリンギ ット	国債証券	2. 632 MALAYSIAGOV 310415	1,500,000.00	1,372,673.80
		3. 502MALAYSIAGOVT 270531	1,000,000.00	995,852.15
		3. 582 MALAYSIAGOV 320715	2,300,000.00	2,254,089.90
		3. 733 MALAYSIAGO 280615	2,300,000.00	2,307,091.36
		3. 757 MALAYSIAGOV 400522	2,500,000.00	2,361,242.82
		3. 828 MALAYSIAGOV 340705	1,000,000.00	982,143.00
		3. 844 MALAYSIAGOV 330415	1,950,000.00	1,938,705.24
		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	3,000,000.00	3,026,518.80
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	2,500,000.00	2,511,026.25
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	4,500,000.00	4,545,877.05
		3. 9 MALAYSIAGOVT 261130	1,500,000.00	1,516,984.80
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	1,500,000.00	1,518,328.50
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	3,000,000.00	3,029,070.90
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	3,100,000.00	3,001,489.87
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	1,200,000.00	1,220,861.76
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	3,000,000.00	3,073,576.20
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	1,700,000.00	1,777,216.04
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	3,600,000.00	3,735,537.12
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	2,300,000.00	2,443,675.48
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	2,500,000.00	2,655,907.25
4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1,200,000.00	1,279,508.40		
4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4,100,000.00	4,383,960.67		

		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	700,000.00	764,031.38
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	1,640,000.00	1,808,245.96
		4. 935 MALAYSIAGOV 430930	1,400,000.00	1,525,396.46
マレーシアリングット合計			54,990,000.00	56,029,011.16 (1,719,171,766)
ニュージーランドドル	国債証券	0. 25 NZ GOVT 280515	1,400,000.00	1,140,421.04
		1. 75 NZ GOVT 410515	600,000.00	386,286.48
		2 NZ GOVT 320515	1,200,000.00	979,458.25
		2. 75 NZ GOVT 250415	900,000.00	863,320.88
		2. 75 NZ GOVT 370415	1,100,000.00	888,975.24
		2. 75 NZ GOVT 510515	700,000.00	496,318.50
		3 NZ GOVT 290420	800,000.00	738,418.76
		3. 5 NZ GOVT 330414	700,000.00	642,561.45
		4. 5 NZ GOVT 270415	800,000.00	796,595.29
ニュージーランドドル合計			8,200,000.00	6,932,355.89 (612,265,672)
スウェーデンクローネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	5,300,000.00	4,381,817.08
		0. 75 SWD GOVT 280512	4,000,000.00	3,635,545.96
		0. 75 SWD GOVT 291112	12,700,000.00	11,305,129.65
		1 SWD GOVT 261112	6,150,000.00	5,749,046.44
		1. 75 SWD GOVT 331111	2,000,000.00	1,852,139.52
		2. 25 SWD GOVT 320601	5,500,000.00	5,348,988.37
		2. 5 SWD GOVT 250512	7,200,000.00	7,080,070.10
		3. 5 SWD GOVT 390330	6,050,000.00	6,614,586.00
スウェーデンクローネ合計			48,900,000.00	45,967,323.12 (615,962,129)
ノルウェークローネ	国債証券	1. 25 NORWE GOVT 310917	3,800,000.00	3,191,213.40
		1. 375 NORWE GOVT 300819	5,400,000.00	4,674,241.08
		1. 5 NORWE GOVT 260219	2,850,000.00	2,684,272.50
		1. 75 NORWE GOVT 250313	6,300,000.00	6,066,742.50
		1. 75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	3,971,943.75
		1. 75 NORWE GOVT 290906	3,500,000.00	3,152,964.50
		2 NORWE GOVT 280426	2,650,000.00	2,460,037.40
		2. 125 NORWE GOVT 320518	6,800,000.00	6,087,380.40
		3 NORWE GOVT 330815	4,000,000.00	3,839,522.40
ノルウェークローネ合計			39,550,000.00	36,128,317.93

				(479,784,062)
デンマーク クローネ	国債証券	0 DMK GOVT 241115	3,500,000.00	3,342,850.45
		0 DMK GOVT 311115	8,400,000.00	6,786,962.28
		0.25 DMK GOVT 521115	6,400,000.00	3,403,741.81
		0.5 DMK GOVT 271115	6,900,000.00	6,274,205.19
		0.5 DMK GOVT 291115	7,300,000.00	6,400,713.00
		1.75 DMK GOVT 251115	5,500,000.00	5,333,379.70
		4.5 DMK GOVT 391115	12,320,000.00	15,270,492.16
デンマーククローネ合計			50,320,000.00	46,812,344.59 (983,527,359)
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	26,750,000.00	26,587,364.28
		10 MEXICAN BONOS 361120	8,000,000.00	8,866,800.00
		5 MEXICAN BONOS 250306	23,000,000.00	21,248,320.00
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	20,000,000.00	17,859,200.00
		5.75 MEXICAN BONO 260305	61,350,000.00	56,114,135.78
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	39,750,000.00	37,897,252.50
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	7,000,000.00	6,479,270.00
		7.75 MEXICAN BONO 310529	52,000,000.00	49,428,600.00
		7.75 MEXICAN BONO 341123	10,800,000.00	10,115,928.00
		7.75 MEXICAN BONO 421113	37,100,000.00	33,214,517.00
		8 MEXICAN BONOS 240905	18,000,000.00	17,440,600.14
		8 MEXICAN BONOS 471107	32,700,000.00	29,870,142.00
		8 MEXICAN BONOS 530731	9,000,000.00	8,115,930.00
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	34,900,000.00	34,735,272.00
8.5 MEXICAN BONOS 381118	18,200,000.00	17,671,654.00		
メキシコペソ合計			398,550,000.00	375,644,985.70 (3,146,890,738)
イスラエル シェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	4,000,000.00	3,747,000.00
		0.5 ISRAEL FIXED 260227	1,800,000.00	1,654,380.00
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,800,000.00	3,209,670.00
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1,500,000.00	1,235,325.00
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	1,800,000.00	1,348,560.00
		1.75 ISRAEL FIXED 250831	1,800,000.00	1,738,710.00
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	2,500,000.00	2,355,625.00
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	2,000,000.00	1,906,200.00
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	636,360.00

		3.75 ISRAEL FIXED 470331	3,550,000.00	3,437,287.50	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	1,510,000.00	1,849,523.50	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	700,000.00	780,290.00	
イスラエルシェケル合計			25,760,000.00	23,898,931.00	(945,984,216)
ポーランド ドズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	4,000,000.00	3,342,800.00	
		0.75 POLAND 250425	1,000,000.00	914,600.00	
		1.25 POLAND 301025	4,400,000.00	3,260,180.00	
		1.75 POLAND 320425	4,000,000.00	2,906,400.00	
		2.25 POLAND 241025	4,000,000.00	3,813,200.00	
		2.5 POLAND 260725	9,800,000.00	8,909,866.00	
		2.5 POLAND 270725	2,300,000.00	2,033,430.00	
		2.75 POLAND 280425	3,700,000.00	3,243,457.00	
		2.75 POLAND 291025	7,100,000.00	6,032,870.00	
		3.25 POLAND 250725	3,550,000.00	3,373,582.75	
		3.75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,711,920.00	
		5.75 POLAND 290425	1,400,000.00	1,408,610.00	
		7.5 POLAND 280725	2,000,000.00	2,154,451.00	
ポーランドズロチ合計			51,250,000.00	45,105,366.75	(1,589,377,808)
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 240915	10,000,000.00	9,985,283.50	
		1.99 CHINA GOVT 250409	20,000,000.00	19,927,200.00	
		2.18 CHINA GOVT 240625	25,000,000.00	25,026,887.50	
		2.18 CHINA GOVT 250825	16,000,000.00	15,971,008.32	
		2.24 CHINA GOVT 250525	9,000,000.00	9,002,286.90	
		2.26 CHINA GOVT 250224	10,000,000.00	10,005,170.00	
		2.28 CHINA GOVT 251125	12,000,000.00	11,999,175.12	
		2.29 CHINA GOVT 241225	14,000,000.00	14,028,182.00	
		2.3 CHINA GOVT 260515	12,000,000.00	12,003,123.60	
		2.35 CHINA GOVT 250315	23,000,000.00	23,069,483.00	
		2.37 CHINA GOVT 270120	21,000,000.00	20,969,744.67	
		2.44 CHINA GOVT 271015	13,000,000.00	12,986,150.58	
		2.46 CHINA GOVT 260215	17,000,000.00	17,077,234.40	
		2.47 CHINA GOVT 240902	10,000,000.00	10,045,537.00	
		2.48 CHINA GOVT 270415	8,000,000.00	8,010,590.40	
2.5 CHINA GOVT 270725	18,000,000.00	18,029,143.80			

2. 6 CHINA GOVT 320901	13,000,000.00	12,861,754.10	
2. 62 CHINA GOVT 280415	10,000,000.00	10,067,238.00	
2. 62 CHINA GOVT 290925	12,000,000.00	11,979,314.04	
2. 64 CHINA GOVT 280115	20,000,000.00	20,138,598.00	
2. 67 CHINA GOVT 330525	4,000,000.00	4,004,321.20	
2. 68 CHINA GOVT 300521	21,000,000.00	21,026,766.60	
2. 69 CHINA GOVT 260812	21,000,000.00	21,211,896.30	
2. 69 CHINA GOVT 320815	13,000,000.00	12,954,888.18	
2. 74 CHINA GOVT 260804	5,000,000.00	5,057,525.50	
2. 75 CHINA GOVT 290615	15,000,000.00	15,100,414.50	
2. 75 CHINA GOVT 320217	13,000,000.00	13,019,830.20	
2. 76 CHINA GOVT 320515	13,000,000.00	13,050,856.00	
2. 79 CHINA GOVT 291215	14,000,000.00	14,099,195.60	
2. 8 CHINA GOVT 290324	16,000,000.00	16,187,793.60	
2. 8 CHINA GOVT 300325	15,000,000.00	15,125,157.00	
2. 8 CHINA GOVT 321115	13,000,000.00	13,063,382.80	
2. 85 CHINA GOVT 270604	15,000,000.00	15,231,540.00	
2. 88 CHINA GOVT 330225	15,000,000.00	15,242,155.50	
2. 89 CHINA GOVT 311118	12,000,000.00	12,148,653.60	
2. 9 CHINA GOVT 260505	2,000,000.00	2,031,950.60	
2. 91 CHINA GOVT 281014	20,000,000.00	20,388,058.00	
2. 94 CHINA GOVT 241017	9,000,000.00	9,103,077.90	
2. 99 CHINA GOVT 251015	3,000,000.00	3,050,131.50	
3. 01 CHINA GOVT 280513	16,000,000.00	16,393,216.00	
3. 02 CHINA GOVT 251022	22,000,000.00	22,395,104.60	
3. 02 CHINA GOVT 310527	18,000,000.00	18,444,528.00	
3. 03 CHINA GOVT 260311	19,000,000.00	19,376,437.50	
3. 12 CHINA GOVT 261205	10,000,000.00	10,254,476.00	
3. 12 CHINA GOVT 521025	9,000,000.00	9,059,203.80	
3. 13 CHINA GOVT 291121	16,000,000.00	16,498,657.60	
3. 19 CHINA GOVT 530415	2,000,000.00	2,056,885.80	
3. 22 CHINA GOVT 251206	15,000,000.00	15,351,067.50	
3. 25 CHINA GOVT 260606	17,000,000.00	17,487,276.10	
3. 25 CHINA GOVT 281122	8,000,000.00	8,338,176.80	
3. 27 CHINA GOVT 301119	21,000,000.00	22,052,730.00	
3. 28 CHINA GOVT 271203	12,000,000.00	12,438,471.60	

		3. 29 CHINA GOVT 290523	15,000,000.00	15,665,367.00	
		3. 32 CHINA GOVT 520415	10,000,000.00	10,377,158.00	
		3. 39 CHINA GOVT 500316	17,000,000.00	17,793,276.10	
		3. 52 CHINA GOVT 270504	4,000,000.00	4,185,026.40	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	10,000,000.00	10,755,513.00	
		3. 54 CHINA GOVT 280816	7,000,000.00	7,401,067.10	
		3. 57 CHINA GOVT 240622	9,000,000.00	9,149,503.50	
		3. 59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,356,192.90	
		3. 6 CHINA GOVT 250906	9,000,000.00	9,303,073.20	
		3. 61 CHINA GOVT 250607	7,000,000.00	7,221,648.70	
		3. 69 CHINA GOVT 240921	4,000,000.00	4,094,638.40	
		3. 69 CHINA GOVT 280517	14,000,000.00	14,930,463.80	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	8,000,000.00	8,880,459.20	
		3. 77 CHINA GOVT 250308	2,000,000.00	2,062,986.20	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	16,000,000.00	17,998,417.60	
		3. 86 CHINA GOVT 490722	13,000,000.00	14,698,203.00	
		4. 08 CHINA GOVT 481022	12,000,000.00	13,990,725.60	
中国元合計			881,000,000.00	900,290,650.51 (17,981,145,046)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	2,000,000.00	1,932,286.00	
		0 AUSTRIA GOVT 250420	1,000,000.00	944,339.00	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	700,000.00	601,593.30	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	1,250,000.00	1,033,921.25	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	1,300,000.00	1,042,983.50	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	720,000.00	427,089.60	
		0 BEL GOVT 271022	800,000.00	708,294.40	
		0 BEL GOVT 311022	1,350,000.00	1,063,446.30	
		0 BUND 260815	3,700,000.00	3,401,114.00	
		0 BUND 271115	2,150,000.00	1,927,636.25	
		0 BUND 281115	2,880,000.00	2,532,251.52	
		0 BUND 290815	2,700,000.00	2,337,606.00	
		0 BUND 300215	4,100,000.00	3,513,806.60	
		0 BUND 300815	3,750,000.00	3,180,881.25	
		0 BUND 300815	1,200,000.00	1,019,826.00	
		0 BUND 310215	3,670,000.00	3,079,577.74	
		0 BUND 310815	3,370,000.00	2,799,485.96	

0 BUND 310815	850,000.00	706,810.70	
0 BUND 320215	4,050,000.00	3,325,916.70	
0 BUND 350515	2,420,000.00	1,825,950.50	
0 BUND 360515	3,370,000.00	2,474,708.95	
0 BUND 500815	4,880,000.00	2,623,766.16	
0 BUND 500815	840,000.00	453,165.72	
0 BUND 520815	2,100,000.00	1,075,273.50	
0 FINNISH GOVT 240915	400,000.00	384,302.08	
0 FINNISH GOVT 260915	420,000.00	382,971.12	
0 FINNISH GOVT 300915	400,000.00	326,698.00	
0 IRISH GOVT 311018	750,000.00	600,999.00	
0 ITALY GOVT 240815	1,500,000.00	1,439,733.61	
0 ITALY GOVT 241215	1,300,000.00	1,233,375.96	
0 ITALY GOVT 260401	3,200,000.00	2,899,369.60	
0 ITALY GOVT 260801	1,800,000.00	1,612,933.20	
0 NETH GOVT 260115	2,200,000.00	2,041,065.18	
0 NETH GOVT 270115	2,200,000.00	1,993,362.80	
0 NETH GOVT 290115	2,180,000.00	1,881,412.37	
0 NETH GOVT 300715	1,500,000.00	1,249,410.00	
0 NETH GOVT 310715	1,850,000.00	1,503,412.86	
0 NETH GOVT 380115	1,200,000.00	808,704.00	
0 NETH GOVT 520115	1,920,000.00	936,193.92	
0 O. A. T 250225	4,350,000.00	4,123,691.25	
0 O. A. T 250325	5,300,000.00	5,014,436.00	
0 O. A. T 260225	4,200,000.00	3,877,956.60	
0 O. A. T 270225	4,300,000.00	3,872,876.70	
0 O. A. T 291125	3,900,000.00	3,274,714.95	
0 O. A. T 301125	5,820,000.00	4,750,679.76	
0 O. A. T 311125	5,200,000.00	4,124,884.40	
0 O. A. T 320525	3,060,000.00	2,389,593.78	
0 OBL 241018	3,500,000.00	3,354,181.25	
0 OBL 250411	1,000,000.00	946,821.00	
0 OBL 251010	3,200,000.00	2,992,368.00	
0 OBL 251010	900,000.00	842,976.54	
0 OBL 260410	3,200,000.00	2,960,438.40	
0 OBL 261009	1,750,000.00	1,602,029.45	

0 OBL 270416	2,000,000.00	1,812,546.00	
0 SPAIN GOVT 240531	1,300,000.00	1,258,640.50	
0 SPAIN GOVT 250131	2,000,000.00	1,898,022.00	
0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,345,114.00	
0 SPAIN GOVT 260131	2,700,000.00	2,485,255.50	
0 SPAIN GOVT 270131	1,900,000.00	1,697,494.20	
0 SPAIN GOVT 280131	2,600,000.00	2,256,085.00	
0.1 BEL GOVT 300622	1,370,000.00	1,137,087.67	
0.1 SPAIN GOVT 310430	2,500,000.00	1,973,015.00	
0.125 FINNISH GOV 310915	500,000.00	400,423.50	
0.125 FINNISH GOV 360415	800,000.00	554,348.80	
0.125 FINNISH GOV 520415	580,000.00	274,149.76	
0.2 IRISH GOVT 270515	830,000.00	748,620.99	
0.2 IRISH GOVT 301018	1,200,000.00	998,883.60	
0.2 SCHATS 240614	1,000,000.00	969,931.50	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	1,350,000.00	942,096.15	
0.25 BUND 270215	5,800,000.00	5,327,613.20	
0.25 BUND 280815	4,320,000.00	3,868,404.48	
0.25 BUND 290215	2,800,000.00	2,485,800.80	
0.25 FINNISH GOVT 400915	390,000.00	244,992.54	
0.25 ITALY GOVT 280315	4,400,000.00	3,772,269.24	
0.25 NETH GOVT 250715	2,250,000.00	2,125,252.35	
0.25 NETH GOVT 290715	960,000.00	833,287.68	
0.25 O.A.T 261125	4,450,000.00	4,068,013.11	
0.25 SPAIN GOVT 240730	2,400,000.00	2,316,897.60	
0.35 BEL GOVT 320622	1,900,000.00	1,515,643.30	
0.35 IRISH GOVT 321018	700,000.00	564,364.92	
0.35 ITALY GOVT 250201	3,200,000.00	3,038,345.60	
0.4 BEL GOVT 400622	1,160,000.00	728,198.12	
0.4 IRISH GOVT 350515	550,000.00	414,290.25	
0.4 SCHATS 240913	2,000,000.00	1,931,971.60	
0.45 ITALY GOVT 290215	1,500,000.00	1,259,256.00	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,440,000.00	1,314,871.20	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	2,300,000.00	2,016,331.80	
0.5 BEL GOVT 241022	1,400,000.00	1,349,199.60	
0.5 BUND 250215	3,150,000.00	3,019,057.65	

0.5 BUND 260215	3,450,000.00	3,245,956.65	
0.5 BUND 270815	3,260,000.00	3,001,048.42	
0.5 BUND 280215	4,500,000.00	4,113,558.00	
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,050,000.00	981,627.15	
0.5 FINNISH GOVT 270915	1,100,000.00	997,586.70	
0.5 FINNISH GOVT 280915	1,000,000.00	888,051.00	
0.5 FINNISH GOVT 290915	480,000.00	417,090.12	
0.5 FINNISH GOVT 430415	610,000.00	382,251.27	
0.5 ITALY GOVT 260201	2,000,000.00	1,847,466.00	
0.5 ITALY GOVT 280715	1,400,000.00	1,202,451.60	
0.5 NETH GOVT 260715	1,550,000.00	1,443,317.53	
0.5 NETH GOVT 320715	1,320,000.00	1,095,994.60	
0.5 NETH GOVT 400115	1,610,000.00	1,137,062.50	
0.5 O. A. T 250525	5,100,000.00	4,847,990.79	
0.5 O. A. T 260525	5,400,000.00	5,028,998.40	
0.5 O. A. T 290525	5,580,000.00	4,897,192.14	
0.5 O. A. T 400525	2,870,000.00	1,879,824.17	
0.5 O. A. T 440625	1,610,000.00	957,233.22	
0.5 O. A. T 720525	1,100,000.00	434,109.50	
0.5 SPAIN GOVT 300430	2,800,000.00	2,352,084.00	
0.5 SPAIN GOVT 311031	2,670,000.00	2,149,072.32	
0.55 IRISH GOVT 410422	430,000.00	281,108.63	
0.6 ITALY GOVT 310801	2,230,000.00	1,742,997.72	
0.6 SPAIN GOVT 291031	2,750,000.00	2,357,480.47	
0.65 BEL GOVT 710622	570,000.00	238,220.29	
0.7 AUSTRIA GOVT 710420	450,000.00	205,954.20	
0.7 SPAIN GOVT 320430	1,950,000.00	1,576,434.60	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	2,800,000.00	2,606,052.40	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,150,000.00	1,043,818.20	
0.75 AUSTRIA GOVT 510320	1,490,000.00	867,972.68	
0.75 FINNISH GOVT 310415	900,000.00	769,429.80	
0.75 NETH GOVT 270715	1,750,000.00	1,616,719.30	
0.75 NETH GOVT 280715	1,400,000.00	1,273,160.00	
0.75 O. A. T 280225	7,270,000.00	6,615,431.01	
0.75 O. A. T 280525	6,070,000.00	5,502,933.00	
0.75 O. A. T 281125	5,120,000.00	4,603,738.46	

0.75 O. A. T 520525	3,920,000.00	2,143,377.60	
0.75 O. A. T 530525	3,380,000.00	1,805,623.71	
0.8 BEL GOVT 250622	2,900,000.00	2,771,786.65	
0.8 BEL GOVT 270622	1,190,000.00	1,097,335.89	
0.8 BEL GOVT 280622	1,500,000.00	1,362,138.00	
0.8 SPAIN GOVT 270730	2,600,000.00	2,369,190.20	
0.8 SPAIN GOVT 290730	2,700,000.00	2,352,161.70	
0.85 AUSTRIA GOVT 200630	450,000.00	187,222.50	
0.85 ITALY GOVT 270115	1,300,000.00	1,183,980.20	
0.85 SPAIN GOVT 370730	1,770,000.00	1,240,791.91	
0.875 FINNISH GOV 250915	500,000.00	476,745.00	
0.9 AUSTRIA GOVT 320220	1,300,000.00	1,100,456.50	
0.9 BEL GOVT 290622	2,300,000.00	2,063,394.40	
0.9 IRISH GOVT 280515	950,000.00	869,085.88	
0.9 ITALY GOVT 310401	5,600,000.00	4,539,421.60	
0.95 ITALY GOVT 270915	2,250,000.00	2,023,121.07	
0.95 ITALY GOVT 300801	1,150,000.00	953,517.90	
0.95 ITALY GOVT 311201	2,100,000.00	1,675,153.20	
0.95 ITALY GOVT 320601	2,170,000.00	1,706,596.50	
0.95 ITALY GOVT 370301	1,550,000.00	1,051,853.57	
1 BEL GOVT 260622	3,800,000.00	3,587,773.04	
1 BEL GOVT 310622	1,900,000.00	1,649,032.80	
1 BUND 240815	2,500,000.00	2,436,865.30	
1 BUND 250815	3,200,000.00	3,068,243.20	
1 BUND 380515	1,530,000.00	1,252,136.70	
1 IRISH GOVT 260515	1,550,000.00	1,467,883.79	
1 O. A. T 251125	4,200,000.00	4,000,920.00	
1 O. A. T 270525	4,500,000.00	4,190,238.00	
1 SPAIN GOVT 420730	1,020,000.00	648,467.04	
1 SPAIN GOVT 501031	2,040,000.00	1,101,691.80	
1.1 IRISH GOVT 290515	820,000.00	746,801.88	
1.1 ITALY GOVT 270401	2,300,000.00	2,102,403.09	
1.125 FINNISH GOV 340415	580,000.00	482,834.05	
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	400,000.00	383,573.00	
1.2 ITALY GOVT 250815	900,000.00	855,531.33	
1.2 SPAIN GOVT 401031	2,250,000.00	1,547,055.00	

1. 25 BEL GOVT 330422	970,000.00	834,783.94	
1. 25 BUND 480815	3,260,000.00	2,589,219.14	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2,200,000.00	2,038,341.80	
1. 25 O. A. T 340525	4,200,000.00	3,543,099.00	
1. 25 O. A. T 360525	4,660,000.00	3,777,116.40	
1. 25 O. A. T 380525	1,300,000.00	1,011,862.28	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	2,630,000.00	2,304,449.22	
1. 3 IRISH GOVT 330515	630,000.00	549,794.70	
1. 3 OBL 271015	2,970,000.00	2,820,013.59	
1. 3 OBL 271015	1,000,000.00	952,145.00	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	3,400,000.00	3,202,504.20	
1. 35 IRISH GOVT 310318	920,000.00	834,541.20	
1. 35 ITALY GOVT 300401	2,200,000.00	1,894,239.60	
1. 375 FINNISH GOV 270415	300,000.00	283,678.80	
1. 375 FINNISH GOV 470415	450,000.00	331,897.60	
1. 4 BEL GOVT 530622	930,000.00	595,369.26	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	2,750,000.00	2,540,530.57	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	3,450,000.00	3,175,588.51	
1. 45 BEL GOVT 370622	610,000.00	493,429.00	
1. 45 ITALY GOVT 241115	2,100,000.00	2,039,112.60	
1. 45 ITALY GOVT 250515	1,300,000.00	1,249,735.50	
1. 45 ITALY GOVT 360301	1,580,000.00	1,177,453.92	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	2,850,000.00	2,657,106.30	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	1,640,000.00	1,496,785.21	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	570,000.00	278,535.06	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1,060,000.00	785,531.76	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	310,000.00	187,499.40	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	700,000.00	621,489.40	
1. 5 IRISH GOVT 500515	990,000.00	699,019.20	
1. 5 ITALY GOVT 250601	2,280,000.00	2,190,177.12	
1. 5 ITALY GOVT 450430	1,100,000.00	686,246.00	
1. 5 O. A. T 310525	7,870,000.00	7,180,257.46	
1. 5 O. A. T 500525	3,510,000.00	2,447,624.79	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	2,550,000.00	2,400,126.09	
1. 6 BEL GOVT 470622	1,360,000.00	977,168.60	
1. 6 ITALY GOVT 260601	2,550,000.00	2,410,586.40	

1. 6 SPAIN GOVT 250430	1, 700, 000. 00	1, 648, 653. 20	
1. 65 AUSTRIA GOVT 241021	680, 000. 00	666, 102. 84	
1. 65 ITALY GOVT 301201	2, 130, 000. 00	1, 843, 855. 80	
1. 65 ITALY GOVT 320301	3, 000, 000. 00	2, 534, 244. 00	
1. 7 BEL GOVT 500622	1, 320, 000. 00	942, 031. 96	
1. 7 BUND 320815	2, 700, 000. 00	2, 563, 288. 20	
1. 7 IRISH GOVT 370515	900, 000. 00	763, 320. 60	
1. 7 ITALY GOVT 510901	2, 330, 000. 00	1, 413, 072. 22	
1. 75 ITALY GOVT 240701	2, 000, 000. 00	1, 961, 665. 24	
1. 75 O. A. T 241125	3, 700, 000. 00	3, 621, 878. 20	
1. 75 O. A. T 390625	4, 070, 000. 00	3, 388, 718. 63	
1. 75 O. A. T 660525	2, 160, 000. 00	1, 482, 846. 48	
1. 8 BUND 530815	1, 630, 000. 00	1, 422, 804. 18	
1. 8 ITALY GOVT 410301	2, 130, 000. 00	1, 508, 272. 17	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	260, 000. 00	204, 952. 80	
1. 85 ITALY GOVT 250701	1, 600, 000. 00	1, 546, 294. 40	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	2, 530, 000. 00	2, 137, 872. 77	
1. 9 BEL GOVT 380622	870, 000. 00	734, 701. 95	
1. 9 SPAIN GOVT 521031	1, 850, 000. 00	1, 231, 059. 93	
1. 95 SPAIN GOVT 260430	1, 500, 000. 00	1, 448, 854. 50	
1. 95 SPAIN GOVT 300730	3, 000, 000. 00	2, 773, 378. 39	
2 AUSTRIA GOVT 260715	500, 000. 00	485, 484. 87	
2 IRISH GOVT 450218	1, 220, 000. 00	997, 374. 40	
2 ITALY GOVT 251201	1, 400, 000. 00	1, 348, 615. 80	
2 ITALY GOVT 280201	1, 750, 000. 00	1, 635, 029. 56	
2 NETH GOVT 240715	900, 000. 00	887, 940. 90	
2 NETH GOVT 540115	780, 000. 00	677, 394. 90	
2 O. A. T 321125	6, 050, 000. 00	5, 634, 927. 65	
2 O. A. T 480525	3, 060, 000. 00	2, 429, 018. 20	
2. 05 ITALY GOVT 270801	1, 820, 000. 00	1, 716, 358. 28	
2. 1 AUSTRIA GOVT 170920	780, 000. 00	577, 236. 66	
2. 1 BUND 291115	2, 000, 000. 00	1, 963, 852. 40	
2. 1 ITALY GOVT 260715	1, 400, 000. 00	1, 340, 754. 80	
2. 15 BEL GOVT 660622	830, 000. 00	625, 760. 24	
2. 15 ITALY GOVT 520901	850, 000. 00	563, 169. 20	
2. 15 ITALY GOVT 720301	970, 000. 00	578, 748. 85	

2.15 SPAIN GOVT 251031	2,700,000.00	2,636,660.70	
2.2 ITALY GOVT 270601	3,400,000.00	3,233,655.00	
2.2 OBL 280413	1,150,000.00	1,134,181.75	
2.2 SCHATS 241212	2,100,000.00	2,069,625.60	
2.25 BEL GOVT 570622	800,000.00	631,912.80	
2.25 ITALY GOVT 360901	1,960,000.00	1,601,880.98	
2.3 BUND 330215	3,850,000.00	3,833,937.80	
2.3 BUND 330215	700,000.00	697,903.78	
2.35 SPAIN GOVT 330730	2,080,000.00	1,910,064.00	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	660,000.00	623,755.44	
2.4 IRISH GOVT 300515	540,000.00	529,404.12	
2.45 ITALY GOVT 330901	1,900,000.00	1,670,964.50	
2.45 ITALY GOVT 500901	1,130,000.00	818,023.95	
2.5 BUND 440704	2,830,000.00	2,859,168.81	
2.5 BUND 460815	4,470,000.00	4,556,154.78	
2.5 ITALY GOVT 241201	1,500,000.00	1,476,445.35	
2.5 ITALY GOVT 251115	2,500,000.00	2,439,625.00	
2.5 ITALY GOVT 321201	1,440,000.00	1,289,304.00	
2.5 NETH GOVT 300115	600,000.00	593,434.80	
2.5 NETH GOVT 330115	1,750,000.00	1,728,475.00	
2.5 NETH GOVT 330715	750,000.00	740,694.00	
2.5 O. A. T 260924	2,000,000.00	1,968,456.00	
2.5 O. A. T 300525	7,000,000.00	6,890,431.38	
2.5 O. A. T 430525	650,000.00	580,609.38	
2.5 SCHATS 250313	3,600,000.00	3,561,094.80	
2.55 SPAIN GOVT 321031	3,900,000.00	3,678,210.90	
2.6 BEL GOVT 240622	700,000.00	694,281.00	
2.625 FINNISH GOV 420704	480,000.00	453,122.88	
2.65 ITALY GOVT 271201	2,090,000.00	2,011,562.30	
2.7 ITALY GOVT 470301	2,100,000.00	1,645,098.00	
2.7 SPAIN GOVT 481031	2,240,000.00	1,856,512.00	
2.75 BEL GOVT 390422	500,000.00	468,913.50	
2.75 FINNISH GOVT 280704	590,000.00	588,348.00	
2.75 FINNISH GOVT 380415	430,000.00	412,625.50	
2.75 NETH GOVT 470115	2,360,000.00	2,408,167.60	
2.75 O. A. T 271025	3,980,000.00	3,965,035.20	

2.75 SPAIN GOVT 241031	3,700,000.00	3,673,945.52	
2.8 ITALY GOVT 281201	3,610,000.00	3,472,693.65	
2.8 ITALY GOVT 290615	2,000,000.00	1,909,412.00	
2.8 ITALY GOVT 670301	980,000.00	704,313.27	
2.8 SPAIN GOVT 260531	2,500,000.00	2,467,392.50	
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	1,000,000.00	994,079.00	
2.9 SPAIN GOVT 461031	1,970,000.00	1,712,718.00	
2.95 ITALY GOVT 380901	1,490,000.00	1,291,549.88	
3 BEL GOVT 330622	650,000.00	649,927.62	
3 BEL GOVT 340622	740,000.00	736,842.65	
3 IRISH GOVT 431018	260,000.00	257,077.86	
3 ITALY GOVT 290801	2,250,000.00	2,173,428.00	
3 O. A. T 330525	600,000.00	606,378.00	
3 O. A. T 540525	500,000.00	473,880.50	
3.1 ITALY GOVT 400301	1,570,000.00	1,366,917.36	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	630,000.00	638,561.07	
3.15 SPAIN GOVT 330430	2,500,000.00	2,466,190.00	
3.25 BUND 420704	2,110,000.00	2,354,601.32	
3.25 ITALY GOVT 380301	1,000,000.00	900,314.09	
3.25 ITALY GOVT 460901	2,560,000.00	2,209,687.85	
3.25 O. A. T 450525	4,070,000.00	4,096,122.88	
3.3 BEL GOVT 540622	850,000.00	834,140.70	
3.35 ITALY GOVT 350301	1,670,000.00	1,563,210.18	
3.4 ITALY GOVT 250328	1,200,000.00	1,194,130.20	
3.4 ITALY GOVT 280401	1,250,000.00	1,239,551.50	
3.45 BEL GOVT 430622	350,000.00	355,537.70	
3.45 ITALY GOVT 480301	1,930,000.00	1,710,833.61	
3.45 SPAIN GOVT 430730	500,000.00	478,176.50	
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,710,000.00	1,568,678.76	
3.5 ITALY GOVT 260115	1,400,000.00	1,396,003.91	
3.5 ITALY GOVT 300301	2,930,000.00	2,903,114.32	
3.5 O. A. T 260425	6,400,000.00	6,482,585.60	
3.7 ITALY GOVT 300615	600,000.00	598,258.95	
3.75 BEL GOVT 450622	1,090,000.00	1,165,271.04	
3.75 ITALY GOVT 240901	1,400,000.00	1,401,212.40	
3.75 NETH GOVT 420115	2,210,000.00	2,539,738.63	

3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	470,000.00	549,863.05	
3. 85 ITALY GOVT 291215	3,050,000.00	3,075,628.84	
3. 85 ITALY GOVT 490901	1,820,000.00	1,712,608.93	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	300,000.00	308,035.53	
4 BEL GOVT 320328	1,310,000.00	1,415,910.88	
4 BUND 370104	2,710,000.00	3,191,398.98	
4 FINNISH GOVT 250704	450,000.00	457,374.15	
4 ITALY GOVT 311030	800,000.00	812,948.32	
4 ITALY GOVT 350430	1,050,000.00	1,046,703.72	
4 ITALY GOVT 370201	3,750,000.00	3,718,248.75	
4 NETH GOVT 370115	1,850,000.00	2,108,115.70	
4 O. A. T 381025	2,770,000.00	3,064,052.12	
4 O. A. T 550425	2,600,000.00	2,984,546.50	
4 O. A. T 600425	1,970,000.00	2,293,298.67	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	1,350,000.00	1,510,091.10	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	2,190,000.00	2,347,079.72	
4. 25 BEL GOVT 410328	1,980,000.00	2,236,101.90	
4. 25 BUND 390704	2,540,000.00	3,128,086.20	
4. 4 ITALY GOVT 330501	1,650,000.00	1,720,125.00	
4. 45 ITALY GOVT 430901	900,000.00	919,807.02	
4. 5 BEL GOVT 260328	1,200,000.00	1,246,299.24	
4. 5 ITALY GOVT 260301	5,200,000.00	5,317,826.80	
4. 5 ITALY GOVT 531001	400,000.00	412,308.00	
4. 5 O. A. T 410425	4,300,000.00	5,070,689.00	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	3,000,000.00	3,080,928.00	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	2,560,000.00	2,908,262.40	
4. 75 BUND 280704	1,300,000.00	1,439,634.30	
4. 75 BUND 340704	2,920,000.00	3,586,325.59	
4. 75 BUND 400704	2,020,000.00	2,650,179.40	
4. 75 ITALY GOVT 280901	2,530,000.00	2,668,155.71	
4. 75 ITALY GOVT 440901	2,200,000.00	2,347,229.72	
4. 75 O. A. T 350425	3,980,000.00	4,667,153.36	
4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1,600,000.00	1,674,486.40	
4. 9 SPAIN GOVT 400730	2,430,000.00	2,817,605.15	
5 BEL GOVT 350328	2,890,000.00	3,424,892.76	
5 ITALY GOVT 250301	2,150,000.00	2,195,876.70	

	5 ITALY GOVT 340801	3,370,000.00	3,670,350.23	
	5 ITALY GOVT 390801	2,920,000.00	3,193,551.44	
	5 ITALY GOVT 400901	2,130,000.00	2,336,524.80	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	2,000,000.00	2,196,290.00	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	2,100,000.00	2,536,308.79	
	5.25 ITALY GOVT 291101	2,980,000.00	3,256,207.26	
	5.4 IRISH GOVT 250313	1,200,000.00	1,245,728.16	
	5.5 BEL GOVT 280328	2,310,000.00	2,583,254.52	
	5.5 BUND 310104	1,770,000.00	2,148,542.82	
	5.5 NETH GOVT 280115	1,400,000.00	1,561,831.60	
	5.5 O.A.T 290425	7,390,000.00	8,445,454.58	
	5.625 BUND 280104	1,850,000.00	2,095,641.52	
	5.75 ITALY GOVT 330201	3,500,000.00	4,017,622.00	
	5.75 O.A.T 321025	4,310,000.00	5,325,194.64	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	2,000,000.00	2,396,304.00	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	2,450,000.00	2,640,117.55	
	6 ITALY GOVT 310501	2,770,000.00	3,197,937.30	
	6 O.A.T 251025	2,600,000.00	2,766,920.00	
	6 SPAIN GOVT 290131	2,600,000.00	2,979,932.80	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	900,000.00	1,012,033.80	
	6.25 BUND 300104	1,300,000.00	1,601,077.14	
	6.5 BUND 270704	1,070,000.00	1,227,653.26	
	6.5 ITALY GOVT 271101	1,720,000.00	1,924,582.47	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,400,000.00	2,676,460.80	
ユーロ合計		770,070,000.00	709,039,129.23 (110,950,442,941)	
合計			331,586,206,953 (331,586,206,953)	

(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 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	国債証券 263 銘柄	100.00%	49.25%
カナダドル	国債証券 39 銘柄	100.00%	2.10%

オーストラリアドル	国債証券	27 銘柄	100.00%	1.48%
イギリスポンド	国債証券	57 銘柄	100.00%	4.80%
シンガポールドル	国債証券	19 銘柄	100.00%	0.44%
マレーシアリンギット	国債証券	25 銘柄	100.00%	0.52%
ニュージーランドドル	国債証券	9 銘柄	100.00%	0.18%
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	9 銘柄	100.00%	0.14%
デンマーククローネ	国債証券	7 銘柄	100.00%	0.30%
メキシコペソ	国債証券	15 銘柄	100.00%	0.95%
イスラエルシェケル	国債証券	12 銘柄	100.00%	0.29%
ポーランドズロチ	国債証券	13 銘柄	100.00%	0.48%
中国元	国債証券	69 銘柄	100.00%	5.42%
ユーロ	国債証券	365 銘柄	100.00%	33.46%

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。

【中間財務諸表】

- 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間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。
- 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、当中間計算期間(2023年6月27日から2023年12月26日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年2月28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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2023年6月27日から2023年12月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）の2023年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月27日から2023年12月26日まで）の損益の状況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、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、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。

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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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。

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 [2023年6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,505,520,767	18,731,449,147
親投資信託受益証券	104,869,592,625	69,491,876,097
未収入金	-	2,740,870,000
流動資産合計	107,375,113,392	90,964,195,244
資産合計	107,375,113,392	90,964,195,244
負債の部		
流動負債		
未払解約金	482,223,909	438,896,149
未払受託者報酬	15,638,525	13,516,252
未払委託者報酬	84,447,980	72,987,693
未払利息	6,297	5,316
その他未払費用	1,939,124	1,675,958
流動負債合計	584,255,835	527,081,368
負債合計	584,255,835	527,081,368
純資産の部		
元本等		
元本	109,425,362,504	92,821,687,300
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	△2,634,504,947	△2,384,573,424
(分配準備積立金)	1,420,806,813	1,203,027,660
元本等合計	106,790,857,557	90,437,113,876
純資産合計	106,790,857,557	90,437,113,876
負債純資産合計	107,375,113,392	90,964,195,244

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期中間計算期間 自 2022年6月28日 至 2022年12月27日	第3期中間計算期間 自 2023年6月27日 至 2023年12月26日
営業収益		
受取利息	44,364	139,850
有価証券売買等損益	△2,639,903,320	△157,776,528
営業収益合計	△2,639,858,956	△157,636,678
営業費用		
支払利息	4,111,878	3,651,995
受託者報酬	18,953,030	13,516,252
委託者報酬	102,346,293	72,987,693
その他費用	2,350,112	1,675,958

営業費用合計	127,761,313	91,831,898
営業利益又は営業損失(△)	△2,767,620,269	△249,468,576
経常利益又は経常損失(△)	△2,767,620,269	△249,468,576
中間純利益又は中間純損失(△)	△2,767,620,269	△249,468,576
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	△378,832,359	△98,889,586
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△7,490,108,011	△2,634,504,947
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,344,861,184	404,251,281
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,344,861,184	404,251,281
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,078,292,437	3,740,768
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,078,292,437	3,740,768
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	△10,612,327,174	△2,384,573,424

(3)【中間注記表】

(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。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年6月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は2023年6月27日から2023年12月26日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第2期 [2023年6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
1. 期首元本額	143,656,913,962円	109,425,362,504円
期中追加設定元本額	59,952,533,967円	191,130,193円
期中一部解約元本額	94,184,085,425円	16,794,805,397円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	2,634,504,947円	2,384,573,424円
3. 受益権の総数	109,425,362,504口	92,821,687,300口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期中間計算期間 自2022年6月28日 至2022年12月27日	第3期中間計算期間 自2023年6月27日 至2023年12月26日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 [2023年6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、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。	(1) 有価証券 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	(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。	(2) デリバティブ取引 同左
	(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) 上記以外の金融商品 同左
	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)
該当事項はありません。

(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。

(1口当たり情報)

	第2期 [2023年6月26日現在]	第3期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	0.9759円	0.9743円
(1万口当たり純資産額)	(9,759円)	(9,743円)

(追加情報)

第2期中間計算期間 自2022年6月28日 至2022年12月27日	第3期中間計算期間 自2023年6月27日 至2023年12月26日
当ファンドは、主要投資対象の変更を行うことを2022年8月30日付で社内規定に基づき決裁しました。 当ファンドは、2022年10月6日付で「国内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」および「ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド」を新たな主要投資対象として追加し、マザーファンドへの投資を通じて、わが国の社債および先進国の公社債にも投資を行います。	—

(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)

[2023年12月26日現在]

資産の部

流動資産	
コール・ローン	36,663,438,733
株式	1,153,517,896,000
派生商品評価勘定	13,389,700
未収配当金	88,240,975
未収利息	460,726
その他未収収益	9,067,519
差入委託証拠金	141,276,422
流動資産合計	1,190,433,770,075
資産合計	1,190,433,770,075
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,610,150
前受金	5,820,000
未払金	86,338,970
未払解約金	879,222,352
未払利息	10,406
受入担保金	32,144,817,479
流動負債合計	33,123,819,357
負債合計	33,123,819,357
純資産の部	
元本等	
元本	408,243,703,719
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	749,066,246,999
元本等合計	1,157,309,950,718
純資産合計	1,157,309,950,718
負債純資産合計	1,190,433,770,075

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。 新株予約権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。

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	402,039,788,052円
期中追加設定元本額	75,605,322,802円
期中一部解約元本額	69,401,407,135円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,761,406,603円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	834,051,703円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,708,642,051円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,548,382,099円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,549,681,939円

三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	6,333,317,683 円
三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	35,330,655,797 円
三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	41,791,715,828 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	95,313,613 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	258,682,039 円
ファンド・マネジャー (国内株式)	552,512,574 円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,257,279,508 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	2,117,488,049 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	139,862,912 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	2,818,671,337 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	896,341,296 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	1,119,934,973 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	1,076,809,855 円
eMAXIS Slim 国内株式 (TOPIX)	36,067,297,614 円
国内株式セレクション (ラップ向け)	4,678,201,531 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	10,264,141,927 円
つみたて日本株式 (TOPIX)	8,507,283,255 円
つみたて8資産均等バランス	5,029,385,312 円
つみたて4資産均等バランス	1,781,977,490 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,782,655 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	7,883,493 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	735,847,525 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	919,656,068 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	654,675,135 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	550,558,517 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,732,699,572 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	3,908,157,130 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,136,828,827 円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	3,890,269,866 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	574,583,228 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	162,752,335 円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	19,158,294,975 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	261,038,169 円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,934,851,968 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)	1,433,016,794 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	39,274,790 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)	33,562,885 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)	2,305,925,531 円

三菱UFJ	バランス・イノベーション (新興国投資型)	144,562,547 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)	111,980,524 円
eMAXIS	バランス (4資産均等型)	716,939,880 円
eMAXIS	最適化バランス (マイゴールキーパー)	135,856,906 円
eMAXIS	最適化バランス (マイディフェンダー)	165,346,413 円
eMAXIS	最適化バランス (マイミッドフィルダー)	604,414,387 円
eMAXIS	最適化バランス (マイフォワード)	505,894,623 円
eMAXIS	最適化バランス (マイストライカー)	999,838,299 円
三菱UFJ	トピックスオープン	1,000,132,033 円
三菱UFJ	DCトピックスオープン	7,931,021,394 円
三菱UFJ	トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	53,744,166 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)	4,459,343,379 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)	599 円
三菱UFJ	バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,843,427 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)	41,882,225,359 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)	225,928 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)	4,080,293,603 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)	85,271,699 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)	2,836,290,324 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)	3,179,774,647 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)	123,455,867 円
	日本株式インデックスファンドS	2,298,503,453 円
MUKAM	アセットアロケーションファンド2020-07 (適	35,980,732 円

格機関投資家限定)	
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)	331,732,772 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)	691,350,540 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	5,548,050,788 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,852,714 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	7,168,672 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,546,008 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	6,530,662 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	473,668,281 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	81,474,582 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)	26,263,472 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)	14,975,151 円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,571,366,754 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)	348,409,180 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)	1,489,052,683 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)	1,417,623,673 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)	1,327,393,726 円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	59,208,481,265 円
合計	408,243,703,719 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	30,641,477,870 円
3. 受益権の総数	408,243,703,719 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26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)

該当事項はありません。

(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

[2023年12月26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	5,105,560,000	—	5,111,460,000	5,900,000
	合計	5,105,560,000	—	5,111,460,000	5,900,000

(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。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	2.8349 円

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)

[2023 年 12 月 26 日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	48,848,924,467
コール・ローン	7,900,801,881
株式	3,345,307,112,722
投資証券	70,284,988,755
派生商品評価勘定	2,871,822,727
未収入金	2,011,508,137
未収配当金	2,714,644,214
差入委託証拠金	115,121,605,430
流動資産合計	3,595,061,408,333
資産合計	3,595,061,408,333
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	174,601,462
未払解約金	4,958,511,121
未払利息	2,242
流動負債合計	5,133,114,825
負債合計	5,133,114,825
純資産の部	
元本等	
元本	608,850,753,771
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	2,981,077,539,737
元本等合計	3,589,928,293,508
純資産合計	3,589,928,293,508
負債純資産合計	3,595,061,408,333

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 6 0 条および第 6 1 条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	513,699,458,357円
期中追加設定元本額	135,654,501,232円
期中一部解約元本額	40,503,205,818円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	194,116,940円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	944,886,493円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	877,466,942円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,983,239,173円
MAXIS 全世界株式(オール・カンントリー)上場投信	4,770,897,588円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,474,012,599円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	9,001,528,496円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,334,524,951円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	46,664,592円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	124,116,229円
ファンド・マネジャー(海外株式)	778,622円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,848,592,120円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,021,268,277円
eMAXIS バランス(波乗り型)	182,153,639円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,742,545,613円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	216,421,078円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	280,596,227円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	252,368,165円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	98,165,014,791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)	4,989,069,626円
つみたて先進国株式	29,927,822,919円
つみたて8資産均等バランス	2,428,467,790円
つみたて4資産均等バランス	857,535,118円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,021,765円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,552,719円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,722,581円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	177,201,203円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	222,793,440円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	153,818,941円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	68,072,550円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	514,166,804円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,373,355,921円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	53,674,464,213円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	547,340,050円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国株式)	4,297,357,242円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カンントリー)	256,027,736,979円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	141,011,364円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	45,277,183円
つみたて全世界株式	578,496,472円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	63,978,829円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,614,305,463円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	42,733,373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)	410,879円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	32,151,241,068円
eMAXIS 全世界株式インデックス	5,440,976,375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)	1,169,481,285円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	175,308,769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)	178,129,075円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	344,436,883円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	81,857,068円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	113,264,195円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	473,166,941円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	378,896,882円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	733,613,739円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,299,782,285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)	153円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	4,855,083円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,309,852,428円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	36,366,902円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	652,321,882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)	8,736,859,610円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	66,355円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	525,981,155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)	4,902,018,210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)	52,716,268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)	2,294,179,188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）	2,867,024,497円
海外株式インデックスファンドS	5,789,230,825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）	84,625,601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）	43,676,495円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,863,952,311円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	700,632円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	1,754,575円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	428,729円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	1,985,242円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	21,251,278円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	777,190円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	6,442,142円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	741,322円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	7,203,303円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,890,470,409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）	84,830,799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）	361,285,454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）	392,348,308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）	401,262,627円
合計	608,850,753,771円
2. 受益権の総数	608,850,753,771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）

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26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	<p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p>
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つた場合、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）

該当事項はありません。

（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

[2023年12月26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	171,352,855,252	—	174,051,989,982	2,699,134,730
	合計	171,352,855,252	—	174,051,989,982	2,699,134,730

(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

[2023年12月26日現在]

区分	種類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	766,918,920	—	767,275,463	356,543
	カナダドル	376,810,785	—	376,600,185	△210,600
	オーストラリアドル	233,342,068	—	233,668,923	326,855
	イギリスポンド	484,822,940	—	483,193,404	△1,629,536
	スイスフラン	316,173,264	—	315,921,629	△251,635
	香港ドル	54,430,896	—	53,995,484	△435,412
	スウェーデンクローネ	113,932,214	—	114,960,841	1,028,627
	ノルウェークローネ	40,431,050	—	40,658,711	227,661
	デンマーククローネ	149,997,847	—	149,984,018	△13,829
	ユーロ	1,199,319,969	—	1,198,275,147	△1,044,822
	売建				
	アメリカドル	756,224,149	—	756,322,513	△98,364
	カナダドル	23,768,874	—	23,815,516	△46,642
	オーストラリアドル	21,350,169	—	21,389,440	△39,271
	ユーロ	51,471,885	—	51,554,925	△83,040
合計		4,588,995,030	—	4,587,616,199	△1,913,465

(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。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	5.8962円
(1万口当たり純資産額)	(58,962円)

国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	788,898,059
国債証券	159,553,694,800
地方債証券	10,206,939,970
特殊債券	9,159,919,584
社債券	12,867,294,100
派生商品評価勘定	1,758,130
未収入金	140,507,000
未収利息	230,110,466
前払費用	29,510,337
差入委託証拠金	3,769,457
流動資産合計	192,982,401,903
資産合計	192,982,401,903
負債の部	
流動負債	
前受金	2,020,000
未払解約金	205,115,398
未払利息	223
流動負債合計	207,135,621
負債合計	207,135,621
純資産の部	
元本等	
元本	206,781,797,065
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△14,006,530,783
元本等合計	192,775,266,282
純資産合計	192,775,266,282
負債純資産合計	192,982,401,903

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。

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	242,658,034,853円
期中追加設定元本額	131,862,947,105円
期中一部解約元本額	167,739,184,893円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー（国内債券）	20,709,769,878円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	4,826,156,130円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	96,176,963円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	13,632,911円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	22,338,001円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	6,781,793,894円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	617,167,576円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	679,534,737円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	8,236,228,889円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	5,084,001,096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）	21,133,194,036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）	6,351,593,399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）	20,358,076,237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）	2,612,579,711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）	108,689,277,031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）	570,276,576円
合計	206,781,797,065円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	14,006,530,783円
3. 受益権の総数	206,781,797,065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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
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)

該当事項はありません。

(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

[2023年12月26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	291,200,000	—	292,960,000	1,760,000
合計		291,200,000	—	292,960,000	1,760,000

(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。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	0.9323円
(1万口当たり純資産額)	(9,323円)

日本短期債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	565,871,926
国債証券	8,994,713,000
地方債証券	99,914,000
特殊債券	700,181,000
社債券	6,298,840,250
未収利息	4,146,820
前払費用	3,559,479
流動資産合計	16,667,226,475
資産合計	16,667,226,475
負債の部	
流動負債	

未払解約金	8,571,784
未払利息	160
流動負債合計	8,571,944
負債合計	8,571,944
純資産の部	
元本等	
元本	14,840,989,467
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,817,665,064
元本等合計	16,658,654,531
純資産合計	16,658,654,531
負債純資産合計	16,667,226,475

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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	1,434,595,979円
期中追加設定元本額	13,599,856,278円
期中一部解約元本額	193,462,790円
元本の内訳※	
三菱UFJ グローバル・エコ・ウォーター・ファンド	88,421円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	12,864,992,221円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	70,755,224円
日本短期債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	12,592,417円
日本短期債券ファンド(適格機関投資家限定)	103,080,267円
三菱UFJ 積立ファンド(日本バランス型)	1,062,744,941円
三菱UFJ 国内バランス20	726,735,976円
合計	14,840,989,467円
2. 受益権の総数	14,840,989,467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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26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す。
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)

該当事項はありません。

(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。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	1.1225円
(1万口当たり純資産額)	(11,225円)

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)

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,653,296,192
コール・ローン	2,109,710,932
国債証券	505,935,222,513
派生商品評価勘定	193,679
未収利息	3,503,559,151
前払費用	370,624,909
流動資産合計	514,572,607,376
資産合計	514,572,607,376
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	50,157,194
未払金	23,037,474
未払解約金	376,688,512
未払利息	598
流動負債合計	449,883,778
負債合計	449,883,778
純資産の部	
元本等	
元本	203,202,072,602
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	310,920,650,996
元本等合計	514,122,723,598
純資産合計	514,122,723,598
負債純資産合計	514,572,607,376

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。

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	188,907,060,645円
期中追加設定元本額	24,816,998,517円
期中一部解約元本額	10,521,986,560円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	279,084,470円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	639,282,943円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	403,694,814円
三菱UFJ 外国債券オープン	844,033,038円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,119,207,118円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,090,173,412円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,754,587,654円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	538,764,773円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	96,618,561円
ファンド・マネジャー(海外債券)	925,650,659円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,011,966,246円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,373,639,293円
eMAXIS バランス(波乗り型)	214,847,273円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,002,112,887円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	419,930,960円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	233,126,858円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	155,071,656円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	36,419,770,299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)	11,569,980,811円
つみたて8資産均等バランス	5,641,511,025円
つみたて4資産均等バランス	1,996,129,788円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4,444,769円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,319,702円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	528,643円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	229,969,853円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	152,246,636円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	85,414,092円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	782,951,124円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,182,759,506円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,755,106,528円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	1,997,227,484円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	71,123,656円

金)	
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	173,588,227 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	32,254,157 円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,739,807,658 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	26,809,609 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)	61,764,089 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)	3,095,610,860 円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	16,939,565,970 円
ワールド・インカムオープン	1,002,089,144 円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15,463,879,263 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	411,021,759 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	2,062,999,087 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	804,120,763 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	513,472,613 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	278,596,159 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	319,584,243 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	169,995,679 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	67,308,804 円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,034,245,390 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)	10,770,661 円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	1,104,430,219 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)	1,531,499,896 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,137,790,024 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)	41,467,875,411 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)	384,652 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	102,887 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)	30,316,366 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)	2,493,287,490 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)	757,085,115 円
海外債券インデックスファンドS	3,755,208,266 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,617,065 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,692,654 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	495,786 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	921,040 円

三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	4,607,218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)	7,368,190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)	8,382,236円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,746,007,953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)	197,363,282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 (積極型)	186,794,459円
合計	203,202,072,602円
2. 受益権の総数	203,202,072,602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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
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)

該当事項はありません。

(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

[2023年12月26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	1,544,789,728	—	1,494,735,819	△50,053,909
	カナダドル	5,350,440	—	5,363,855	13,415
	オーストラリアドル	5,799,720	—	5,807,844	8,124
	イギリスポンド	10,825,794	—	10,840,278	14,484

	メキシコペソ	5,098,319	—	5,106,066	7,747
	オフショア元	14,344,502	—	14,302,368	△42,134
	ユーロ	76,698,260	—	76,786,987	88,727
	売建				
	アメリカドル	7,111,200	—	7,111,115	85
	ユーロ	9,402,060	—	9,402,114	△54
	合計	1,679,420,023	—	1,629,456,446	△49,963,515

(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。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	2.5301円
(1万口当たり純資産額)	(25,301円)

ヘッジ付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)

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	468,290,825
コール・ローン	1,272,635,030
国債証券	311,199,769,451
派生商品評価勘定	8,377,517,625
未収入金	102,211,574
未収利息	2,230,449,862
前払費用	179,227,200
流動資産合計	323,830,101,567
資産合計	323,830,101,567
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,614,843
未払金	3,158,391
未払解約金	69,911,648
未払利息	361

流動負債合計	83,685,243
負債合計	83,685,243
純資産の部	
元本等	
元本	283,979,688,252
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	39,766,728,072
元本等合計	323,746,416,324
純資産合計	323,746,416,324
負債純資産合計	323,830,101,567

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。

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	284,113,964,774円
期中追加設定元本額	24,703,882,049円
期中一部解約元本額	24,838,158,571円
元本の内訳※	
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	905,907,530円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	7,308,971,051円
ラップ向けインデックスf 先進国債券(為替ヘッジあり)	4,389,465,737円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	143,796,763円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	2,765,361円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	4,475,825円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	3,891,227,596円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,223,079,890円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	650,179,167円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	4,670,252,923円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,068,909,307円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	90,028,565円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	115,144,185,935円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	9,520,204,082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)	12,039,668,263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)	3,630,426,677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)	395,801,252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)	10,985,967,964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)	1,050,122,102円

MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	18,217,179,226 円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン (適格機関投資家限定)	6,252,508,451 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)	246,162,165 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)	60,182,161,264 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)	329,562,431 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)	774,616 円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	2,435,092,729 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)	325,643,502 円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	2,412,645,299 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)	322,196,277 円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	2,406,347,053 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)	322,720,012 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)	321,351,725 円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	2,129,580,674 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)	315,633,120 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)	316,748,113 円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	2,100,241,630 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)	312,894,225 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)	315,490,691 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)	315,059,067 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)	329,350,862 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)	336,722,167 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)	352,830,037 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)	359,565,752 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)	371,026,379 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)	388,518,761 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)	376,017,480 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)	388,520,282 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)	381,708,272 円
合計	283,979,688,252 円
2. 受益権の総数	283,979,688,252 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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26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)

該当事項はありません。

(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

[2023年12月26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				
	売建				
	アメリカドル	147,205,094,517	—	143,005,995,932	4,199,098,585
	カナダドル	6,091,604,455	—	6,063,951,205	27,653,250
	オーストラリアドル	4,396,002,250	—	4,382,347,365	13,654,885
	イギリスポンド	16,029,616,272	—	15,566,939,270	462,677,002
	シンガポールドル	1,320,403,010	—	1,289,094,516	31,308,494
	マレーシアリング	1,634,527,653	—	1,599,464,636	35,063,017
	ニュージーランドドル	692,952,052	—	689,153,192	3,798,860
	スウェーデンクローネ	634,389,795	—	637,650,390	△3,260,595
	ノルウェークローネ	537,866,516	—	545,220,764	△7,354,248
	デンマーククローネ	892,318,320	—	868,727,582	23,590,738
	メキシコペソ	2,775,327,581	—	2,750,275,268	25,052,313
	イスラエルシケル	946,415,599	—	937,410,242	9,005,357
ポーランドズロ	1,665,970,464	—	1,626,446,432	39,524,032	

	チ			
	中国元	24,362,824,014	—	23,604,656,165
	ユーロ	103,472,479,928	—	100,723,556,685
	合計	312,657,792,426	—	304,290,889,644
				758,167,849
				2,748,923,243
				8,366,902,782

(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。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	1,1400円
(1万口当たり純資産額)	(11,400円)

新マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	999,124,779
現先取引勘定	1,400,154,000
流動資産合計	2,399,278,779
資産合計	2,399,278,779
負債の部	
流動負債	
未払利息	283
流動負債合計	283
負債合計	283
純資産の部	
元本等	
元本	2,425,181,195
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△25,902,699
元本等合計	2,399,278,496
純資産合計	2,399,278,496
負債純資産合計	2,399,278,779

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年12月26日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	27,137,884円
期中追加設定元本額	9,843,867,955円
期中一部解約元本額	7,445,824,644円
元本の内訳※	
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	2,222,650,544円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	127,333,567円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	58,701,503円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	4,846,766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)	11,143,866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)	504,949円
合計	2,425,181,195円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	25,902,699円
3. 受益権の総数	2,425,181,195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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年12月26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、該当事項はありません。 (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)

該当事項はありません。

(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。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	0.9893円
(1万口当たり純資産額)	(9,893円)

2 【ファンドの現況】

【ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	90,686,461,838
II 負債総額	354,175,560
III 純資産総額 (I - II)	90,332,286,278
IV 発行済口数	92,460,819,411口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9770
(10,000口当たり)	(9,770)

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,195,389,836,921
II 負債総額	18,555,669,364
III 純資産総額 (I - II)	1,176,834,167,557
IV 発行済口数	409,734,488,070口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.8722
(10,000口当たり)	(28,722)

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	3,624,877,417,758
II 負債総額	899,930,009
III 純資産総額 (I - II)	3,623,977,487,749
IV 発行済口数	612,393,536,675口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	5.9177
(10,000口当たり)	(59,177)

国内債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	194,322,391,997
II 負債総額	2,543,450,877
III 純資産総額 (I - II)	191,778,941,120
IV 発行済口数	205,740,610,890口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9321
(10,000口当たり)	(9,321)

日本短期債券マザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	21,739,273,824
II 負債総額	1,501,957,835
III 純資産総額 (I - II)	20,237,315,989
IV 発行済口数	18,023,114,509口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.1229
(10,000口当たり)	(11,229)

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	518,155,375,112
II 負債総額	1,557,267,813
III 純資産総額 (I - II)	516,598,107,299
IV 発行済口数	203,844,088,908口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.5343
(10,000口当たり)	(25,343)

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	325,630,693,148
II 負債総額	775,284,224
III 純資産総額 (I - II)	324,855,408,924
IV 発行済口数	284,420,401,034口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.1422
(10,000口当たり)	(11,422)

新マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	2,399,263,229
II 負債総額	1,258
III 純資産総額 (I - II)	2,399,261,971
IV 発行済口数	2,425,181,195口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9893
(10,000口当たり)	(9,893)

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

2023年12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、意図した運用成果が得られていない場合にはその原因の分析のほか、(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における審議を経て運用担当部・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。

2023年12月29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	847	28,140,566
追加型公社債投資信託	16	1,558,854
単位型株式投資信託	98	441,378
単位型公社債投資信託	49	96,721
合計	1,010	30,237,519

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あります。

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。

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、記載しておりません。

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

委託会社は 2023 年 10 月 1 日にエム・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しました。
上記以外、該当事項はありません。

約款

追加型証券投資信託

ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）

約 款

三菱UF Jアセットマネジメント株式会社

ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）

運用の基本方針

約款第19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、値上がり益の獲得および利子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、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券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、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・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、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、日本短期債券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、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券および新マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国を含む先進国の株式および公社債等に投資を行います。

② 株式の実質組入比率は、原則として相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

③ 公社債等の実質組入比率については、株式部分の組入比率を決定した後、原則として相場局面判断および投資環境等に基づき決定します。

④ 実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行う場合があります。

⑤ 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) 投資制限

① 株式への実質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実質投資割合は、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（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④ 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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤ 外貨建資産への実質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 スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑨ 外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、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、経費等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いて運用を行います。

追加型証券投資信託
『ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）』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、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第18条第1項および第2項ならびに第30条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

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1,000万円を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 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2031年6月25日まで、または第46条第8項、第47条第1項、第48条第1項、第49条第1項および第51条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(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1,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第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て得た額とします。

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27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て得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益

権総口数で除して得た金額をいいます。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29条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第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 この信託のすべての受益権は、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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- 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。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、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（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。）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、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定める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、取得申込者が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契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、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 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、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 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。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金

を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。

- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、手数料ならびに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、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ⑥ 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定めるものとします。
- ⑦ 第5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、第38条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 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5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。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14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15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類等）

第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 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。

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とする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、日本超長期国債インデックスマザーファンドⅡ、国内債券インデックスマザーファンド、日本短期債券マザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよび新マネー・マーケット・マザーファンド（以下これらを総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。次号において同じ。）で次号で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書ならびに第13号および第19号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第16号の証券ならびに第13号および第19号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）

8. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）

10. 外国法人の社員権で前号の権利の性質を有するもの

11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）

12. 外国の法令に基づく権利であって、前号の権利に類するもの

③ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

④ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下本項および次項において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、

信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第30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16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条、第27条、第29条、第33条から第35条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条、第27条、第29条、第33条から第35条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第20条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式会社について、委託者が議決権行使権限を委託する、または、議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使している場合に限り）において投資するモルガン・スタンレー株式会社については、委託者および受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第52条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替えは委託者と受託者の協議にて定めます。

（信用取引の指図範囲）

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし

ます。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（第25条に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

第22条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（スワップ取引の運用指図）

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第25条 委託者は、信託財産に属する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（この信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で

存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ② 前項各号に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(公社債の借入れ)

第27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り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28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、制限されることがあります。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第29条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- ④ 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(信託業務の委託等)

第30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

（混蔵寄託）

第31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譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第32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。

（有価証券売却等の指図）

第33条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第34条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第35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を図るため、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り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より支弁します。

(損益の帰属)

第36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。

(受託者による資金立替え)

第37条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て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38条 この信託の計算期間は、毎年6月26日から翌年6月25日までとすることを原則とします。

- 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「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、第1計算期間は信託契約締結日から2022年6月27日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第39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。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。
- ⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。
 1. 他の受益者の氏名または名称および住所
 2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第40条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額は、第2計

算期間以降の毎計算期間の6ヵ月終了日、および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)

第41条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38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16の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、第2計算期間以降の毎計算期間の6ヵ月終了日、および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42条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(「配当等収益」といいます。)は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、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、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、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43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て得た額をいいます。以下同じ。)については第44条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金(第46条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。)については第44条第4項に規定する支払開始日までに、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44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ます。)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。

- 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、）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。
- ④ 一部解約金は、第46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、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）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、
- 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、

（収益分配金および償還金の時効）

第45条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第46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 委託者は、前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、前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。
- ③ 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。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、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、
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとし、
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 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3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、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。

- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第47条第2項から第5項の規定にしたがいます。

(信託契約の解約)

第47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に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るものとし、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、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第48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52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49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52条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託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50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51条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第52条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- 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。

(信託約款の変更等)

第52条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、

- ② 委託者は、前項の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第53条 第47条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第46条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(信託期間の延長)

第54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55条 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つた場合には、これを交付します。

(公告)

第56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57条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、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58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定め

ます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と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が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第44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3条 第24条に規定する「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

信託契約締結日 2021年11月30日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第46条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント