

# 投資信託説明書 (請求目論見書)

使用開始日 2024.3.26

## つみたて8資産均等バランス

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

ファンドは、NISAの成長投資枠およびつみたて投資枠の対象です。  
※販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にご確認ください。

この目論見書により行う「つみたて8資産均等バランス」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】	56
第3【ファンドの経理状況】	62
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	374
第三部【委託会社等の情報】	374
第1【委託会社等の概況】	374
約款	419

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

つみたて8資産均等バランス（「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。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位とします。

### (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。

販売会社によっては、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の各対象インデックスを12.5%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果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		
追加型	内外	不動産投信	MR F	特殊型 ( )
		その他資産 ( )	E T F	
		資産複合		

属性区分表

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

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

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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。
	E T F	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（BBB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（BB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。	

		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

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

特色

1

各投資対象資産の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行います。

- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を合成ベンチマークの変動率に連動させることを目的とした運用を行います。

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)の各対象インデックス(以下「ベンチマーク」という場合があります。)を12.5%ずつ組み合わせた合成指数をいいます。

特色

2

主として対象インデックスに採用されている日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。)、公社債および不動産投資信託証券(リート)に投資を行います。

- 合成ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

※実際の運用は各マザーファンドを通じて行います。

DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

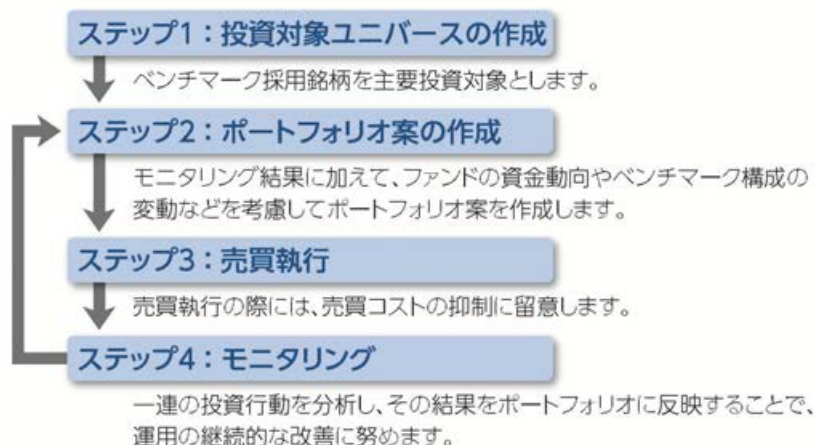
### <基本投資割合>



## <各マザーファンドの主要投資対象と運用目標および基本投資割合>

	主要投資対象	運用目標	基本投資割合
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動した投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	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。	12.5%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
東証REIT指数マザーファンド	国内不動産投資信託証券	東証REIT指数(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
MUAM G-REITマザーファンド	先進国不動産投資信託証券	S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%

## <各マザーファンドの運用プロセス>



- ❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。
- 📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページをご覧ください。  
(<https://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>)

特色

3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

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。

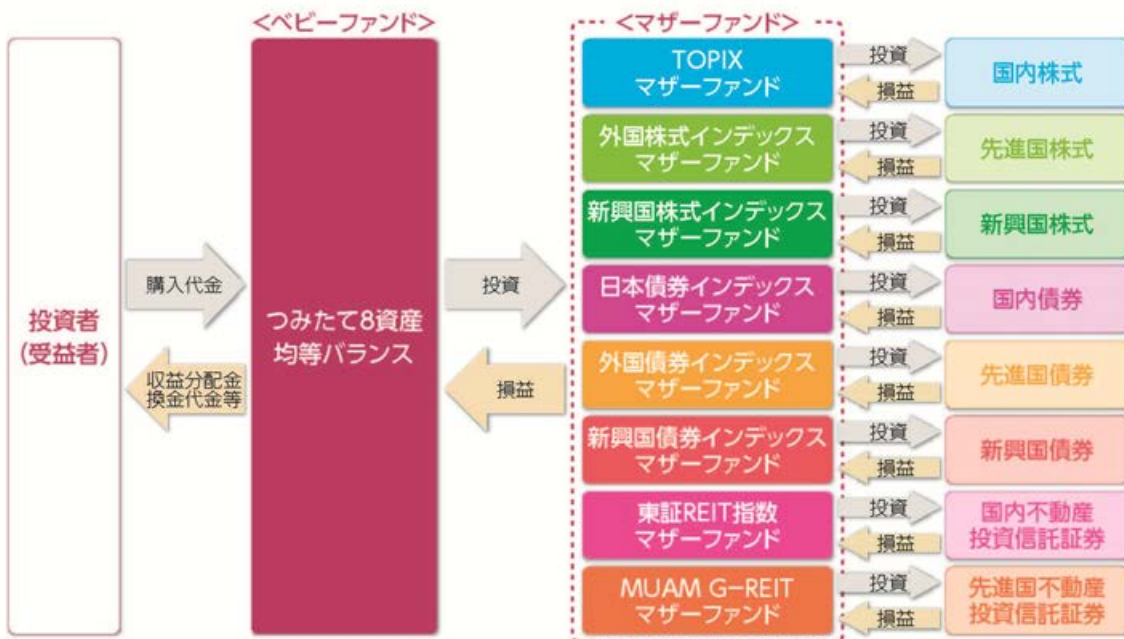
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券へ投資するファミリーファンド方式により行います。



■ 主な投資制限

株式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブ取引は、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。

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。





## 指数について

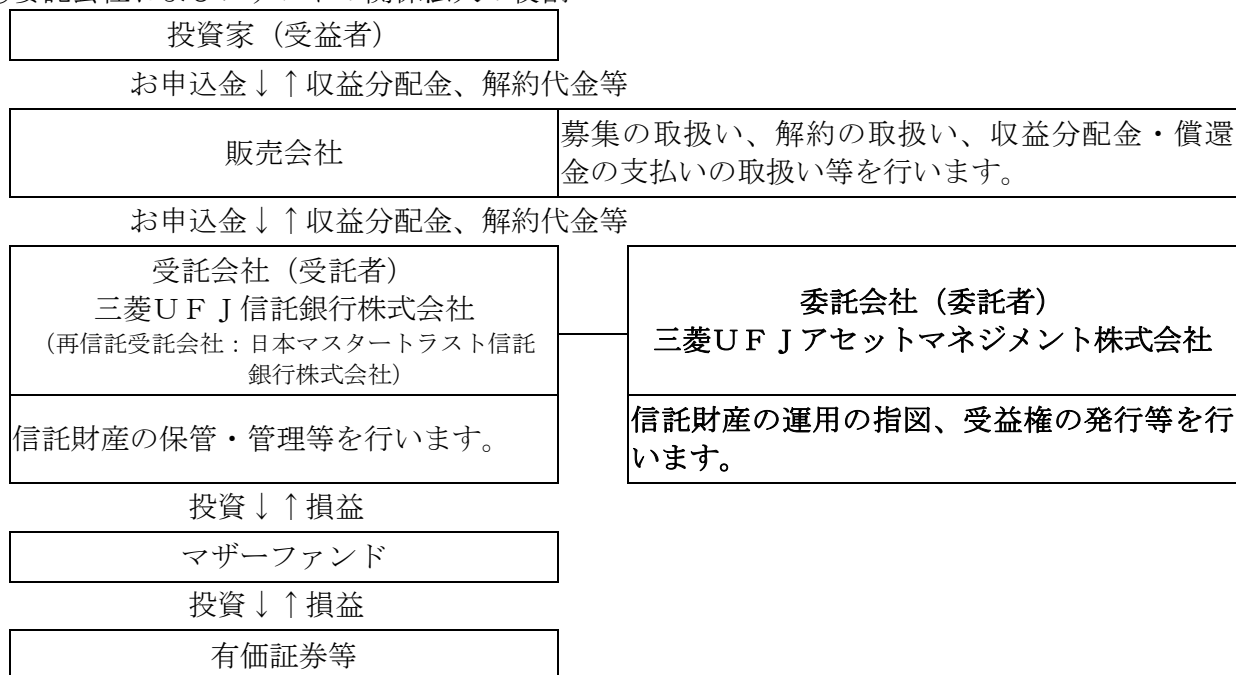
- ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日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

## (2)【ファンドの沿革】

2017年8月16日 設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

③委託会社の概況（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、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-R E I Tマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として対象インデックスに採用されている日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を合成ベンチマークの変動率に連動させることを目的とした運用を行います。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ12.5%とします。

合成ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### (2)【投資対象】

#### ①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ. 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、為替先渡取引および直物為替先渡取引

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、新興国株式インデックスマザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAM G-R E I T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券

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（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。

新興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 エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動した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

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている新興国の株式等に投資を行い、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。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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株式等の投資比率が 100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(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。
- ④外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑤有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑥スワップ取引を行うことができます。
- ⑦金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑧外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑨デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

日本債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

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

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑦外貨建資産への投資は行いません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

⑨スワップ取引を行うことができます。

⑩デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、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。

新興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、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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、原則として為替ヘッジを行いません。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（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5%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金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引を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。
- ⑬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。

## 東証REIT指数マザーファンド

### (基本方針)

この投資信託は、東証REIT指数（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

東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

#### ②投資態度

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

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

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投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

③外貨建資産への投資は行いません。

④不動産投信指数先物取引を行うことができます。

⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク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。

## MUAM G-REITマザーファンド

### (基本方針)

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

### (運用方法)

#### ①投資対象

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

#### ②投資態度

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

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### (投資制限)

①株式への直接投資は行いません。

②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

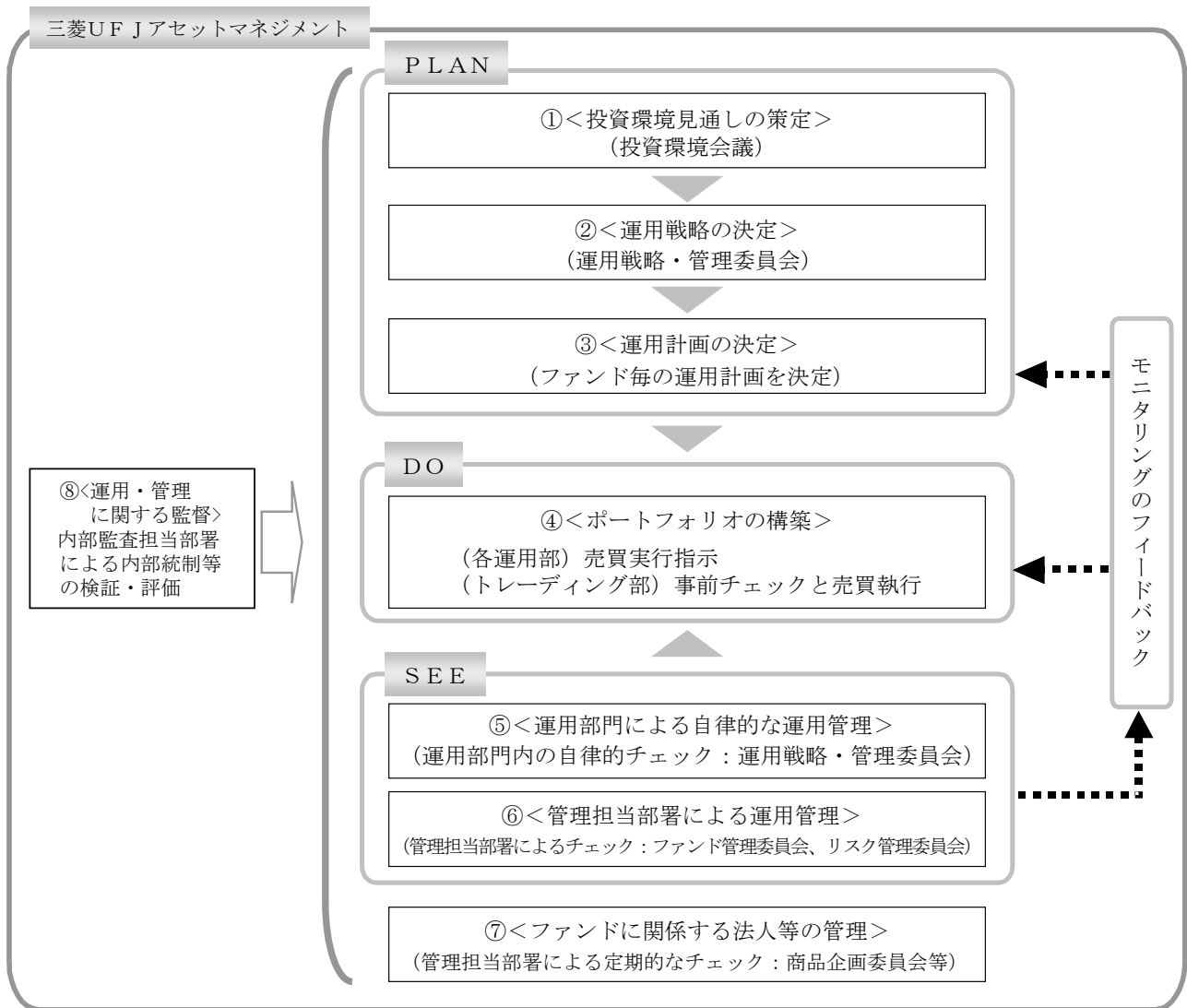
③外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

④不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

⑥外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(3) 【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析、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ファンドに關係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に關係する法人については、その業務に關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・管理に關する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に關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、委託会社に關する「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株式

- a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50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株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

②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。

③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。

#### ④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。

#### ⑤スワップ取引

- a. 委託会社は、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。

#### ⑥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（④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

#### ⑦外国為替予約取引

- a. 委託会社は、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。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、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. 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。

#### ⑧有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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、当該借入れに係る有価証券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. の借入れに係る有価証券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



た有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

#### ⑨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。

#### ⑩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。

#### ⑪金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

- a. 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物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、為替先渡取引および直物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、為替先渡取引および直物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または価格情報会社の提供する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、為替先渡取引および直物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。

#### ⑫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、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下⑫において同じ。）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. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
  3. 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。

#### ⑬有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または⑧の規定により借り入れた有価証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、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券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. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑭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。

⑮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。

⑯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

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、ファンドはその影響を受け組入株式や組入公社債、組入不動産投資信託証券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

## 為替変動 リスク

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。

## 信用リスク

組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。

## 流動性 リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。また、不動産投資信託証券は、株式と比べ市場規模が小さく、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

## カントリー リスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

### ※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。
- ・ファンドは、合成ベンチマークの動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比の違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。
- ・不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証

券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

## (2) 投資リスクに対する管理体制

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

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

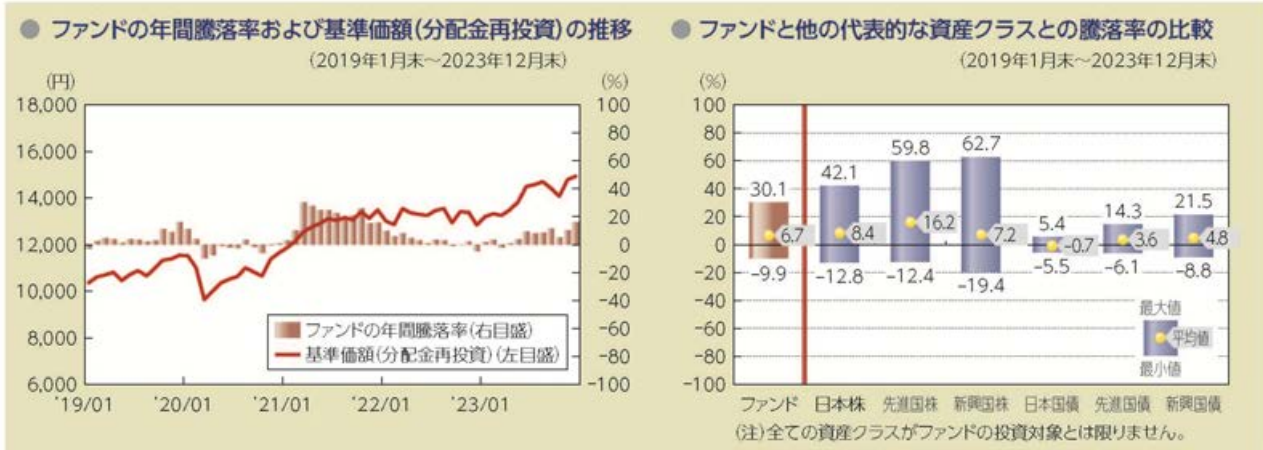
委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る商標又は商標は、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に係る商標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 0.2420%（税抜 0.2200%）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	0.10%	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	0.10%	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	0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

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

##### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

##### ①個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

##### 1. 収益分配金の課税

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

##### 2. 解約時および償還時の課税

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

20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）およびつみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象です。販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、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。

(\*) 確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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

#### ◇個別元本について

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

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

#### ◇収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※上記は 2023 年 12 月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

#### （参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2022年6月28日～2023年6月26日）における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.28%	0.24%	0.04%

（比率は年率、表示桁数未満四捨五入）

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

詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

## 5 【運用状況】

### 【つみたて8資産均等バランス】

#### （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	114,410,089,042	99.01
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,146,413,883	0.99
純資産総額		115,556,502,925	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	新興国株式インデックスマザーファンド	4,265,802,178	3.3162	14,146,621,791	3.4206	14,591,602,930	12.63
日本	親投資信託受益証券	MUAM G-R E I Tマザーファンド	5,655,527,923	2.2684	12,828,999,541	2.5781	14,580,516,538	12.62
日本	親投資信託受益証券	東証R E I T指数マザーファンド	4,139,132,086	3.5160	14,553,408,528	3.5217	14,576,781,467	12.61
日本	親投資信託受益証券	T O P I Xマザーファンド	5,029,078,511	2.7137	13,647,410,356	2.8722	14,444,519,299	12.50
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	2,428,467,790	5.4272	13,179,780,390	5.9177	14,370,943,840	12.44
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	5,658,135,581	2.4644	13,944,110,987	2.5343	14,339,413,002	12.41
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	8,267,916,251	1.6787	13,879,852,781	1.7329	14,327,472,071	12.40
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	10,272,694,595	1.3096	13,453,933,717	1.2829	13,178,839,895	11.40

(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	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

(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	(2018年6月25日)	1,719,844,704	1,719,844,704	10,352	10,352
第2計算期間末日	(2019年6月25日)	9,447,668,345	9,447,668,345	10,710	10,710
第3計算期間末日	(2020年6月25日)	22,121,755,856	22,121,755,856	10,490	10,490
第4計算期間末日	(2021年6月25日)	46,140,234,928	46,140,234,928	13,151	13,151
第5計算期間末日	(2022年6月27日)	67,273,898,555	67,273,898,555	13,176	13,176

第 6 計算期間末日	(2023 年 6 月 26 日)	98,437,287,872	98,437,287,872	14,299	14,299
	2022 年 12 月末日	77,625,201,130	—	12,843	—
	2023 年 1 月末日	81,945,881,091	—	13,203	—
	2 月末日	84,201,807,505	—	13,326	—
	3 月末日	86,453,193,193	—	13,255	—
	4 月末日	89,720,529,874	—	13,490	—
	5 月末日	93,685,948,239	—	13,831	—
	6 月末日	100,303,899,401	—	14,495	—
	7 月末日	102,942,285,685	—	14,576	—
	8 月末日	106,098,865,261	—	14,702	—
	9 月末日	106,039,574,553	—	14,411	—
	10 月末日	105,675,858,978	—	14,083	—
	11 月末日	112,867,477,280	—	14,790	—
	12 月末日	115,556,502,925	—	14,936	—

## 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
第 3 計算期間	0 円
第 4 計算期間	0 円
第 5 計算期間	0 円
第 6 計算期間	0 円

## ③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 1 計算期間	3.52
第 2 計算期間	3.45
第 3 計算期間	△2.05
第 4 計算期間	25.36
第 5 計算期間	0.19
第 6 計算期間	8.52
第 7 中間計算期間	3.32

(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	1,686,339,471	24,944,050	1,661,395,421
第2計算期間	7,483,220,180	323,353,612	8,821,261,989
第3計算期間	13,287,635,933	1,020,666,967	21,088,230,955
第4計算期間	16,420,415,363	2,424,096,225	35,084,550,093
第5計算期間	18,413,640,607	2,440,391,672	51,057,799,028
第6計算期間	21,419,739,926	3,635,761,254	68,841,777,700
第7中間計算期間	11,441,160,420	3,228,694,019	77,054,244,101

(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

#### 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	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	344,420	64,058.72	22,063,106,960	82,381.95	28,373,993,113	0.78

			ンス						
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	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

取引	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。

## 新興国株式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 (%)
株式	香港	105,549,310,070	18.27
	インド	91,418,101,733	15.82
	台湾	86,958,547,633	15.05
	韓国	70,489,649,876	12.20
	ブラジル	31,420,465,496	5.44
	中国	23,559,469,460	4.08
	サウジアラビア	22,411,884,685	3.88
	南アフリカ	16,203,517,176	2.80
	アメリカ	16,075,828,929	2.78
	メキシコ	14,072,881,390	2.44
	インドネシア	10,230,937,627	1.77
	タイ	9,433,407,154	1.63
	マレーシア	7,216,356,952	1.25
	アラブ首長国連邦	6,693,962,564	1.16
	ポーランド	5,321,315,082	0.92
	カタール	4,797,407,310	0.83
	クウェート	4,137,665,721	0.72
	フィリピン	3,359,180,422	0.58
	トルコ	3,337,322,495	0.58
	チリ	2,758,845,057	0.48
ギリシャ	2,634,739,307	0.46	
ハンガリー	1,404,061,068	0.24	
チェコ	832,045,736	0.14	

	コロンビア	556,186,136	0.10
	小計	540,873,089,079	93.61
投資証券	メキシコ	795,821,405	0.14
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	36,128,896,933	6.25
純資産総額		577,797,807,417	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	36,616,960,250	6.34

(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 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	13,317,000	2,360.07	31,429,070,869	2,745.23	36,558,283,841	6.33
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハ ードウェ アおよび 機器	2,579,873	7,208.03	18,595,804,438	8,674.24	22,378,463,370	3.87
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娛樂	3,608,500	5,926.51	21,385,845,616	5,317.95	19,189,822,575	3.32
香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	8,812,000	1,511.16	13,316,421,228	1,376.67	12,131,282,130	2.10
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギ ー	1,649,222	3,922.40	6,468,917,210	4,481.54	7,391,064,257	1.28
アメリカ	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	322,729	10,509.73	3,391,795,613	20,614.99	6,653,055,269	1.15
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	2,806,719	1,619.63	4,545,870,334	1,730.14	4,856,039,264	0.84
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウ ェア・サ ービス	1,791,645	2,207.82	3,955,641,690	2,687.75	4,815,508,182	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・ 半導体製 造装置	294,459	10,170.93	2,994,921,932	15,635.74	4,604,087,309	0.80
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	1,499,729	2,812.12	4,217,429,300	2,933.03	4,398,750,149	0.76
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	52,157,550	95.91	5,002,701,248	84.03	4,383,033,635	0.76

ブラジル	株式	VALE SA	素材	1,838,829	1,984.05	3,648,333,082	2,252.72	4,142,379,516	0.72
香港	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	2,736,920	2,320.57	6,351,232,349	1,494.65	4,090,744,320	0.71
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	821,236	3,122.28	2,564,131,428	4,745.13	3,896,875,687	0.67
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	1,061,151	2,827.72	3,000,646,679	3,295.55	3,497,086,789	0.61
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,713,272	487.17	3,270,530,866	481.45	3,232,155,825	0.56
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	491,687	5,681.39	2,793,470,308	6,535.82	3,213,581,662	0.56
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	449,577	6,169.14	2,773,506,613	6,884.15	3,094,955,505	0.54
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	2,595,100	776.04	2,013,913,587	1,086.67	2,820,038,327	0.49
香港	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	1,047,895	2,586.83	2,710,730,848	2,560.96	2,683,622,419	0.46
香港	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	1,278,333	2,436.17	3,114,247,996	2,043.69	2,612,516,369	0.45
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	30,005,700	81.59	2,448,195,179	86.48	2,594,892,936	0.45
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	2,587,830	796.37	2,060,893,326	991.25	2,565,207,677	0.44
香港	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	1,225,874	2,146.70	2,631,594,001	2,085.43	2,556,480,545	0.44
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	35,582,350	76.65	2,727,518,442	68.60	2,441,198,286	0.42
香港	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,221,200	204.70	1,682,898,981	295.48	2,429,216,618	0.42
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	1,236,818	1,563.83	1,934,181,757	1,905.50	2,356,759,173	0.41
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	101,876	24,607.41	2,506,905,357	23,083.57	2,351,661,859	0.41
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	42,738,000	57.64	2,463,740,598	53.90	2,303,813,259	0.40
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	1,570,642	1,382.77	2,171,845,219	1,465.95	2,302,492,064	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	4.85
	素材	7.42
	資本財	4.44
	商業・専門サービス	0.07

	運輸	1.89
	自動車・自動車部品	3.57
	耐久消費財・アパレル	1.13
	消費者サービス	2.04
	メディア・娯楽	5.61
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.16
	生活必需品流通・小売り	1.44
	食品・飲料・タバコ	3.39
	家庭用品・パーソナル用品	0.78
	ヘルスケア機器・サービス	0.96
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.58
	銀行	15.80
	金融サービス	2.72
	保険	2.37
	ソフトウェア・サービス	2.51
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.81
	電気通信サービス	2.62
	公益事業	2.53
	半導体・半導体製造装置	9.50
	不動産管理・開発	1.44
	小計	93.61
投資証券	—	0.14
合計		93.75

(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	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 2403	買建	5,000	アメリカドル	249,427,800	35,376,344,874	258,175,000	36,616,960,250	6.34

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

#### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 投資状況

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	648,679,163,670	83.54
地方債証券	日本	41,710,761,518	5.37
特殊債券	日本	35,702,050,236	4.60
社債券	日本	47,835,654,000	6.16
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,604,272,865	0.33
純資産総額		776,531,902,289	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	586,840,000	0.08

(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163回利付国債(5年)	11,850,000,000	100.73	11,936,873,000	100.86	11,952,147,000	0.400000	2028/9/20	1.54
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	8,150,000,000	99.39	8,100,848,000	98.70	8,044,131,500	0.100000	2030/6/20	1.04
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	8,080,000,000	98.12	7,928,654,600	97.12	7,847,619,200	0.100000	2031/12/20	1.01
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	7,920,000,000	98.45	7,797,404,400	97.68	7,736,731,200	0.100000	2031/6/20	1.00
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	7,740,000,000	99.65	7,713,526,400	99.15	7,674,597,000	0.100000	2029/9/20	0.99
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	6,920,000,000	100.87	6,980,283,700	101.69	7,037,294,000	0.800000	2033/9/20	0.91
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	7,220,000,000	98.38	7,103,699,600	97.39	7,031,702,400	0.100000	2031/9/20	0.91
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	6,790,000,000	99.55	6,760,056,100	98.90	6,715,445,800	0.100000	2030/3/20	0.86
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	6,880,000,000	98.11	6,750,156,000	97.13	6,682,612,800	0.200000	2032/9/20	0.86
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,530,000,000	100.02	6,531,567,200	99.74	6,513,609,700	0.100000	2028/3/20	0.84
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	6,410,000,000	100.38	6,434,942,800	100.15	6,419,807,300	0.100000	2025/9/20	0.83
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,380,000,000	100.34	6,402,074,800	100.14	6,389,251,000	0.100000	2025/6/20	0.82

日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	6,340,000,000	100.43	6,367,388,800	100.14	6,349,319,800	0.100000	2026/12/20	0.82
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,370,000,000	100.86	6,424,931,800	99.30	6,325,410,000	0.500000	2033/3/20	0.81
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	6,340,000,000	98.87	6,268,383,400	98.49	6,244,266,000	0.100000	2030/9/20	0.80
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	6,220,000,000	99.79	6,206,938,000	99.30	6,176,771,000	0.100000	2029/3/20	0.80
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	6,130,000,000	100.40	6,154,703,900	100.12	6,137,785,100	0.100000	2027/3/20	0.79
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	6,210,000,000	98.77	6,133,752,500	98.23	6,100,331,400	0.100000	2030/12/20	0.79
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	6,090,000,000	100.16	6,099,744,000	99.92	6,085,188,900	0.100000	2027/12/20	0.78
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	6,070,000,000	100.80	6,118,828,500	99.48	6,038,921,600	0.500000	2032/12/20	0.78
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	6,140,000,000	98.74	6,062,636,000	97.96	6,015,173,800	0.100000	2031/3/20	0.77
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,750,000,000	100.02	5,751,219,000	99.89	5,743,732,500	0.005000	2026/9/20	0.74
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,730,000,000	100.18	5,740,593,000	99.98	5,728,911,300	0.100000	2027/9/20	0.74
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	5,700,000,000	100.34	5,719,836,000	100.06	5,703,876,000	0.100000	2027/6/20	0.73
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	5,750,000,000	99.50	5,721,250,000	99.03	5,694,340,000	0.100000	2029/12/20	0.73
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,620,000,000	99.95	5,617,190,000	99.72	5,604,488,800	0.005000	2027/6/20	0.72
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	5,380,000,000	100.32	5,397,377,400	100.14	5,387,747,200	0.100000	2025/3/20	0.69
日本	国債証券	第158回利付国債(5年)	5,330,000,000	100.07	5,333,791,800	99.74	5,316,621,700	0.100000	2028/3/20	0.68
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,390,000,000	98.34	5,300,781,800	97.40	5,250,237,300	0.200000	2032/6/20	0.68
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	5,150,000,000	100.37	5,169,555,600	100.15	5,158,034,000	0.100000	2025/12/20	0.66

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	83.54
地方債証券	5.37
特殊債券	4.60
社債券	6.16
合計	99.66

(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 2 4 年 0 3 月限	買建	4	円	585,433,740	586,840,000	0.08

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

## 外国債券インデックスマザーファンド

### 投資状況

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。

新興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	マレーシア	8,324,308,811	9.75
	タイ	8,230,248,928	9.64
	インドネシア	8,210,295,129	9.62
	中国	8,193,503,038	9.60
	メキシコ	8,141,297,213	9.54
	ブラジル	7,697,454,682	9.02
	南アフリカ	6,849,701,302	8.03
	ポーランド	6,351,206,415	7.44
	チェコ	5,177,770,999	6.07
	コロンビア	3,749,414,542	4.39
	ルーマニア	3,104,631,826	3.64
	ハンガリー	2,605,078,229	3.05
	ペルー	1,944,011,519	2.28
	チリ	1,623,246,573	1.90
	トルコ	693,332,814	0.81
	エジプト	681,013,369	0.80
	セルビア	238,346,711	0.28
	ウルグアイ	144,331,266	0.17
	ドミニカ共和国	131,762,884	0.15
フィリピン	48,238,231	0.06	

		小計	82,139,194,481	96.25
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—		3,199,722,905	3.75
純資産総額			85,338,917,386	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 (%)
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 260701	56,800,000	2,168.80	1,231,883,757	2,316.66	1,315,867,635	—	2026/7/1	1.54
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 260101	48,700,000	2,096.34	1,020,921,806	2,419.66	1,178,378,106	—	2026/1/1	1.38
ブラジル	国債証券	10 (IN) BRAZIL NTN 290101	36,800,000	2,703.53	994,900,082	3,049.22	1,122,113,751	10.000000	2029/1/1	1.31
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	36,270,000	2,709.36	982,687,725	3,075.50	1,115,484,445	10.000000	2027/1/1	1.31
南アフリ カ	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	124,600,000	804.99	1,003,021,009	799.52	996,212,511	10.500000	2026/12/21	1.17
南アフリ カ	国債証券	8 SOUTH AFRICA 300131	135,300,000	693.60	938,444,782	704.04	952,579,515	8.000000	2030/1/31	1.12
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	30,900,000	2,820.82	871,633,626	3,059.34	945,338,157	10.000000	2025/1/1	1.11
メキシコ	国債証券	5.75 MEXICAN BONO 260305	120,200,000	759.51	912,932,163	772.32	928,329,930	5.750000	2026/3/5	1.09
チェコ	国債証券	6 CZECH REPUBLIC 260226	138,500,000	654.74	906,817,221	664.59	920,457,646	6.000000	2026/2/26	1.08
メキシコ	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 310529	108,500,000	794.34	861,866,626	779.13	845,366,845	7.750000	2031/5/29	0.99
南アフリ カ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 480228	146,200,000	603.86	882,857,135	564.48	825,283,795	8.750000	2048/2/28	0.97
チェコ	国債証券	0.25 CZECH REPUB 270210	143,500,000	532.24	763,770,831	568.20	815,377,757	0.250000	2027/2/10	0.96
南アフリ カ	国債証券	8.25 SOUTH AFRICA 320331	120,700,000	666.73	804,751,649	667.47	805,640,997	8.250000	2032/3/31	0.94
マレーシ ア	国債証券	3.955 MALAYSIAGOV 250915	25,600,000	3,127.11	800,542,717	3,107.79	795,595,868	3.955000	2025/9/15	0.93
メキシコ	国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	98,200,000	796.63	782,299,204	791.47	777,227,837	7.500000	2027/6/3	0.91
マレーシ ア	国債証券	3.885 MALAYSIAGOV 290815	24,650,000	3,107.14	765,912,174	3,108.59	766,269,005	3.885000	2029/8/15	0.90
チェコ	国債証券	5.5 CZECH REPUB 281212	108,000,000	670.66	724,320,318	688.87	743,980,853	5.500000	2028/12/12	0.87
南アフリ カ	国債証券	8.875 SOUTH AFRIC 350228	112,500,000	657.02	739,158,090	645.60	726,305,062	8.875000	2035/2/28	0.85
ポーラ ンド	国債証券	7.5 POLAND 280725	18,000,000	3,901.42	702,255,690	3,985.96	717,473,736	7.500000	2028/7/25	0.84
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 250701	27,800,000	2,262.43	628,957,445	2,539.01	705,846,047	—	2025/7/1	0.83
チェコ	国債証券	1.75 CZECH REPUB 320623	119,200,000	509.02	606,760,768	546.14	651,006,581	1.750000	2032/6/23	0.76
メキシコ	国債証券	5.5 MEXICAN BONOS 270304	86,200,000	735.94	634,385,919	749.56	646,128,528	5.500000	2027/3/4	0.76

南アフリカ	国債証券	8.5 SOUTH AFRICA 370131	103,400,000	617.18	638,169,261	597.02	617,325,918	8.500000	2037/1/31	0.72
メキシコ	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	75,100,000	828.11	621,915,149	818.17	614,447,565	8.500000	2029/5/31	0.72
メキシコ	国債証券	7.75 MEXICAN BONO 421113	81,600,000	748.07	610,432,906	737.72	601,985,509	7.750000	2042/11/13	0.71
マレーシア	国債証券	3.906 MALAYSIAGOV 260715	19,100,000	3,118.25	595,586,275	3,115.32	595,027,974	3.906000	2026/7/15	0.70
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 260725	17,000,000	3,237.81	550,428,926	3,408.26	579,405,419	2.500000	2026/7/25	0.68
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	68,700,000	839.35	576,639,640	831.12	570,982,748	10.000000	2024/12/5	0.67
ポーランド	国債証券	2.75 POLAND 291025	17,200,000	3,015.42	518,652,750	3,237.16	556,792,641	2.750000	2029/10/25	0.65
チェコ	国債証券	5 CZECH REPUBLIC 300930	79,700,000	652.90	520,361,327	683.19	544,507,398	5.000000	2030/9/30	0.64

(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	96.25
合計	96.25

(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。

#### 東証REIT指数マザーファンド

#### 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 (%)
投資証券	日本	99,167,163,150	97.97
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,050,307,221	2.03
純資産総額		101,217,470,371	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 (%)
-------	----	------	------	----------

不動産投信指数先物取引	買建	日本	2,068,716,000	2.04
-------------	----	----	---------------	------

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

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	投資証券	日本ビルファンド投資法人	11,239	573,803	6,448,971,967	611,000	6,867,029,000	6.78
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,896	560,356.86	5,545,291,542	584,000	5,779,264,000	5.71
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,155	155,229.53	4,836,176,088	165,000	5,140,575,000	5.08
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	46,180	100,146.56	4,624,768,254	101,900	4,705,742,000	4.65
日本	投資証券	GLP投資法人	32,544	143,658.85	4,675,233,641	140,500	4,572,432,000	4.52
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,783	290,155.94	4,869,687,255	271,400	4,554,906,200	4.50
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	27,725	153,246.56	4,248,760,986	160,800	4,458,180,000	4.40
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,522	275,738.36	4,004,272,585	251,700	3,655,187,400	3.61
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	19,196	178,179.51	3,420,334,016	166,500	3,196,134,000	3.16
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,551	149,466.51	3,221,152,776	144,100	3,105,499,100	3.07
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,452	327,454.83	3,095,103,134	316,000	2,986,832,000	2.95
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	46,647	56,266.75	2,624,675,181	61,000	2,845,467,000	2.81
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,589	356,227.02	2,347,179,900	350,000	2,306,150,000	2.28
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	28,950	73,310.57	2,122,341,280	77,100	2,232,045,000	2.21
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,251	80,656.39	2,601,249,521	69,200	2,231,769,200	2.20
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,700	146,136.77	2,148,210,542	139,600	2,052,120,000	2.03
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,327	593,233.26	1,973,687,068	604,000	2,009,508,000	1.99
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	5,054	393,388.97	1,988,187,873	388,500	1,963,479,000	1.94
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,315	154,670.49	1,904,767,196	152,000	1,871,880,000	1.85
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,007	456,942.39	1,830,968,159	457,500	1,833,202,500	1.81
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,171	302,483.27	1,866,624,286	286,000	1,764,906,000	1.74
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,818	147,813.64	1,746,861,651	141,400	1,671,065,200	1.65
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,329	149,907.17	1,698,298,364	140,200	1,588,325,800	1.57
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,575	494,715.99	1,768,609,684	433,000	1,547,975,000	1.53
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,738	302,839.04	1,434,851,377	317,000	1,501,946,000	1.48
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,187	109,097.83	1,547,770,960	104,300	1,479,704,100	1.46
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	18,570	72,268.07	1,342,018,102	72,500	1,346,325,000	1.33
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,014	154,601.54	1,393,578,325	149,200	1,344,888,800	1.33
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,996	622,325.96	1,242,162,623	665,000	1,327,340,000	1.31
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,327	401,361.09	1,335,328,376	374,500	1,245,961,500	1.23

(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 (%)
投資証券	97.97
合計	97.97

(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 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT 24年03月限	買建	1,157	円	2,078,380,430	2,068,716,000	2.04

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

MUAM G-REIT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 (%)
投資証券	アメリカ	89,550,225,493	76.21
	オーストラリア	7,855,608,836	6.69
	イギリス	5,755,298,237	4.90
	シンガポール	3,881,819,243	3.30
	フランス	2,124,256,731	1.81
	カナダ	1,755,831,328	1.49
	香港	1,386,119,402	1.18
	ベルギー	1,361,189,910	1.16
	スペイン	517,295,459	0.44
	ニュージーランド	329,823,059	0.28
	韓国	202,718,008	0.17
	オランダ	200,084,796	0.17
	イスラエル	136,177,794	0.12
	ガーナ	134,337,600	0.11
	ドイツ	46,422,513	0.04
	アイルランド	39,829,339	0.03
	イタリア	8,148,997	0.01
小計		115,285,186,745	98.11



コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,218,470,626	1.89
純資産総額		117,503,657,371	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 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	アメリカ	1,701,202,627	1.45

(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)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	537,478	16,511.84	8,874,755,362	19,173.99	10,305,601,936	8.77
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	54,575	97,335.09	5,312,062,668	115,462.38	6,301,359,645	5.36
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	322,009	10,207.50	3,286,908,510	12,929.22	4,163,326,105	3.54
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	92,010	39,359.24	3,621,443,976	43,655.27	4,016,721,761	3.42
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	189,649	16,845.14	3,194,665,681	20,463.23	3,880,831,561	3.30
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	421,066	8,879.97	3,739,056,101	8,308.40	3,498,385,344	2.98
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	176,078	14,889.31	2,621,680,525	19,305.89	3,399,344,190	2.89
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	122,744	18,691.77	2,294,303,316	22,999.15	2,823,008,011	2.40
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	601,464	4,483.24	2,696,511,253	4,564.08	2,745,135,467	2.34
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,004,916	1,758.49	1,767,136,345	2,443.85	2,455,871,403	2.09
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	82,502	23,445.91	1,934,335,069	26,890.96	2,218,558,642	1.89
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	200,612	8,460.15	1,697,209,517	8,864.37	1,778,299,997	1.51
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	169,544	7,307.08	1,238,871,843	10,013.19	1,697,677,642	1.44
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	233,648	6,563.89	1,533,640,331	7,226.23	1,688,396,173	1.44
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	90,567	19,824.99	1,795,490,540	18,281.88	1,655,735,660	1.41
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	333,726	4,243.55	1,416,184,169	4,921.50	1,642,432,843	1.40
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	72,217	19,903.00	1,437,335,233	19,165.48	1,384,074,040	1.18
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,274	30,436.71	1,134,498,226	35,847.53	1,336,180,926	1.14
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	67,585	21,925.49	1,481,834,897	19,366.88	1,308,911,024	1.11
香港	投資証券	LINK REIT	1,487,500	1,000.79	1,488,676,612	795.87	1,183,867,781	1.01
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	126,967	10,706.74	1,359,403,508	9,315.39	1,182,747,681	1.01
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	711,005	1,421.95	1,011,014,697	1,621.06	1,152,582,448	0.98
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	408,175	2,277.78	929,736,852	2,789.79	1,138,725,023	0.97
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	358,175	2,984.10	1,068,831,163	3,091.89	1,107,439,133	0.94
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,343	9,318.23	1,009,565,101	10,157.86	1,100,533,524	0.94

アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	155,102	7,146.81	1,108,485,099	7,044.69	1,092,646,455	0.93
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	122,123	7,854.54	959,220,648	8,081.47	986,933,776	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	174,913	5,524.27	966,268,125	5,498.74	961,802,701	0.82
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	184,085	4,388.22	807,805,515	5,148.42	947,748,552	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	95,124	8,857.28	842,540,236	9,594.79	912,695,708	0.78

(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 (%)
投資証券	98.11
合計	98.11

(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 (%)
不動産 投信指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	DJREIT2403	買建	333	アメリカ ドル	11,736,325.9	1,664,563,102	11,994,660	1,701,202,627	1.45

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

《参考情報》



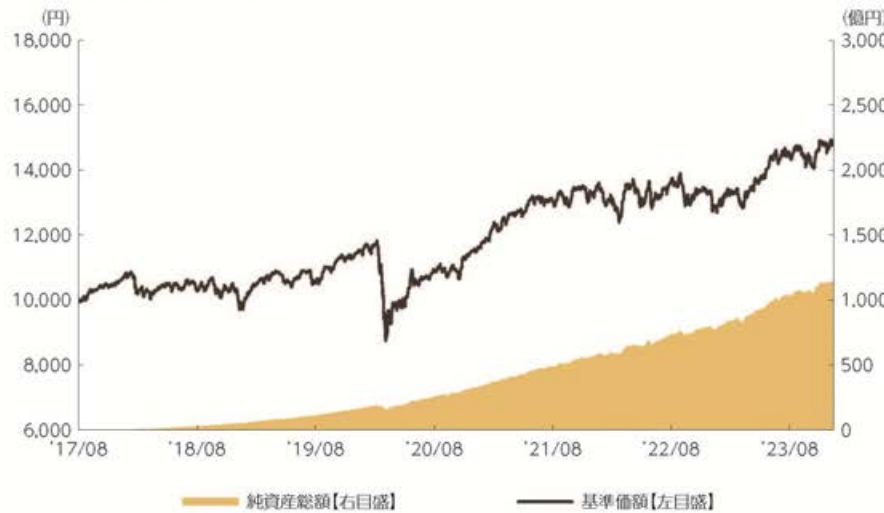
# 運用実績



2023年12月29日現在

## ■基準価額・純資産の推移

2017年8月16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	14,936円
純資産総額	1,155億円

•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
2021年6月	0円
2020年6月	0円
2019年6月	0円
2018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
国内株式	12.5%
国内債券	11.4%
国内リート	12.4%
外国株式	23.3%
外国債券	24.1%
外国リート	12.6%
コールローン他 (負債控除後)	3.7%
合計	100.0%

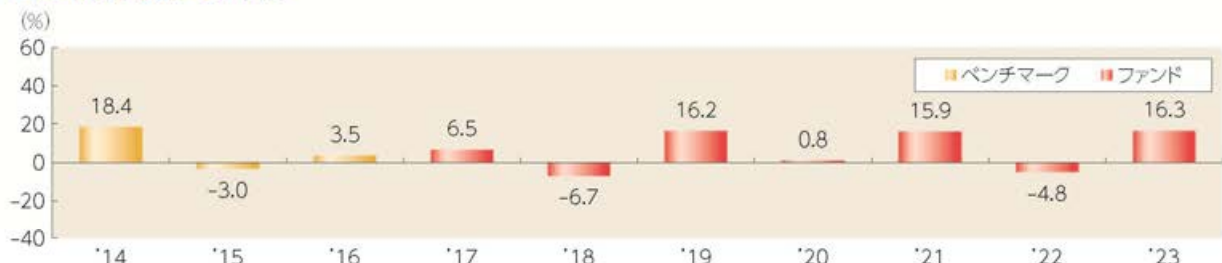
組入上位通貨	比率
1 円	37.5%
2 アメリカドル	26.0%
3 ユーロ	5.9%
4 中国元	2.7%
5 香港ドル	2.5%
6 インドルピー	2.0%
7 ブラジルレアル	2.0%
8 ニュー台湾ドル	1.9%
9 イギリスポンド	1.8%
10 メキシコペソ	1.7%

組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製造装置	台湾	0.8%
APPLE INC	株式	テクノロジー/ハードウェア/機器	アメリカ	0.6%
MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.5%
トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.5%
BRAZIL-LTN 260701	債券	国債	ブラジル	0.2%
第163回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.2%
BRAZIL-LTN 260101	債券	国債	ブラジル	0.2%
PROLOGIS INC	リート	-	アメリカ	1.1%
日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.9%
ジャパンリアルエステイト投資法人	リート	-	日本	0.7%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.5%
債券先物取引 (買建)	0.0%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.4%

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

## ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は設定日から年末までの収益率を表示
- 2016年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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。  
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
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

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

#### 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。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては上記と異なる取扱いをしている場合があ

ります。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して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。

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

### 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（投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

無期限（2017年8月16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。

## (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10億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

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

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

### ②信託約款の変更等

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。

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  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 西郷 篤

#### 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」に掲げられているつみたて8資産均等バランスの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、つみたて8資産均等バランスの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】

【つみたて8資産均等バランス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 [ 2022年6月27日現在 ]	第6期 [ 2023年6月26日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	767,230,634	1,201,084,834
親投資信託受益証券	66,608,678,910	97,452,318,686
未収入金	1,505,065	347,453
流動資産合計	67,377,414,609	98,653,750,973
資産合計	67,377,414,609	98,653,750,973
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	26,835,449	110,443,556
未払受託者報酬	6,858,661	9,482,707
未払委託者報酬	68,586,495	94,826,984
未払利息	948	3,018
その他未払費用	1,234,501	1,706,836
流動負債合計	103,516,054	216,463,101
負債合計	103,516,054	216,463,101
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	51,057,799,028	68,841,777,700
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	16,216,099,527	29,595,510,172
(分配準備積立金)	8,134,106,363	13,860,681,854
元本等合計	67,273,898,555	98,437,287,872
純資産合計	67,273,898,555	98,437,287,872
負債純資産合計	67,377,414,609	98,653,750,973

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 自 2021年6月26日 至 2022年6月27日	第6期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,688	4,817
有価証券売買等損益	238,508,458	7,666,761,940
営業収益合計	238,510,146	7,666,766,757
<b>営業費用</b>		
支払利息	133,387	402,204
受託者報酬	12,533,224	17,666,783

委託者報酬	125,332,096	176,667,629
その他費用	2,255,860	3,179,906
営業費用合計	140,254,567	197,916,522
営業利益又は営業損失(△)	98,255,579	7,468,850,235
経常利益又は経常損失(△)	98,255,579	7,468,850,235
当期純利益又は当期純損失(△)	98,255,579	7,468,850,235
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(△)	12,845,950	95,728,844
期首剰余金又は期首欠損金(△)	11,055,684,835	16,216,099,527
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,844,347,714	7,168,915,423
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,844,347,714	7,168,915,423
剰余金減少額又は欠損金増加額	769,342,651	1,162,626,169
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	769,342,651	1,162,626,169
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	16,216,099,527	29,595,510,172

### (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5期 [2022年6月27日現在]	第6期 [2023年6月26日現在]
1. 期首元本額	35,084,550,093円	51,057,799,028円
期中追加設定元本額	18,413,640,607円	21,419,739,926円
期中一部解約元本額	2,440,391,672円	3,635,761,254円
2. 受益権の総数	51,057,799,028口	68,841,777,700口

#### (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自2021年6月26日 至2022年6月27日			第6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		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,334,363,451円	費用控除後の配当等収益額	A	2,353,780,529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	3,842,509,507円
収益調整金額	C	8,081,993,164円	収益調整金額	C	15,734,828,318円
分配準備積立金額	D	6,799,742,912円	分配準備積立金額	D	7,664,391,818円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	16,216,099,527円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,595,510,172円
当ファンドの期末残存口数	F	51,057,799,028口	当ファンドの期末残存口数	F	68,841,777,700口

1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,176 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

1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,299 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

(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 5 期 自 2021 年 6 月 26 日 至 2022 年 6 月 27 日	第 6 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 5 期 [2022 年 6 月 27 日現在]	第 6 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、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第5期 [2022年6月27日現在]	第6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	181,465,957	7,655,133,168
合計	181,465,957	7,655,133,168

(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5期 [2022年6月27日現在]	第6期 [2023年6月26日現在]
1口当たり純資産額	1,3176円	1,4299円
(1万口当たり純資産額)	(13,176円)	(14,299円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	MUAM G-R E I Tマザーファンド	5,301,909,219	12,016,777,244	
	新興国株式インデックスマザーファンド	3,772,079,947	12,500,672,944	
	東証R E I T指数マザーファンド	3,410,110,854	11,973,581,230	
	新興国債券インデックスマザーファンド	7,441,868,126	12,476,291,913	
	T O P I Xマザーファンド	4,587,666,454	12,429,823,490	
	外国株式インデックスマザーファンド	2,314,820,675	12,549,337,325	
	日本債券インデックスマザーファンド	8,455,959,882	11,122,969,628	
	外国債券インデックスマザーファンド	5,025,309,408	12,382,864,912	
合計		40,309,724,565	97,452,318,686	

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V L (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 (F O F s 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 米回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
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ます。 株式	60,760,821,670円
3. 受益権の総数	402,039,788,052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、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[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

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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>
	<p>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。</p>

(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

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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	ホクリヨウ	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	R o b o t H o m e	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ヨングループ	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-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	KH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	UBE	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	サカタインクス	74,200	1,236.00	91,711,200	
4634	東洋インキS C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	JSP	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	T O T O	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	M A R U W A	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	合同製鐵	17,100	3,535.00	60,448,500	
5411	J F Eホールディングス	917,700	1,985.50	1,822,093,350	
5423	東京製鐵	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	日本鑄鐵管	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 S A W A	6,100	1,216.00	7,417,600	貸付有価証券 1,400株
6134	F U J 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	日本エアーテック	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	オカダアイオン	6,700	2,326.00	15,584,200	
6298	ワイエイシイホールディングス	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	荅原製作所	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	J U K I	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	IPEX	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	IDEC	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	テクノメディカ	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	エスベック	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	K O A	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	S C R E E N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	キヤノン電子	36,800	1,991.00	73,268,800	
7751	キヤノン	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	M U T O H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	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	ファイブホールディングス	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	グリーン	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	P C I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	P R T I M E S	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	オーブンドア	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	U b i c o m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	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	ギフトィ	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	T D C 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	I D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	BIPROGY	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	TBS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	ピー・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	オルパ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	トーマンデバイス	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	ピーバンドットコム	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	メディパルホールディングス	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 DOM	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	トーヨー	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	P A L T A C	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W i s m e t t a c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	コーア商事ホールディングス	19,700	706.00	13,908,200	
9274	K P P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	J K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	パ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	ビックカメラ	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	28,800	2,929.00	84,355,200	貸付有価証券

	ス				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	Z O Z O	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	H a m e e	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	すかいらー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	S F P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	B E E N O S	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	J M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	壺番屋	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	木曾路	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	M r M a x H D	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	A O K I 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	O l y m p i c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 DrugStores	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	S B I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	SRE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	AD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	THE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	JPMC	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	ビーロット	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	And Do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	MIRARTHホールディングス	165,700	441.00	73,073,700	
8904	AVANTIA	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	C D S	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	N J S	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	カカクコム	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D Y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	バリュウコマース	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	びあ	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	リソ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	Ke 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	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	RPA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	90,745,972,847円
海外株式セレクション(ラップ向け)	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 (適格機関投資家限定)	43,761,271円
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

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

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

[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

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 (1万口当たり純資産額)	5.4213円 (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 SOFTWRE	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 LIFECO 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
	GLENCORE 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
	ASHTED 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 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	
	BELJER 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)
イスラエルシエケル	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
	イスラエルシエケル 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 RENOV	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。

#### 新興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	11,910,535,477
コール・ローン	538,277,922
株式	453,069,968,300
投資証券	545,744,253
派生商品評価勘定	626,117
未収入金	58,257,306
未収配当金	1,735,953,784
差入委託証拠金	3,231,934,990
流動資産合計	471,091,298,149
資産合計	471,091,298,149
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	445,665,785
未払解約金	348,379,449
未払利息	1,352
流動負債合計	794,046,586
負債合計	794,046,586
純資産の部	
元本等	
元本	141,910,940,342
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	328,386,311,221
元本等合計	470,297,251,563
純資産合計	470,297,251,563
負債純資産合計	471,091,298,149

## 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。なお、ロシア株式(DR(預託証券))を含みます。以下、同じ。)の評価については、「重要な会計上の見積りに関する注記」に記載しております。 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)

#### 1. ロシア株式(以下、「当該株式」)の時価の算定

##### (1) 当期の財務諸表に計上した金額

当該株式の評価額0円(2022年3月11日評価額1,506,109,929円(保有割合0.55%))

##### (2) 会計上の見積りの内容について財務諸表利用者の理解に資するその他の情報

###### ① 当期の財務諸表に計上した金額の算出方法及び算出に用いた主要な仮定

2022年2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やSWIFTからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については

金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。

時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022年3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。

なお、2022年3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。

## ②翌期の財務諸表への影響

今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。

## (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	103,718,140,955円
期中追加設定元本額	63,035,820,950円
期中一部解約元本額	24,843,021,563円
元本の内訳※	
MAXIS全世界株式(オール・カントリー)上場投信	826,416,880円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,974,481,306円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,770,817,994円
eMAXIS バランス(波乗り型)	72,791,495円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	576,804,180円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	7,870,418,696円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	34,974,853,640円
つみたて新興国株式	7,375,054,628円
つみたて8資産均等バランス	3,772,079,947円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	502,172円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,440,740円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,791,662円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	9,475,916,321円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	803,868,159円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	39,493,212,930円
新興国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	1,633,872,187円
つみたて全世界株式	51,205,305円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	807,988,773円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	38,745,046円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	664,873,026円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	603,023,062円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	15,776,103,196円
新興国株式インデックスオープン	498,726,743円
eMAXIS 全世界株式インデックス	994,576,889円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	291,636,771円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	32,494,561円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	185,712,462円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	192,653,018円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	773,606,929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)	1,083,137,253円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	17,398,962円

MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	56,902,468円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	57,042,266円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	56,220,682円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	49,764,870円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	50,805,123円
合計	141,910,940,342円
2. 受益権の総数	141,910,940,342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、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。
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	6,347,126,994	
投資証券	△6,497,379	
合計	6,340,629,615	

(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	17,510,360,201	—	17,064,871,102	△445,489,099
合計		17,510,360,201	—	17,064,871,102	△445,489,099

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	570,346,134	—	570,964,243	618,109
	売建				
	オフショア円	16,993,566	—	17,162,244	△168,678
合計		587,339,700	—	588,126,487	449,431

(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。
  - 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。
  - 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。
    - 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。
    - 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	3.3140円
(1万口当たり純資産額)	(33,140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	GAZPROM PJSC	3,587,358	—	—	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	535,200	1.34	719,308.80	
	LUKOIL PJSC	122,600	—	—	
	NOVATEK PJSC	282,700	—	—	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	384,962	—	—	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	2,405,300	—	—	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	2,315,000	—	—	
	TATNEFT PJSC	455,759	—	—	
	ALROSA PJSC	745,960	—	—	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	130,323	7.44	969,603.12	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	19,483	—	—	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	439,080	—	—	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	53,979	—	—	
	POLYUS PJSC	10,871	—	—	
	SEVERSTAL PJSC	62,882	—	—	
	SOUTHERN COPPER CORP	40,491	71.25	2,884,983.75	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL	1,071,810	—	—	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	199,896	25.27	5,051,371.92	
	NIO INC - ADR	655,010	8.43	5,521,734.30	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	92,867	38.39	3,565,164.13	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	229,758	5.59	1,284,347.22		

	YUM CHINA HOLDINGS INC	196,749	56.28	11,073,033.72	
	AUTOHOME INC-ADR	38,791	28.82	1,117,956.62	
	IQIYI INC-ADR	186,085	5.00	930,425.00	
	JOYY INC-ADR	20,462	29.18	597,081.16	
	KANZHUN LTD - ADR	92,379	14.75	1,362,590.25	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	352,017	7.45	2,622,526.65	
	VK CO LTD	34,689	—	—	
	WEIBO CORP-SPON ADR	33,274	13.35	444,207.90	
	YANDEX NV-A	92,564	—	—	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	46,958	15.59	732,075.22	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	20,405	—	—	
	PDD HOLDINGS INC	239,515	69.80	16,718,147.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	155,264	16.38	2,543,224.32	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	2	—	—	
	MAGNIT PJSC	23,556	—	—	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	34,286	—	—	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	27,400	74.28	2,035,272.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	1,570,713	1.15	1,806,319.95	
	CREDICORP LTD	29,340	144.30	4,233,762.00	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	796,628	—	—	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	38,258	—	—	
	VTB BANK PJSC	1,305,990,000	—	—	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	258,676	1.37	354,386.12	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	425,170	—	—	
	QIFU TECHNOLOGY INC	54,200	16.30	883,460.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	320,772	2.62	840,422.64	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	172,850	—	—	
	INTER RAO UES PJSC	12,239,000	—	—	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	30,320	37.77	1,145,186.40	
	KE HOLDINGS INC-ADR	314,583	14.94	4,699,870.02	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	402,594	0.62	250,816.06	
	アメリカドル 小計	1,338,078,789		74,387,276.27 (10,673,830,271)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	1,149,000	5.54	6,365,460.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	824,000	7.68	6,328,320.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	12,126,000	4.43	53,718,180.00	

CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,617,500	23.05	37,283,375.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	858,000	7.56	6,486,480.00	
PETROCHINA CO LTD-H	9,609,000	5.44	52,272,960.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	658,000	20.60	13,554,800.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,820,000	3.34	6,078,800.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	628,000	20.45	12,842,600.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,077,000	6.12	6,591,240.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,036,000	4.73	9,630,280.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	914,000	3.23	2,952,220.00	
CMOC GROUP LTD-H	1,620,000	4.21	6,820,200.00	
DONGYUE GROUP	804,000	5.19	4,172,760.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	131,120	52.10	6,831,352.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	460,000	12.26	5,639,600.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	722,000	4.63	3,342,860.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	290,250	14.48	4,202,820.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	660,000	10.34	6,824,400.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2,586,000	11.80	30,514,800.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,247,000	3.62	4,514,140.00	
BOC AVIATION LTD	97,300	60.30	5,867,190.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,132,000	3.73	4,222,360.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	775,500	10.02	7,770,510.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	499,000	4.93	2,460,070.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,586,000	4.93	7,818,980.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	570,000	8.28	4,719,600.00	
CITIC LTD	2,820,000	9.81	27,664,200.00	
CRRC CORP LTD - H	1,934,000	4.28	8,277,520.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,324,500	5.20	6,887,400.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	339,000	17.50	5,932,500.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	500,000	9.81	4,905,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	756,800	10.88	8,233,984.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	258,000	28.65	7,391,700.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	1,958,111	2.93	5,737,265.23	
AIR CHINA LTD-H	758,000	5.66	4,290,280.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,018,000	4.96	5,049,280.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	492,000	10.48	5,156,160.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	618,000	4.48	2,768,640.00	

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	1,515,600	6.87	10,412,172.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,062,000	4.70	4,991,400.00	
JD LOGISTICS INC	780,700	12.20	9,524,540.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	806,000	7.78	6,270,680.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	61,000	98.70	6,020,700.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	816,000	6.36	5,189,760.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	606,000	5.99	3,629,940.00	
BYD CO LTD-H	469,000	256.00	120,064,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,236,000	3.34	4,128,240.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	319,200	29.55	9,432,360.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	2,942,000	9.23	27,154,660.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	1,278,000	8.66	11,067,480.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	888,945	4.43	3,938,026.35	
LI AUTO INC-CLASS A	530,444	132.20	70,124,696.80	
MINTH GROUP LTD	364,000	20.85	7,589,400.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	533,424	39.60	21,123,590.40	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	604,000	16.80	10,147,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	573,800	81.20	46,592,560.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	1,462,000	3.45	5,043,900.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	1,105,600	23.75	26,258,000.00	
LI NING CO LTD	1,114,000	42.95	47,846,300.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	384,600	74.05	28,479,630.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	549,000	7.84	4,304,160.00	
EAST BUY HOLDING LTD	170,000	26.40	4,488,000.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	879,000	16.94	14,890,260.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	314,000	12.64	3,968,960.00	
MEITUAN-CLASS B	2,393,320	124.70	298,447,004.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	689,780	29.25	20,176,065.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	630,000	16.74	10,546,200.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	548,000	13.34	7,310,320.00	
TRIP.COM GROUP LTD	256,529	275.40	70,648,086.60	
BAIDU INC-CLASS A	1,076,674	138.20	148,796,346.80	
BILIBILI INC-CLASS Z	93,535	120.20	11,242,907.00	
CHINA LITERATURE LTD	220,600	35.05	7,732,030.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,556,000	1.84	4,703,040.00	
KINGSOFT CORP LTD	468,600	32.55	15,252,930.00	

KUAI SHOU TECHNOLOGY	1,121,100	54.15	60,707,565.00
NETEASE INC	933,195	147.10	137,272,984.50
TENCENT HOLDINGS LTD	2,936,500	337.00	989,600,500.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	7,810,900	84.05	656,506,145.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	406,000	8.12	3,296,720.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	31,400	119.50	3,752,300.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	874,600	14.70	12,856,620.00
JD.COM INC - CL A	1,112,833	140.10	155,907,903.30
POP MART INTERNATIONAL GROUP	231,000	17.00	3,927,000.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	970,000	6.66	6,460,200.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	296,500	28.95	8,583,675.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,266,000	4.47	10,129,020.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	531,250	47.55	25,260,937.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	187,100	18.74	3,506,254.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	47,100	133.00	6,264,300.00
CHINA FEIHE LTD	1,917,000	4.27	8,185,590.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	—	—
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,497,000	30.05	44,984,850.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	764,000	50.05	38,238,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	927,500	2.72	2,522,800.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	851,400	42.25	35,971,650.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	797,000	7.82	6,232,540.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	904,000	12.02	10,866,080.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	270,000	68.70	18,549,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	561,000	6.80	3,814,800.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,514,000	5.13	12,896,820.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	292,000	16.78	4,899,760.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	302,500	33.30	10,073,250.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	175,000	19.84	3,472,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	170,600	43.15	7,361,390.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	298,400	12.50	3,730,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,232,000	10.10	12,443,200.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	265,300	14.34	3,804,402.00
SINOPHARM GROUP CO-H	612,400	23.60	14,452,640.00
3SBIO INC	1,286,000	7.24	9,310,640.00
AKESO INC	211,000	33.25	7,015,750.00

BEIGENE LTD	331,423	109.00	36,125,107.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	633,000	12.48	7,899,840.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	847,500	6.54	5,542,650.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,306,000	3.58	4,675,480.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	4,331,840	6.65	28,806,736.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	494,000	18.00	8,892,000.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	81,100	42.50	3,446,750.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	506,000	12.22	6,183,320.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	506,500	30.45	15,422,925.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	104,400	23.35	2,437,740.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	240,500	20.45	4,918,225.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	5,020,500	3.33	16,718,265.00
WUXI APPTEC CO LTD-H	123,140	61.40	7,560,796.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	1,809,500	37.75	68,308,625.00
ZAI LAB LTD	439,310	19.96	8,768,627.60
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	13,823,000	3.01	41,607,230.00
BANK OF CHINA LTD-H	37,503,000	3.11	116,634,330.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3,721,900	5.04	18,758,376.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	3,950,000	4.02	15,879,000.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	44,708,550	5.00	223,542,750.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,189,000	2.38	2,829,820.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,880,050	35.15	66,083,757.50
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	2,919,320	2.82	8,232,482.40
IND & COMM BK OF CHINA-H	26,636,350	4.13	110,008,125.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	3,720,000	4.87	18,116,400.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	5,572,000	0.79	4,401,880.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,621,500	4.13	6,696,795.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	768,000	13.32	10,229,760.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	907,000	14.10	12,788,700.00
FAR EAST HORIZON LTD	816,000	6.10	4,977,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	442,400	10.58	4,680,592.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,858,800	5.01	9,312,588.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	284,600	9.33	2,655,318.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	3,482,000	12.96	45,126,720.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,256,000	19.20	24,115,200.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	723,200	8.00	5,785,600.00

NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	445,900	20.20	9,007,180.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	3,392,000	2.98	10,108,160.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	3,332,000	9.29	30,954,280.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	3,016,000	49.30	148,688,800.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	306,800	21.15	6,488,820.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	1,144,000	5.01	5,731,440.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	351,476	11.20	3,936,531.20	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	1,279,000	10.32	13,199,280.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	383,500	17.28	6,626,880.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	347,500	22.70	7,888,250.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	306,000	20.60	6,303,600.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	449,500	7.11	3,195,945.00	
LENOVO GROUP LTD	3,320,000	8.05	26,726,000.00	
SUNNY OPTICAL TECH	349,300	73.10	25,533,830.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	7,177,200	9.99	71,700,228.00	
ZTE CORP-H	205,731	29.20	6,007,345.20	
CHINA TOWER CORP LTD-H	19,744,000	0.86	16,979,840.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	206,000	28.85	5,943,100.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,488,000	1.78	2,648,640.00	
CGN POWER CO LTD-H	5,163,000	1.86	9,603,180.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,295,800	8.66	11,221,628.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,511,000	7.76	11,725,360.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,292,000	2.68	6,142,560.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	421,400	26.00	10,956,400.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	932,000	16.32	15,210,240.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	376,600	95.85	36,097,110.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,434,000	6.85	9,822,900.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	1,700,000	4.55	7,735,000.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,992,000	5.80	11,553,600.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	146,000	25.45	3,715,700.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	9,280,000	1.71	15,868,800.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	251,000	24.85	6,237,350.00	
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	153,000	18.08	2,766,240.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,238,000	8.53	19,090,140.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	299,000	17.70	5,292,300.00	

	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,660,000	1.13	3,005,800.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	1,837,500	16.46	30,245,250.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	610,000	7.69	4,690,900.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	1,510,000	31.75	47,942,500.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	343,600	37.95	13,039,620.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	1,072,551	10.10	10,832,765.10	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	5,470,232	1.59	8,697,668.88	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	952,000	9.34	8,891,680.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	525,500	7.21	3,788,855.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	480,000	3.63	1,742,400.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	877,500	18.58	16,303,950.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	768,000	8.59	6,597,120.00	
	香港ドル 小計	394,898,983		5,590,922,194.86 (102,425,694,609)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	2,239,880	2.09	4,681,349.20	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	149,300	21.40	3,195,020.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,214,900	6.17	7,495,933.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,877,500	4.74	8,899,350.00	
	GAMUDA BHD	1,012,100	4.46	4,513,966.00	
	SIME DARBY BERHAD	1,129,200	2.05	2,314,860.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	349,900	6.82	2,386,318.00	
	MISC BHD	522,300	7.19	3,755,337.00	
	GENTING BHD	916,400	4.08	3,738,912.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	1,221,400	2.48	3,029,072.00	
	MR DIY GROUP M BHD	978,000	1.57	1,535,460.00	
	IOI CORP BHD	1,053,200	3.74	3,938,968.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	189,000	21.78	4,116,420.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	30,900	130.90	4,044,810.00	
	PPB GROUP BERHAD	294,240	15.96	4,696,070.40	
	QL RESOURCES BHD	521,250	5.35	2,788,687.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	967,000	4.30	4,158,100.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	1,220,300	5.86	7,150,958.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	2,865,100	0.86	2,463,986.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	902,300	3.62	3,266,326.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,300,000	5.21	17,193,000.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	286,800	18.80	5,391,840.00	



	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	122,500	17.44	2,136,400.00	
	MALAYAN BANKING BHD	2,559,800	8.74	22,372,652.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	6,828,600	3.88	26,494,968.00	
	RHB BANK BHD	682,449	5.40	3,685,224.60	
	AXIATA GROUP BERHAD	1,195,000	2.65	3,166,750.00	
	CELCOMDIGI BHD	1,398,100	4.25	5,941,925.00	
	MAXIS BHD	1,122,400	4.13	4,635,512.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	653,000	4.99	3,258,470.00	
	PETRONAS GAS BHD	447,000	16.74	7,482,780.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	1,209,600	9.20	11,128,320.00	
	INARI AMERTRON BHD	1,618,200	2.73	4,417,686.00	
	マレーシアリングット 小計	41,077,619		199,475,430.70 (6,120,624,325)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,493,000	9.15	31,960,950.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	652,200	149.00	97,177,800.00	
	PTT PCL-NVDR	4,709,600	31.75	149,529,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	324,900	44.50	14,458,050.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	787,000	34.25	26,954,750.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,048,461	37.25	39,055,172.25	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	561,600	38.00	21,340,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	375,450	325.00	122,021,250.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	1,990,800	71.50	142,342,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	3,539,400	8.30	29,377,020.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	2,999,900	7.40	22,199,260.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	3,667,900	4.88	17,899,352.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,449,100	33.50	48,544,850.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	955,517	37.75	36,070,766.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	2,749,501	13.90	38,218,063.90	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	1,193,900	20.90	24,952,510.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	593,600	35.25	20,924,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	2,735,500	61.75	168,917,125.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	1,253,700	35.00	43,879,500.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	139,600	63.75	8,899,500.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,996,400	19.90	39,728,360.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	931,700	30.00	27,951,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	4,945,800	28.25	139,718,850.00	

	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	263,500	228.00	60,078,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	277,200	130.00	36,036,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	1,770,600	19.40	34,349,640.00	
	SCB X PCL-NVDR	370,400	107.50	39,818,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	418,000	50.50	21,109,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	402,800	38.50	15,507,800.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	355,100	47.75	16,956,025.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	1,471,300	99.00	145,658,700.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	551,100	211.00	116,282,100.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	513,100	71.75	36,814,925.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	5,276,828	6.15	32,452,492.20	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	611,700	35.25	21,562,425.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	90,600	135.50	12,276,300.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	751,800	58.00	43,604,400.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	372,600	57.75	21,517,650.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	1,362,800	44.50	60,644,600.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	494,800	36.50	18,060,200.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	945,800	62.25	58,876,050.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	3,795,800	8.35	31,694,930.00	
	タイパーツ 小計	63,190,357		2,135,420,567.10 (8,691,161,708)	
フィリピンペン	ABOUTIZ EQUITY VENTURES INC	924,980	53.95	49,902,671.00	
	AYALA CORPORATION	156,455	615.00	96,219,825.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	930,349	43.00	40,005,007.00	
	SM INVESTMENTS CORP	117,275	909.50	106,661,612.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	507,200	199.70	101,287,840.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	261,310	240.20	62,766,662.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	367,600	126.50	46,501,400.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	840,145	106.20	89,223,399.00	
	BDO UNIBANK INC	1,062,476	140.00	148,746,640.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	842,956	53.40	45,013,850.40	
	PLDT INC	35,425	1,342.00	47,540,350.00	
	ACEN CORP	335,365	5.18	1,737,190.70	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	113,060	326.00	36,857,560.00	
	AYALA LAND INC	3,327,220	24.40	81,184,168.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	4,994,200	33.00	164,808,600.00	

	フィリピンペソ 小計	14,816,016		1,118,456,775.60 (2,877,677,437)
インドネシア ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	6,965,600	2,230.00	15,533,288,000.00
	UNITED TRACTORS TBK PT	821,600	23,375.00	19,204,900,000.00
	ANEKA TAMBANG TBK	3,302,400	2,010.00	6,637,824,000.00
	BARITO PACIFIC TBK PT	13,337,270	740.00	9,869,579,800.00
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	1,246,400	8,275.00	10,313,960,000.00
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	6,416,400	3,150.00	20,211,660,000.00
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,836,700	6,125.00	11,249,787,500.00
	VALE INDONESIA TBK	995,100	6,300.00	6,269,130,000.00
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	9,740,800	6,775.00	65,993,920,000.00
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	364,052,100	113.00	41,137,887,300.00
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	7,091,700	2,610.00	18,509,337,000.00
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	3,067,700	5,200.00	15,952,040,000.00
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,010,700	11,175.00	11,294,572,500.00
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	2,112,200	7,300.00	15,419,060,000.00
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	3,086,500	4,270.00	13,179,355,000.00
	KALBE FARMA TBK PT	9,978,000	2,050.00	20,454,900,000.00
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	26,295,300	9,050.00	237,972,465,000.00
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	17,688,500	5,075.00	89,769,137,500.00
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	3,445,700	9,025.00	31,097,442,500.00
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	32,398,400	5,400.00	174,951,360,000.00
SARANA MENARA NUSANTARA PT	11,186,200	1,055.00	11,801,441,000.00	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	23,296,600	3,950.00	92,021,570,000.00	
	インドネシアピア 小計	549,371,870		938,844,617,100.00 (9,012,908,324)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	7,080,668	11.89	84,189,142.52
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,472,470	83.22	122,538,953.40
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	102,805	247.03	25,395,919.15
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	468,098	36.50	17,085,577.00
	ALFA S. A. B. -A	1,531,900	10.93	16,743,667.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	301,200	120.50	36,294,600.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	174,300	307.67	53,626,881.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	88,800	480.73	42,688,824.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	106,465	175.45	18,679,284.25
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	1,036,800	17.22	17,853,696.00

	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	2,461,000	67.71	166,634,310.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	263,866	177.93	46,949,677.38	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	270,100	149.07	40,263,807.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	911,900	186.07	169,677,233.00	
	GRUMA S. A. B. -B	89,175	269.63	24,044,255.25	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	620,000	91.94	57,002,800.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	712,600	38.91	27,727,266.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	357,300	51.98	18,572,454.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,229,300	137.97	169,606,521.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	991,400	41.67	41,311,638.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	14,681,200	18.54	272,189,448.00	
	メキシコペソ 小計	34,951,347		1,469,075,953.95 (12,306,889,989)	
ブラジルリアル	COSAN SA	560,800	18.04	10,116,832.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,722,100	33.90	58,379,190.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	2,289,900	30.16	69,063,384.00	
	PRIO SA	322,100	38.21	12,307,441.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	306,800	18.11	5,556,148.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	310,700	12.83	3,986,281.00	
	GERDAU SA-PREF	585,900	25.13	14,723,667.00	
	KLABIN SA - UNIT	397,200	22.70	9,016,440.00	
	SUZANO SA	338,622	45.94	15,556,294.68	
	VALE SA	1,594,329	65.90	105,066,281.10	
	WEG SA	790,988	36.60	28,950,160.80	
	CCR SA	527,800	14.15	7,468,370.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	353,713	67.50	23,875,627.50	
	RUMO SA	592,900	21.82	12,937,078.00	
	LOJAS RENNER S. A.	503,122	22.31	11,224,651.82	
	MAGAZINE LUIZA SA	1,497,500	3.58	5,361,050.00	
	VIBRA ENERGIA SA	569,500	18.38	10,467,410.00	
	ATACADA0 SA	343,900	11.31	3,889,509.00	
	RAIA DROGASIL SA	613,512	29.07	17,834,793.84	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	579,600	14.30	8,288,280.00	
	AMBEV SA	2,199,700	15.49	34,073,353.00	
	JBS SA	399,800	17.18	6,868,564.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	418,400	17.49	7,317,816.00	

	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,471,971	4.33	10,703,634.43	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	264,500	33.37	8,826,365.00	
	HYPERA SA	205,800	43.74	9,001,692.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	763,437	14.66	11,191,986.42	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	2,522,286	16.59	41,844,724.74	
	BANCO DO BRASIL S.A.	392,300	51.02	20,015,146.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	177,400	30.71	5,447,954.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,292,530	28.67	65,726,835.10	
	ITAUSA SA	2,339,145	9.66	22,596,140.70	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	2,750,625	14.43	39,691,518.75	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	572,800	30.33	17,373,024.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	315,000	30.59	9,635,850.00	
	TOTVS SA	247,700	29.77	7,374,029.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	219,375	42.72	9,371,700.00	
	TIM SA	382,377	14.53	5,555,937.81	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	103,700	44.92	4,658,204.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	599,100	40.08	24,011,928.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	515,990	12.91	6,661,430.90	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	155,400	55.76	8,665,104.00	
	CPFL ENERGIA SA	104,700	33.70	3,528,390.00	
	ENERGISA SA-UNITS	86,100	48.34	4,162,074.00	
	ENEVA SA	383,000	12.32	4,718,560.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	96,550	45.95	4,436,472.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	487,900	31.50	15,368,850.00	
	ブラジルリアル 小計	36,268,572		842,896,174.09 (25,269,943,009)	
チリペン	EMPRESAS COPEC SA	179,570	5,950.00	1,068,441,500.00	
	EMPRESAS CMPC SA	544,129	1,491.00	811,296,339.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	69,297	56,115.00	3,888,601,155.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	6,502,900	54.05	351,481,745.00	
	FALABELLA SA	290,088	1,856.10	538,432,336.00	
	CENCOSUD SA	686,091	1,545.00	1,060,010,595.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	71,640	6,485.00	464,585,400.00	
	BANCO DE CHILE	20,282,094	81.40	1,650,962,451.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	31,356	23,855.00	747,997,380.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	34,054,503	36.92	1,257,292,250.00	

	ENEL AMERICAS SA	10,525,905	106.82	1,124,377,172.00	
	ENEL CHILE SA	12,211,839	52.90	646,006,283.00	
	チリペソ 小計	85,449,412		13,609,484,606.00 (2,422,148,022)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	25,764	62,300.00	1,605,097,200.00	
	S-OIL CORP	21,502	70,000.00	1,505,140,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	27,257	182,600.00	4,977,128,200.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	48,651	43,250.00	2,104,155,750.00	
	HYUNDAI STEEL CO	40,550	32,850.00	1,332,067,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	4,147	486,500.00	2,017,515,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	8,081	133,500.00	1,078,813,500.00	
	LG CHEM LTD	22,687	709,000.00	16,085,083,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	4,941	370,000.00	1,828,170,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	9,469	170,400.00	1,613,517,600.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	14,934	375,000.00	5,600,250,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	33,725	392,000.00	13,220,200,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	12,000	95,400.00	1,144,800,000.00	
	SKC CO LTD	8,074	107,600.00	868,762,400.00	
	CJ CORP	6,002	71,800.00	430,943,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	23,889	57,600.00	1,376,006,400.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	231,461	18,110.00	4,191,758,710.00	
	ECOPRO BM CO LTD	24,849	263,000.00	6,535,287,000.00	
	GS HOLDINGS	8,112	36,950.00	299,738,400.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	15,292	134,400.00	2,055,244,800.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	9,100	128,100.00	1,165,710,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	20,092	115,900.00	2,328,662,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	26,551	38,400.00	1,019,558,400.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	10,557	82,100.00	866,729,700.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	32,869	54,500.00	1,791,360,500.00	
	LG CORP	42,409	87,700.00	3,719,269,300.00	
	LG ENERGY SOLUTION	16,492	563,000.00	9,284,996,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	20,000	37,450.00	749,000,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	37,807	104,000.00	3,931,928,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	71,394	28,000.00	1,999,032,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	300,580	6,620.00	1,989,839,600.00		
SK INC	14,361	158,200.00	2,271,910,200.00		

SK SQUARE CO LTD	49,040	45,250.00	2,219,060,000.00	
HMM CO LTD	132,330	18,570.00	2,457,368,100.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	8,473	186,000.00	1,575,978,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	83,648	23,650.00	1,978,275,200.00	
PAN OCEAN CO LTD	128,072	5,110.00	654,447,920.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	34,955	33,500.00	1,170,992,500.00	
HANON SYSTEMS	106,991	9,110.00	974,688,010.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	29,284	217,000.00	6,354,628,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	63,892	199,900.00	12,772,010,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	17,752	109,800.00	1,949,169,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	10,895	109,100.00	1,188,644,500.00	
KIA CORP	123,466	83,400.00	10,297,064,400.00	
COWAY CO LTD	30,042	43,450.00	1,305,324,900.00	
F&F CO LTD / NEW	9,200	125,400.00	1,153,680,000.00	
LG ELECTRONICS INC	50,381	123,300.00	6,211,977,300.00	
KANGWON LAND INC	47,178	17,050.00	804,384,900.00	
HYBE CO LTD	8,133	301,000.00	2,448,033,000.00	
KAKAO CORP	147,375	49,700.00	7,324,537,500.00	
KAKAO GAMES CORP	16,300	34,750.00	566,425,000.00	
KRAFTON INC	13,066	201,500.00	2,632,799,000.00	
NAVER CORP	61,701	188,900.00	11,655,318,900.00	
NCSOFT CORP	7,497	301,500.00	2,260,345,500.00	
NETMARBLE CORP	12,296	51,900.00	638,162,400.00	
PEARL ABYSS CORP	17,435	51,200.00	892,672,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	12,861	72,300.00	929,850,300.00	
BGF RETAIL CO LTD	4,754	179,800.00	854,769,200.00	
E-MART INC	11,844	78,400.00	928,569,600.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	3,867	273,500.00	1,057,624,500.00	
KT&G CORP	49,792	82,800.00	4,122,777,600.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	12,195	125,300.00	1,528,033,500.00	
AMOREPACIFIC CORP	14,756	101,100.00	1,491,831,600.00	
LG H&H	4,130	493,500.00	2,038,155,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	52,778	69,500.00	3,668,071,000.00	
HLB INC	49,202	31,100.00	1,530,182,200.00	
CELLTRION INC	52,975	163,900.00	8,682,602,500.00	
CELLTRION PHARM INC	9,961	81,000.00	806,841,000.00	

HANMI PHARM CO LTD	3,618	314,000.00	1,136,052,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	8,428	747,000.00	6,295,716,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	17,376	84,500.00	1,468,272,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	8,100	77,800.00	630,180,000.00	
YUHAN CORP	22,310	57,900.00	1,291,749,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	144,044	39,950.00	5,754,557,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	137,043	10,180.00	1,395,097,740.00	
KAKAOBANK CORP	64,800	23,650.00	1,532,520,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	183,891	46,950.00	8,633,682,450.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	208,440	34,400.00	7,170,336,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	255,624	11,930.00	3,049,594,320.00	
KAKAOPAY CORP	11,248	47,100.00	529,780,800.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	20,102	50,400.00	1,013,140,800.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	47,390	42,050.00	1,992,749,500.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	119,622	7,120.00	851,708,640.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	60,045	9,490.00	569,827,050.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	23,495	35,600.00	836,422,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	20,186	74,900.00	1,511,931,400.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	13,865	223,000.00	3,091,895,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	39,812	63,900.00	2,543,986,800.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	14,353	121,500.00	1,743,889,500.00	
COSMOAM&T CO LTD	10,057	209,000.00	2,101,913,000.00	
L&F CO LTD	13,593	253,500.00	3,445,825,500.00	
LG DISPLAY CO LTD	106,843	16,470.00	1,759,704,210.00	
LG INNOTEK CO LTD	7,648	306,500.00	2,344,112,000.00	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	10,954	56,500.00	618,901,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	25,952	142,400.00	3,695,564,800.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,248,851	71,600.00	161,017,731,600.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	386,532	59,400.00	22,960,000,800.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	25,998	683,000.00	17,756,634,000.00	
KT CORP	30,000	30,500.00	915,000,000.00	
LG UPLUS CORP	93,715	10,880.00	1,019,619,200.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	123,327	18,310.00	2,258,117,370.00	
SK HYNIX INC	258,567	113,600.00	29,373,211,200.00	
韓国ウォン 小計	7,447,945		512,422,394,970.00 (56,263,978,967)	



ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	459,150	87.50	40,175,625.00	
	ASIA CEMENT CORP	1,113,281	44.20	49,207,020.20	
	CHINA STEEL CORP	5,586,947	29.65	165,652,978.55	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	1,561,430	68.10	106,333,383.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	1,853,600	92.80	172,014,080.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	2,235,557	78.60	175,714,780.20	
	TAIWAN CEMENT	2,862,696	38.70	110,786,335.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	63,000	1,035.00	65,205,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,512,138	33.05	49,976,160.90	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	30,000	1,930.00	57,900,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	1,314,000	46.25	60,772,500.00	
	CHINA AIRLINES LTD	1,582,000	27.90	44,137,800.00	
	EVA AIRWAYS CORP	1,061,000	40.45	42,917,450.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	460,353	158.00	72,735,774.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	746,000	32.60	24,319,600.00	
	WAN HAI LINES LTD	322,845	60.20	19,435,269.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	791,000	61.50	48,646,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	894,413	41.00	36,670,933.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	80,728	500.00	40,364,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	225,981	199.00	44,970,219.00	
	GIANT MANUFACTURING	152,000	222.00	33,744,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	78,000	341.50	26,637,000.00	
	POU CHEN	1,066,500	31.80	33,914,700.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	144,000	824.00	118,656,000.00	
	MOMO.COM INC	29,600	682.00	20,187,200.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	256,000	284.50	72,832,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	2,241,624	77.40	173,501,697.60	
	PHARMAESSENTIA CORP	103,000	325.00	33,475,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,148,671	18.75	40,287,581.25	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	8,330,955	25.10	209,106,970.50	
	E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	6,358,236	26.40	167,857,430.40	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	5,033,164	27.90	140,425,275.60	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	4,549,109	22.35	101,672,586.15	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	5,256,047	37.75	198,415,774.25		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	5,225,888	17.25	90,146,568.00		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	4,934,995	19.15	94,505,154.25		

TAIWAN BUSINESS BANK	2,977,000	14.20	42,273,400.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	4,884,355	28.20	137,738,811.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	1,849,000	45.70	84,499,300.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	682,270	201.50	137,477,405.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	4,793,219	24.35	116,714,882.65	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,454,366	44.40	197,773,850.40	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	7,186,255	12.70	91,265,438.50	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	3,502,959	61.40	215,081,682.60	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	5,808,852	9.01	52,337,756.52	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	230,000	358.00	82,340,000.00	
ACER INC	1,364,168	33.70	45,972,461.60	
ADVANTECH CO LTD	219,134	418.00	91,598,012.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	323,774	314.50	101,826,923.00	
AUO CORP	3,377,800	20.10	67,893,780.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	293,000	190.00	55,670,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	2,006,775	29.35	58,898,846.25	
DELTA ELECTRONICS INC	921,220	364.00	335,324,080.00	
E INK HOLDINGS INC	383,000	222.00	85,026,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	5,771,272	113.00	652,153,736.00	
INNOLUX CORP	3,960,381	16.50	65,346,286.50	
INVENTEC CORP	1,291,429	44.75	57,791,447.75	
LARGAN PRECISION CO LTD	48,820	2,130.00	103,986,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,029,160	105.00	108,061,800.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	345,000	176.00	60,720,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	114,000	278.00	31,692,000.00	
PEGATRON CORP	917,976	77.00	70,684,152.00	
QUANTA COMPUTER INC	1,221,150	151.50	185,004,225.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	631,193	59.40	37,492,864.20	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	685,000	187.00	128,095,000.00	
WISTRON CORP	1,157,000	84.10	97,303,700.00	
WIWYNN CORP	42,000	1,215.00	51,030,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	826,168	54.80	45,274,006.40	
YAGEO CORPORATION	160,738	491.00	78,922,358.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	346,000	106.50	36,849,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,762,000	126.00	222,012,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	744,000	77.00	57,288,000.00	

	TAIWAN MOBILE CO LTD	780,400	101.50	79,210,600.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,500,294	126.50	189,787,191.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	29,000	2,240.00	64,960,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	40,000	1,625.00	65,000,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	101,000	493.50	49,843,500.00	
	MEDIATEK INC	720,236	693.00	499,123,548.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	585,000	74.60	43,641,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	278,000	450.00	125,100,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	47,000	1,155.00	54,285,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	1,523,000	31.95	48,659,850.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	210,703	391.00	82,384,873.00	
	SILERGY CORP	148,000	377.00	55,796,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	11,617,000	581.00	6,749,477,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	5,428,000	53.90	292,569,200.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	473,000	88.20	41,718,600.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	164,000	170.00	27,880,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	1,438,000	28.95	41,630,100.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	961,268	35.85	34,461,457.80	
	ニュー台湾ドル 小計	163,018,243		15,618,248,071.22 (72,381,208,861)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	425,063	359.60	152,852,654.80	
	COAL INDIA LTD	742,855	225.90	167,810,944.50	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	281,412	269.45	75,826,463.40	
	INDIAN OIL CORP LTD	1,200,931	89.30	107,243,138.30	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,420,841	156.90	222,929,952.90	
	PETRONET LNG LTD	330,086	218.80	72,222,816.80	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,433,774	2,514.75	3,605,583,166.50	
	ACC LTD	29,062	1,766.90	51,349,647.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	287,173	425.80	122,278,263.40	
	ASIAN PAINTS LTD	181,473	3,297.70	598,443,512.10	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	102,972	675.65	69,573,031.80	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	125,590	1,716.10	215,524,999.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	644,358	408.50	263,220,243.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	179,644	568.85	102,190,489.40	
	JSW STEEL LTD	311,469	746.50	232,511,608.50	
	PI INDUSTRIES LTD	35,931	3,807.40	136,803,689.40	

PIDILITE INDUSTRIES LTD	70,349	2,658.30	187,008,746.70
SHREE CEMENT LTD	4,903	25,145.25	123,287,160.75
SRF LTD	68,000	2,321.40	157,855,200.00
TATA STEEL LTD	3,473,677	109.60	380,714,999.20
ULTRATECH CEMENT LTD	53,768	8,080.20	434,456,193.60
UPL LTD	227,928	666.85	151,993,786.80
VEDANTA LTD	364,582	276.20	100,697,548.40
ABB INDIA LTD	24,900	4,239.70	105,568,530.00
ADANI ENTERPRISES LTD	85,087	2,233.55	190,046,068.85
BHARAT ELECTRONICS LTD	1,669,456	120.05	200,418,192.80
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	262,989	368.80	96,990,343.20
HAVELLS INDIA LTD	121,646	1,284.95	156,309,027.70
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	35,527	3,640.55	129,337,819.85
LARSEN & TOUBRO LTD	323,681	2,389.55	773,451,933.55
SIEMENS LTD	50,469	3,675.70	185,508,903.30
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	128,900	627.80	80,923,420.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	242,722	714.30	173,376,324.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	131,294	642.40	84,343,265.60
INTERGLOBE AVIATION LTD	71,702	2,475.05	177,466,035.10
BAJAJ AUTO LTD	30,404	4,622.60	140,545,530.40
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	38,519	2,397.05	92,331,968.95
BHARAT FORGE LTD	117,494	807.00	94,817,658.00
EICHER MOTORS LTD	63,410	3,539.20	224,420,672.00
HERO MOTOCORP LTD	50,721	2,776.40	140,821,784.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	450,437	1,373.25	618,562,610.25
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	63,443	9,327.30	591,751,893.90
MRF LTD	969	99,492.05	96,407,796.45
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	967,001	83.10	80,357,783.10
SONA BLW PRECISION FORGINGS	164,220	506.90	83,243,118.00
TATA MOTORS LTD	767,605	559.65	429,590,138.25
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	54,300	3,164.05	171,807,915.00
TVS MOTOR CO LTD	98,759	1,301.25	128,510,148.75
PAGE INDUSTRIES LTD	3,050	37,676.50	114,913,325.00
TITAN CO LTD	168,363	2,939.15	494,844,111.45
INDIAN HOTELS CO LTD	372,300	380.40	141,622,920.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	184,460	478.85	88,328,671.00

ZOMATO LTD	1, 745, 700	74. 15	129, 443, 655. 00
INFO EDGE INDIA LTD	37, 381	4, 306. 90	160, 996, 228. 90
TRENT LTD	81, 716	1, 724. 95	140, 956, 014. 20
AVENUE SUPERMARTS LTD	74, 427	3, 744. 05	278, 658, 409. 35
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	49, 279	4, 970. 80	244, 956, 053. 20
ITC LTD	1, 397, 107	444. 75	621, 363, 338. 25
MARICO LTD	250, 392	528. 50	132, 332, 172. 00
NESTLE INDIA LTD	16, 463	22, 536. 85	371, 024, 161. 55
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	252, 504	840. 85	212, 317, 988. 40
UNITED SPIRITS LTD	139, 825	906. 60	126, 765, 345. 00
VARUN BEVERAGES LTD	201, 988	766. 10	154, 743, 006. 80
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	64, 086	1, 631. 40	104, 549, 900. 40
DABUR INDIA LTD	287, 435	563. 35	161, 926, 507. 25
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	198, 874	1, 035. 95	206, 023, 520. 30
HINDUSTAN UNILEVER LTD	385, 898	2, 641. 60	1, 019, 388, 156. 80
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	45, 957	5, 045. 45	231, 873, 745. 65
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	338, 038	580. 55	196, 247, 960. 90
AUROBINDO PHARMA LTD	141, 068	699. 15	98, 627, 692. 20
CIPLA LTD	224, 891	989. 40	222, 507, 155. 40
DIVI'S LABORATORIES LTD	61, 659	3, 462. 95	213, 522, 034. 05
DR. REDDY'S LABORATORIES	55, 981	4, 993. 90	279, 563, 515. 90
LUPIN LTD	81, 026	858. 25	69, 540, 564. 50
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	448, 738	991. 45	444, 901, 290. 10
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	44, 978	1, 863. 05	83, 796, 262. 90
AU SMALL FINANCE BANK LTD	80, 800	736. 70	59, 525, 360. 00
AXIS BANK LTD	1, 076, 363	958. 40	1, 031, 586, 299. 20
BANDHAN BANK LTD	266, 045	235. 75	62, 720, 108. 75
BANK OF BARODA	485, 008	192. 20	93, 218, 537. 60
ICICI BANK LTD	2, 434, 270	923. 50	2, 248, 048, 345. 00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	519, 791	1, 828. 55	950, 463, 833. 05
STATE BANK OF INDIA	848, 028	554. 60	470, 316, 328. 80
YES BANK LTD	5, 386, 868	16. 00	86, 189, 888. 00
BAJAJ FINANCE LTD	130, 587	6, 989. 65	912, 757, 424. 55
BAJAJ FINSERV LTD	179, 095	1, 501. 95	268, 991, 735. 25
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	11, 900	6, 832. 30	81, 304, 370. 00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	189, 900	1, 090. 15	207, 019, 485. 00

	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	820,739	2,723.15	2,234,995,407.85
	MUTHOOT FINANCE LTD	48,400	1,221.85	59,137,540.00
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	112,700	857.10	96,595,170.00
	SHRIRAM FINANCE LTD	112,712	1,676.65	188,978,574.80
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	438,309	626.90	274,775,912.10
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	111,710	1,274.40	142,363,224.00
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	194,605	556.15	108,229,570.75
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	204,214	1,262.70	257,861,017.80
	HCL TECHNOLOGIES LTD	448,996	1,165.15	523,147,689.40
	INFOSYS LTD	1,563,524	1,265.00	1,977,857,860.00
	LTIMINDTREE LTD	42,510	4,956.65	210,707,191.50
	MPHASIS LTD	23,504	1,831.05	43,036,999.20
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	425,201	3,216.35	1,367,595,236.35
	TATA ELXSI LTD	15,900	7,481.95	118,963,005.00
	TECH MAHINDRA LTD	277,665	1,115.50	309,735,307.50
	WIPRO LTD	623,940	379.95	237,066,003.00
	BHARTI AIRTEL LTD	1,047,531	854.80	895,429,498.80
	ADANI GREEN ENERGY LTD	155,588	959.85	149,341,141.80
	ADANI POWER LTD	389,536	242.40	94,423,526.40
	GAIL INDIA LTD	1,070,325	105.05	112,437,641.25
	INDRAPRASTHA GAS LTD	135,251	476.50	64,447,101.50
	NTPC LTD	2,162,012	186.70	403,647,640.40
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,684,072	250.10	421,186,407.20
	TATA POWER CO LTD	654,389	218.30	142,853,118.70
	DLF LTD	281,804	477.70	134,617,770.80
	GODREJ PROPERTIES LTD	68,467	1,499.45	102,662,843.15
	インドルピー 小計	50,087,339		36,869,254,959.95 (64,889,888,729)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	39,958	658.50	26,312,343.00
	MONETA MONEY BANK AS	145,308	79.60	11,566,516.80
	CEZ AS	75,016	1,042.00	78,166,672.00
	チェココルナ 小計	260,282		116,045,531.80 (767,165,406)
クウェートディ ナール	AGILITY	682,614	0.62	423,220.68
	BOUBYAN BANK K. S. C	609,347	0.63	386,935.34
	GULF BANK	857,742	0.26	223,870.66

	KUWAIT FINANCE HOUSE	3,800,753	0.74	2,816,357.97	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	3,563,410	0.93	3,331,788.35	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	1,118,010	0.51	575,775.15	
	MABANEE CO KPSC	310,839	0.83	259,861.40	
	クウェートディナール 小計	10,942,715		8,017,809.55 (3,749,929,526)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	114,754	31,040.00	3,561,964,160.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	190,643	27,760.00	5,292,249,680.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	241,634	16,980.00	4,102,945,320.00	
	コロンビアペソ 小計	547,031		12,957,159,160.00 (444,495,344)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	189,718	3,018.00	572,568,924.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	65,222	8,455.00	551,452,010.00	
	OTP BANK PLC	110,447	12,025.00	1,328,125,175.00	
	ハンガリーフォリント 小計	365,387		2,452,146,109.00 (1,036,124,912)	
アラブディルハ ム	MULTIPLY GROUP	1,740,622	3.19	5,552,584.18	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	1,481,824	4.22	6,253,297.28	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	1,612,154	3.95	6,368,008.30	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,494,273	8.14	12,163,382.22	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	703,542	10.70	7,527,899.40	
	DUBAI ISLAMIC BANK	1,697,364	5.47	9,284,581.08	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,214,426	13.70	30,337,636.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,680,384	22.34	37,539,778.56	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	2,025,585	5.13	10,391,251.05	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	3,338,201	6.59	21,998,744.59	
	アラブディルハム 小計	17,988,375		147,417,162.86 (5,769,907,754)	
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	285,959	65.67	18,778,927.53	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	66,455	112.45	7,472,864.75	
	LPP SA	557	13,480.00	7,508,360.00	
	CD PROJEKT SA	39,305	152.00	5,974,360.00	
	CYFROWY POLSAT SA	150,511	16.35	2,461,607.40	
	ALLEGRO. EU SA	179,956	32.00	5,758,592.00	
	PEPCO GROUP NV	65,200	36.58	2,385,016.00	
	DINO POLSKA SA	22,170	462.80	10,260,276.00	

	BANK PEKAO SA	84,233	108.30	9,122,433.90	
	MBANK SA	5,779	385.80	2,229,538.20	
	PKO BANK POLSKI SA	400,856	35.26	14,134,182.56	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	17,302	372.80	6,450,185.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	272,464	40.14	10,936,704.96	
	PGE SA	422,950	7.17	3,035,089.20	
	ポーランドズロチ 小計	2,013,697		106,508,138.10 (3,753,027,262)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	127,751	162.40	20,746,762.40	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	64,622	199.45	12,888,857.90	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	33,259	885.73	29,458,494.07	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	197,417	425.66	84,032,520.22	
	GOLD FIELDS LTD	418,992	268.94	112,683,708.48	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	252,635	80.64	20,372,486.40	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	406,885	129.75	52,793,328.75	
	KUMBA IRON ORE LTD	35,041	464.63	16,281,099.83	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	166,313	131.86	21,930,032.18	
	SASOL LTD	258,360	231.34	59,769,002.40	
	SIBANYE STILLWATER LTD	1,293,222	29.68	38,382,828.96	
	BIDVEST GROUP LTD	133,425	261.63	34,907,982.75	
	MULTICHOICE GROUP LTD	210,702	92.75	19,542,610.50	
	MR PRICE GROUP LTD	135,650	138.30	18,760,395.00	
	NASPERS LTD-N SHS	92,468	2,994.19	276,866,760.92	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	881,388	15.59	13,740,838.92	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	131,787	88.64	11,681,599.68	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	480,830	70.37	33,836,007.10	
	BID CORP LTD	152,607	415.51	63,409,734.57	
	CLICKS GROUP LTD	114,421	263.27	30,123,616.67	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	224,766	225.60	50,707,209.60	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	177,683	183.51	32,606,607.33	
	ABSA GROUP LTD	413,811	161.37	66,776,681.07	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	39,861	1,505.96	60,029,071.56	
NEDBANK GROUP LTD	221,373	224.19	49,629,612.87		
STANDARD BANK GROUP LTD	637,653	173.28	110,492,511.84		
FIRSTRAND LTD	2,330,165	66.53	155,025,877.45		
REINET INVESTMENTS SCA	64,885	409.96	26,600,254.60		



	REMGRO LTD	232,196	142.71	33,136,691.16	
	DISCOVERY LTD	249,149	147.10	36,649,817.90	
	OLD MUTUAL LTD	2,345,236	11.85	27,791,046.60	
	OUTSURANCE GROUP LTD	394,727	33.43	13,195,723.61	
	SANLAM LTD	846,932	57.88	49,020,424.16	
	MTN GROUP LTD	808,373	135.98	109,922,560.54	
	VODACOM GROUP LTD	310,847	115.87	36,017,841.89	
	NEPI ROCKCASTLE N. V.	207,413	109.60	22,732,464.80	
	南アフリカランド 小計	15,092,845		1,852,543,064.68 (14,171,954,444)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	176,500	5.76	1,016,640.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	724,325	6.21	4,498,058.25	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	155,628	29.81	4,639,270.68	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	124,900	12.63	1,577,487.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	235,000	7.28	1,710,800.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	5.69	238,980.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	932,100	7.52	7,009,392.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	289,500	17.67	5,115,465.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	222,000	7.59	1,684,980.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	142,970	8.95	1,279,581.50	
	SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	100,900	16.09	1,623,481.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	100,055	28.27	2,828,554.85	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	24.67	224,497.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	350,000	5.45	1,907,500.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	79,700	24.01	1,913,597.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	681,496	5.53	3,768,672.88	
	BBMG CORPORATION-A	79,100	2.17	171,647.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,540	34.63	711,300.20	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	27,200	31.70	862,240.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	110,447	14.46	1,597,063.62	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	123,100	23.56	2,900,236.00	
	CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	32,500	29.61	962,325.00	
	CMOC GROUP LTD-A	515,101	5.34	2,750,639.34	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	9,100	58.60	533,260.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	102,531	62.16	6,373,326.96	
	GEM CO LTD-A	131,700	6.85	902,145.00	

GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	84,280	40.60	3,421,768.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	257,100	14.26	3,666,246.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	35,148	6.65	233,734.20
HESTEEL CO LTD-A	100,800	2.23	224,784.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	27,200	69.60	1,893,120.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	106,636	6.69	713,394.84
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	12,900	12.12	156,348.00
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	38,600	21.50	829,900.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	185,200	4.96	918,592.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	951,300	1.79	1,702,827.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	482,916	4.17	2,013,759.72
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	479,486	11.30	5,418,191.80
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	23,200	83.90	1,946,480.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	99,100	18.64	1,847,224.00
LB GROUP CO LTD-A	59,600	16.36	975,056.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	41,100	14.56	598,416.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	319,800	12.75	4,077,450.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	81,700	3.83	312,911.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	211,600	18.88	3,995,008.00
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	325,971	11.41	3,719,329.11
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	84,740	14.56	1,233,814.40
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	90,424	23.35	2,111,400.40
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	49,850	29.96	1,493,506.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	336,100	2.99	1,004,939.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	24,600	10.37	255,102.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	34,916	33.90	1,183,652.40
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	145,500	6.70	974,850.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	145,000	3.89	564,050.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	20,880	50.83	1,061,330.40
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	19,040	97.23	1,851,259.20
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	17,980	16.59	298,288.20
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	111,400	18.05	2,010,770.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	47,100	20.11	947,181.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	58,100	3.03	176,043.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	13,524	66.95	905,431.80
TIANQI LITHIUM CORP-A	59,200	72.19	4,273,648.00

TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	100,000	6.17	617,000.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	60,900	12.81	780,129.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	510,800	2.84	1,450,672.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	87,500	89.74	7,852,250.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	7,840	28.63	224,459.20
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,600	74.09	1,229,894.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	18.82	252,188.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	26,460	11.60	306,936.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	14,560	63.45	923,832.00
YOUNGY CO LTD-A	10,000	67.83	678,300.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	34,651	90.33	3,130,024.83
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	40,000	16.68	667,200.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	34,400	22.81	784,664.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	55,015	46.18	2,540,592.70
ZHEJIANG JUHUA CO-A	107,700	13.29	1,431,333.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	822,400	11.57	9,515,168.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	78,931	23.65	1,866,718.15
AECC AVIATION POWER CO-A	79,200	40.52	3,209,184.00
AVICOPTER PLC-A	37,400	39.03	1,459,722.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	14,200	49.04	696,368.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	66,800	23.97	1,601,196.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	25,019	38.00	950,722.00
CHINA BAOAN GROUP-A	49,260	12.10	596,046.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	73,000	32.28	2,356,440.00
CHINA ENERGY ENGINEERING C-A	1,252,100	2.32	2,904,872.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	98,000	8.04	787,920.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	870,900	7.39	6,435,951.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	1,305,480	5.87	7,663,167.60
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	124,754	224.91	28,058,422.14
CRRC CORP LTD-A	1,139,000	6.34	7,221,260.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	144,760	18.04	2,611,470.40
EVE ENERGY CO LTD-A	67,288	58.99	3,969,319.12
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	36,143	6.14	221,918.02
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	73,700	8.30	611,710.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	9,750	101.90	993,525.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	35,700	27.32	975,324.00

GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	7,800	63.55	495,690.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	9,940	31.55	313,607.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	9,240	72.13	666,481.20
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	26,032	65.80	1,712,905.60
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	103,700	15.80	1,638,460.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	47,400	14.96	709,104.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	527,534	3.88	2,046,831.92
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	47,900	16.87	808,073.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	272,409	22.79	6,208,201.11
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	7,200	145.40	1,046,880.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	24,000	47.86	1,148,640.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	8,300	50.65	420,395.00
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	49,900	17.59	877,741.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	512,700	5.71	2,927,517.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,400	199.88	679,592.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	340,616	16.58	5,647,413.28
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	2.61	220,545.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	407,700	4.54	1,850,958.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	91,551	63.27	5,792,431.77
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	185,640	9.55	1,772,862.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	12,000	45.15	541,800.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	38,400	113.15	4,344,960.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,600	15.80	594,080.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	5,632	145.08	817,090.56
TBEA CO LTD-A	167,000	22.20	3,707,400.00
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	12,000	15.90	190,800.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	413,651	12.17	5,034,132.67
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	363,600	6.49	2,359,764.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	10.81	290,789.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	129,800	10.70	1,388,860.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	36,000	27.00	972,000.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	53.02	244,952.40
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	15,000	20.45	306,750.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,500	8.52	771,060.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	143,900	6.62	952,618.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8,800	45.77	402,776.00

ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	58,110	17.23	1,001,235.30
AIR CHINA LTD-A	287,800	8.43	2,426,154.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	1,000,000	5.26	5,260,000.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	547,400	4.74	2,594,676.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	444,100	6.14	2,726,774.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	469,130	10.66	5,000,925.80
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	361,700	7.36	2,662,112.00
LIAONING PORT CO LTD-A	2,697,000	1.57	4,234,290.00
S F HOLDING CO LTD-A	142,200	47.77	6,792,894.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	38,100	47.29	1,801,749.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	139,900	5.17	723,283.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	75,200	14.43	1,085,136.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	78,060	9.58	747,814.80
BYD CO LTD -A	48,000	267.78	12,853,440.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,600	116.31	302,406.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	274,190	12.42	3,405,439.80
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	46,838	34.38	1,610,290.44
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	164,354	25.08	4,121,998.32
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	348,900	10.37	3,618,093.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	68,200	18.31	1,248,742.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	12,000	158.88	1,906,560.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	17.52	216,547.20
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	51,300	78.69	4,036,797.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	159,244	14.09	2,243,747.96
SAILUN GROUP CO LTD-A	107,100	10.95	1,172,745.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	11,400	22.07	251,598.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	8,700	125.61	1,092,807.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	11,400	75.00	855,000.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	77,853	36.16	2,815,164.48
HAIER SMART HOME CO LTD-A	208,929	23.42	4,893,117.18
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	24.96	224,640.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	16,120	37.47	604,016.40
OPPEIN HOME GROUP INC-A	12,917	89.32	1,153,746.44
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	1,508,300	3.81	5,746,623.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	49.30	256,360.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	27,000	47.14	1,272,780.00

SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	268,100	4.42	1,185,002.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	12.55	311,779.65
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	75,300	33.25	2,503,725.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	8.73	243,567.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	280,502	7.10	1,991,564.20
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	700	522.69	365,883.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	80,780	37.49	3,028,442.20
PERFECT WORLD CO LTD-A	18,300	18.66	341,478.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	126,520	7.75	980,530.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	60,699	122.15	7,414,382.85
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	6.83	210,364.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.84	233,288.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	19,704	27.98	551,317.92
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	9,172	37.71	345,876.12
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	36.78	286,884.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	10,200	257.58	2,627,316.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5,625	53.00	298,125.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	21,800	61.88	1,348,984.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	5,900	157.72	930,548.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	6.56	264,368.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	234,000	12.65	2,960,100.00
CHONGQING BREWERY CO-A	16,080	96.25	1,547,700.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	9,750	18.27	178,132.50
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	143,133	49.65	7,106,553.45
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	18.76	183,848.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	49,519	48.42	2,397,709.98
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	118,600	13.26	1,572,636.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	87,500	24.48	2,142,000.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	161,700	28.80	4,656,960.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	32,590	57.15	1,862,518.50
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	44,981	137.51	6,185,337.31
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	3,600	93.83	337,788.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	38.17	290,092.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	5,500	39.42	216,810.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	35,253	1,735.83	61,193,214.99
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	37,800	219.90	8,312,220.00

MUYUAN FOODS CO LTD-A	190,980	42.15	8,049,807.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	209,700	11.71	2,455,587.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	24,705	36.99	913,837.95
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	34,060	203.60	6,934,616.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	12,600	62.24	784,224.00
TOLY BREAD CO LTD-A	12,230	10.27	125,602.10
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	40,761	102.69	4,185,747.09
WENS FOODSTUFFS GROUP CO L-A	261,140	17.33	4,525,556.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	107,100	171.40	18,356,940.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	23,700	40.23	953,451.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	12,500	15.19	189,875.00
BY-HEALTH CO LTD-A	15,000	24.01	360,150.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	9,700	91.59	888,423.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	276,792	19.57	5,416,819.44
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	128,900	31.44	4,052,616.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	73.70	324,280.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	57,140	42.19	2,410,736.60
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	7,600	24.12	183,312.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	64,300	34.72	2,232,496.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	17,800	14.90	265,220.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	95,160	23.01	2,189,631.60
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	6.74	239,674.40
OVCTEK CHINA INC-A	17,260	29.60	510,896.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	183,900	20.69	3,804,891.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	38,300	299.10	11,455,530.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	10,000	61.93	619,300.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	7,000	97.82	684,740.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	15,000	17.65	264,750.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	19,040	125.40	2,387,616.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	29,900	54.27	1,622,673.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	13,804	66.60	919,346.40
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3,800	47.80	181,640.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	17,000	59.73	1,015,410.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	8,700	138.15	1,201,905.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	36,000	61.51	2,214,360.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	90,296	44.48	4,016,366.08

DAAN GENE CO LTD-A	19,360	9.95	192,632.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	6,200	47.20	292,640.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	66.19	469,220.91
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	54,190	21.91	1,187,302.90
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	29,900	25.13	751,387.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	8,100	441.40	3,575,340.00
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A	234,143	46.40	10,864,235.20
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	12.69	233,496.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	14,840	41.79	620,163.60
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	38.77	224,866.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	12,522	12.28	153,770.16
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	18,750	39.65	743,437.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	10,780	20.18	217,540.40
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	48,600	30.66	1,490,076.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	24,600	38.16	938,736.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	240,500	7.57	1,820,585.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	15,425	24.95	384,853.75
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	8,200	30.94	253,708.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	76,100	25.64	1,951,204.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	13,600	28.98	394,128.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	32,480	25.97	843,505.60
WUXI APPTec CO LTD-A	116,211	63.30	7,356,156.30
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	80,260	52.35	4,201,611.00
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	19,300	288.78	5,573,454.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	13,860	18.00	249,480.00
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	25,700	27.92	717,544.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	85,176	15.15	1,290,416.40
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	5,000	33.00	165,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	2,234,800	3.53	7,888,844.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	751,100	4.60	3,455,060.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	137,793	12.25	1,687,964.25
BANK OF CHINA LTD-A	772,400	3.88	2,996,912.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	1,544,733	5.74	8,866,767.42
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	151,000	11.83	1,786,330.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	576,750	7.28	4,198,740.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	321,500	7.98	2,565,570.00



BANK OF NINGBO CO LTD -A	236,111	25.44	6,006,663.84
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	543,311	6.09	3,308,763.99
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	783,100	6.22	4,870,882.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	956,010	3.04	2,906,270.40
CHINA MERCHANTS BANK-A	565,699	33.17	18,764,235.83
CHINA MINSHENG BANKING-A	746,028	3.92	2,924,429.76
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	241,200	2.74	660,888.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	56,500	3.84	216,960.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	198,750	5.38	1,069,275.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	1,647,428	4.85	7,990,025.80
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	582,874	15.77	9,191,922.98
PING AN BANK CO LTD-A	679,061	11.35	7,707,342.35
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	874,400	4.99	4,363,256.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	884,337	7.27	6,429,129.99
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	749,400	5.79	4,339,026.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	461,900	3.88	1,792,172.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	452,855	7.23	3,274,141.65
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	644,434	5.85	3,769,938.90
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	70,200	11.68	819,936.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	8.23	477,340.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A	32,692	36.89	1,206,007.88
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	159,900	13.60	2,174,640.00
CITIC SECURITIES CO-A	397,445	19.85	7,889,283.25
CSC FINANCIAL CO LTD-A	192,700	23.65	4,557,355.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	8.00	209,600.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	522,334	14.30	7,469,376.20
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,600	16.08	1,633,728.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	97,100	5.68	551,528.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	299,965	6.58	1,973,769.70
GF SECURITIES CO LTD-A	281,900	14.71	4,146,749.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	110,261	6.43	708,978.23
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	51,600	9.00	464,400.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	419,100	8.71	3,650,361.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	173,625	14.61	2,536,661.25
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	6.53	208,307.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	242,979	9.22	2,240,266.38

HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	13,530	198.00	2,678,940.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	424,440	13.77	5,844,538.80
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	24,900	8.16	203,184.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	180,700	6.10	1,102,270.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	139,500	9.78	1,364,310.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	26,900	5.63	151,447.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	1,048,114	4.54	4,758,437.56
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	664,300	7.05	4,683,315.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	3.64	195,468.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	247,600	6.36	1,574,736.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	74,000	9.86	729,640.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	132,200	6.82	901,604.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	85,400	35.45	3,027,430.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	212,000	26.62	5,643,440.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	135,086	36.22	4,892,814.92
PICC HOLDING CO-A	1,251,900	5.77	7,223,463.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	290,422	46.64	13,545,282.08
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	319,600	14.65	4,682,140.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	17,500	497.50	8,706,250.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	21,403	16.00	342,448.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	281,500	7.74	2,178,810.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	50,398	49.40	2,489,661.20
IFLYTEK CO LTD - A	82,885	77.60	6,431,876.00
NAVINFO CO LTD-A	411,400	11.84	4,870,976.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	8,500	121.19	1,030,115.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	42,276	53.30	2,253,310.80
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	12,400	106.70	1,323,080.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	87,015	22.52	1,959,577.80
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	36,700	24.29	891,443.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,709,200	3.98	6,802,616.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	26,600	29.89	795,074.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	48,197	30.23	1,456,995.31
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	164,000	14.10	2,312,400.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	296,998	5.68	1,686,948.64
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	13,700	90.74	1,243,138.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	222,100	24.50	5,441,450.00

GOERTEK INC -A	71,400	17.94	1,280,916.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	166,500	12.56	2,091,240.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	21,800	10.09	219,962.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	8,400	73.32	615,888.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	54,900	61.48	3,375,252.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	109,400	11.72	1,282,168.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	217,700	6.66	1,449,882.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	210,512	30.40	6,399,564.80
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	10,752	96.90	1,041,868.80
NINESTAR CORP-A	39,700	35.15	1,395,455.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	21,600	14.59	315,144.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	27,780	77.53	2,153,783.40
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	31,000	148.26	4,596,060.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	72,200	26.58	1,919,076.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	9,000	28.11	252,990.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	111,100	9.18	1,019,898.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	110,648	36.77	4,068,526.96
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	25,000	50.80	1,270,000.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	157,032	7.66	1,202,865.12
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	18,040	21.59	389,483.60
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	6,300	139.24	877,212.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	31,430	35.48	1,115,136.40
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	75,700	22.10	1,672,970.00
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A	35,500	92.53	3,284,815.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	30,100	159.90	4,812,990.00
ZTE CORP-A	222,900	42.82	9,544,578.00
CHINA UNITED NETWORK-A	1,185,800	4.83	5,727,414.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	240,000	6.78	1,627,200.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	661,300	5.28	3,491,664.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	608,240	22.10	13,442,104.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	73,600	18.65	1,372,640.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	570,400	3.82	2,178,928.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	367,600	6.44	2,367,344.00
HUANENG POWER INTL INC-A	324,300	8.84	2,866,812.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	722,160	6.45	4,657,932.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	180,400	14.85	2,678,940.00

	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	20,700	158.00	3,270,600.00	
	CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	10,000	230.98	2,309,800.00	
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	105,400	51.33	5,410,182.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	101,300	36.90	3,737,970.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A	13,556	107.80	1,461,336.80	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	62,322	32.78	2,042,915.16	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	33,200	30.35	1,007,620.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	10,100	86.82	876,882.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	144,480	40.27	5,818,209.60	
	JCET GROUP CO LTD-A	47,200	33.55	1,583,560.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	207,189	27.99	5,799,220.11	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	18,400	58.08	1,068,672.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	20,900	294.90	6,163,410.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	120,000	16.92	2,030,400.00	
	SG MICRO CORP-A	7,897	85.39	674,324.83	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	8,600	103.00	885,800.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,500	212.29	743,015.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	164,500	32.20	5,296,900.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	201,300	9.33	1,878,129.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	23.39	680,649.00	
	TONGWEI CO LTD-A	157,700	34.26	5,402,802.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	56,200	42.25	2,374,450.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	36,299	89.88	3,262,554.12	
	WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A	55,915	100.48	5,618,339.20	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	29,700	66.42	1,972,674.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	242,622	12.89	3,127,397.58	
	CHINA VANKE CO LTD -A	194,956	13.94	2,717,686.64	
	GEMDALE CORP-A	42,900	7.29	312,741.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	357,000	13.12	4,683,840.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	58,700	13.81	810,647.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	160,740	12.18	1,957,813.20	
	YOUNGOR GROUP CO-A	106,400	6.32	672,448.00	
	オフショア元 小計	77,143,039		1,114,032,390.27 (22,161,557,742)	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	202,319	11.50	2,326,668.50	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	1,263,225	32.25	40,739,006.25	

ADVANCED PETROCHEMICALS CO	57,072	44.10	2,516,875.20
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	198,764	14.92	2,965,558.88
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	117,465	129.60	15,223,464.00
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	167,519	36.85	6,173,075.15
SAUDI ARABIAN MINING CO	609,778	42.20	25,732,631.60
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	17,048	137.00	2,335,576.00
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	423,329	88.20	37,337,617.80
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	194,677	26.50	5,158,940.50
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	362,675	13.82	5,012,168.50
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	128,166	47.45	6,081,476.70
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	15,573	188.80	2,940,182.40
JARIR MARKETING CO	303,520	16.54	5,020,220.80
NAHDI MEDICAL CO	18,802	170.00	3,196,340.00
ALMARAI CO	121,295	60.70	7,362,606.50
SAVOLA	136,987	41.65	5,705,508.55
DALLAH HEALTHCARE CO	17,729	167.80	2,974,926.20
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	42,281	286.20	12,100,822.20
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	23,544	242.00	5,697,648.00
AL RAJHI BANK	911,644	73.00	66,550,012.00
ALINMA BANK	452,830	33.50	15,169,805.00
ARAB NATIONAL BANK	280,049	26.35	7,379,291.15
BANK AL-JAZIRA	183,665	18.28	3,357,396.20
BANK ALBILAD	226,137	38.70	8,751,501.90
BANQUE SAUDI FRANSI	278,276	41.70	11,604,109.20
RIYAD BANK	718,937	33.65	24,192,230.05
SAUDI AWWAL BANK	508,613	38.15	19,403,585.95
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	268,331	17.06	4,577,726.86
THE SAUDI NATIONAL BANK	1,373,109	36.80	50,530,411.20
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	22,457	188.20	4,226,407.40
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	34,678	185.60	6,436,236.80
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	10,771	322.60	3,474,724.60
ELM CO	10,228	582.00	5,952,696.00
ETIHAD ETISALAT CO	171,916	47.90	8,234,776.40
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	228,789	14.16	3,239,652.24
SAUDI TELECOM CO	951,224	43.50	41,378,244.00
ACWA POWER CO	36,473	166.80	6,083,696.40

	SAUDI ELECTRICITY CO	375,918	22.54	8,473,191.72	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	248,669	15.34	3,814,582.46	
	EMAAR ECONOMIC CITY	162,006	9.36	1,516,376.16	
	サウジアラビアリアル 小計	11,876,488		500,947,967.42 (19,196,326,111)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	492,204	76.75	37,776,657.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	631,874	36.08	22,798,013.92	
	HEKTAS TICARET T. A. S	473,600	29.90	14,160,640.00	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	491,871	23.38	11,499,943.98	
	SASA POLYESTER SANAYI	434,699	55.40	24,082,324.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	318,713	52.90	16,859,917.70	
	KOC HOLDING AS	398,602	103.60	41,295,167.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	688,169	43.94	30,238,145.86	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	23,874	603.40	14,405,571.60	
	TURK HAVA YOLLARI AO	257,239	184.70	47,512,043.30	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	32,070	753.50	24,164,745.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	94,500	231.60	21,886,200.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	206,059	168.00	34,617,912.00	
	AKBANK T. A. S.	1,330,071	19.79	26,322,105.09	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	478,800	46.50	22,264,200.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,541,777	13.65	21,045,256.05	
	YAPI VE KREDI BANKASI	1,348,324	12.84	17,312,480.16	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	650,401	35.50	23,089,235.50	
	トルコリラ 小計	9,892,847		451,330,558.96 (2,565,227,497)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	27,212	25.10	683,021.20	
	MYTILINEOS S. A.	59,964	32.96	1,976,413.44	
	FF GROUP	5,889	4.80	28,267.20	
	OPAP SA	88,680	15.85	1,405,578.00	
	JUMBO SA	66,836	24.00	1,604,064.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	974,172	1.52	1,485,612.30	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	1,204,906	1.49	1,795,309.94	
	NATIONAL BANK OF GREECE	201,393	5.64	1,136,662.09	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	95,037	15.01	1,426,505.37	
	PUBLIC POWER CORP	111,882	10.04	1,123,295.28	
	TERNA ENERGY SA	32,000	20.78	664,960.00	

	ユーロ 小計	2,867,971		13,329,688.82 (2,085,829,706)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	288,993	16.42	4,745,265.06
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	1,224,895	4.15	5,084,539.14
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	2,142,532	1.88	4,027,960.16
	INDUSTRIES QATAR	664,301	10.80	7,174,450.80
	COMMERCIAL BANK PSQC	1,541,602	5.80	8,941,291.60
	DUKHAN BANK	1,104,320	3.84	4,242,797.44
	MASRAF AL RAYAN	2,863,141	2.48	7,100,589.68
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	429,709	9.50	4,082,235.50
	QATAR ISLAMIC BANK	768,060	17.17	13,187,590.20
	QATAR NATIONAL BANK	2,160,598	15.10	32,625,029.80
	OOREDOO QPSC	397,674	10.79	4,290,902.46
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	266,231	17.00	4,525,927.00
	BARWA REAL ESTATE CO	892,615	2.51	2,240,463.65
	カタールリアル 小計	14,744,671		102,269,042.49 (4,032,468,345)
	合 計	2,942,391,840		453,069,968,300 (453,069,968,300)

(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
香港ドル	投資証券	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	47,616	77,614.08	
香港ドル合計			47,616	77,614.08 (1,421,889)	
メキシコ ペソ	投資証券	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	648,200	10,500,840.00	
		TRUST FIBRA UNO	1,521,600	36,777,072.00	
メキシコペソ合計			2,169,800	47,277,912.00 (396,061,252)	
南アフリ カランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	1,670,736	19,380,537.60	
南アフリカランド合計			1,670,736	19,380,537.60 (148,261,112)	
合 計				545,744,253	

(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 52 銘柄	100.00%	—	2.35%
香港ドル	株式 195 銘柄	100.00%	—	22.58%
	投資証券 1 銘柄	—	0.00%	0.00%
マレーシアリングット	株式 33 銘柄	100.00%	—	1.35%
タイバーツ	株式 42 銘柄	100.00%	—	1.92%
フィリピンペソ	株式 15 銘柄	100.00%	—	0.63%
インドネシアルピア	株式 22 銘柄	100.00%	—	1.99%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	96.88%	—	2.71%
	投資証券 2 銘柄	—	3.12%	0.09%
ブラジルリアル	株式 47 銘柄	100.00%	—	5.57%
チリペソ	株式 12 銘柄	100.00%	—	0.53%
韓国ウォン	株式 102 銘柄	100.00%	—	12.40%
ニュー台湾ドル	株式 90 銘柄	100.00%	—	15.96%
インドルピー	株式 114 銘柄	100.00%	—	14.31%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.17%
クウェートディナール	株式 7 銘柄	100.00%	—	0.83%
コロンビアペソ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.10%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.23%
アラブディルハム	株式 10 銘柄	100.00%	—	1.27%
ポーランドズロチ	株式 14 銘柄	100.00%	—	0.83%
南アフリカランド	株式 36 銘柄	98.96%	—	3.12%
	投資証券 1 銘柄	—	1.04%	0.03%
オフショア元	株式 418 銘柄	100.00%	—	4.89%
サウジアラビアリヤル	株式 41 銘柄	100.00%	—	4.23%
トルコリラ	株式 18 銘柄	100.00%	—	0.57%
ユーロ	株式 11 銘柄	100.00%	—	0.46%
カタールリアル	株式 13 銘柄	100.00%	—	0.89%

#### 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。



## 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	2,507,995,130
国債証券	619,617,446,470
地方債証券	40,666,562,742
特殊債券	34,857,299,165
社債券	43,011,888,000
派生商品評価勘定	4,845,325
未収利息	870,866,582
前払費用	45,732,467
差入委託証拠金	8,850,000
流動資産合計	741,591,485,881
資産合計	741,591,485,881
負債の部	
流動負債	
前受金	3,700,000
未払金	1,765,518,800
未払解約金	208,903,194
未払利息	6,303
流動負債合計	1,978,128,297
負債合計	1,978,128,297
純資産の部	
元本等	
元本	562,256,036,879
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	177,357,320,705
元本等合計	739,613,357,584
純資産合計	739,613,357,584
負債純資産合計	741,591,485,881

## 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	511,024,896,050円
期中追加設定元本額	141,851,069,112円
期中一部解約元本額	90,619,928,283円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	6,961,819,518円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	9,504,205,518円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	2,372,971,590円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	53,706,546,103円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	92,853,010,949円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	27,758,451,615円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	199,998,520円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	180,874,985円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,007,730,180円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,897,930,073円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,936,107,254円
eMAXIS バランス(波乗り型)	83,553,818円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	14,642,864,485円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	40,608,009,856円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	9,490,638,526円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	3,959,573,823円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	1,776,831,049円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	14,725,647,289円
国内債券セレクション(ラップ向け)	9,059,962,138円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	17,668,594,541円
つみたて8資産均等バランス	8,455,959,882円
つみたて4資産均等バランス	3,100,635,764円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	14,954,333円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	11,006,751円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	287,350円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	4,872,677,815円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	2,100,990,757円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	801,544,345円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	5,148,983,729円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	5,314,703,970円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	2,937,008,831円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	570,994,800円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	1,083,115,966円
国内債券インデックスファンド(ラップ向け)	2,878,523,760円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065(確定拠出年金)	239,937,654円
ラップ向けインデックスf 国内債券	5,519,142,135円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	1,990,175,896円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	1,734,315,629円
三菱UFJ DC年金バランス(株式80)	2,923,794円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	129,703,024円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	177,956,270円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	75,129,070円

eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,283,841,179 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,704,910,495 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	959,414,804 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	1,870,073,990 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	93,971,847 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	37,848,737 円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	6,437,998,231 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)	132,864 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	25,398,582 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	8,976,565,396 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	706,167,831 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,490,482,984 円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	117,643,284,047 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	450,347,558 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,444,939 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	282,140 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,295,046,167 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,540,915,358 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	3,407,444,038 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	441,693,456 円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	12,983,592,522 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)	2,489,299,081 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,813,134 円
日本債券インデックスファンドS	2,297,936,236 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	429,832,474 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	424,280,144 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	424,729,389 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	421,626,267 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	419,477,595 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	420,955,442 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	413,671,752 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	416,234,104 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	418,690,273 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	416,840,490 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	462,440,331 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	469,323,041 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	477,586,919 円

MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	478,244,702 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	476,937,873 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	490,248,647 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	476,919,903 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	477,769,455 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	17,674,744 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	23,498,173 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	4,093,541 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	8,701,045 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	17,039,031 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	52,893,959 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	10,081,147 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	42,299,987 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,221,148,741 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,136,549,700 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,445,549,551 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,716,684,836 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)	1,847,114,652 円
合計	562,256,036,879 円
2. 受益権の総数	562,256,036,879 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。
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	3,031,415,870
地方債証券	90,998,432
特殊債券	152,372,527
社債券	104,918,000
合計	3,379,704,829

(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	740,200,000	—	745,050,000	4,850,000
合計		740,200,000	—	745,050,000	4,850,000

(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	1.3154円
(1万口当たり純資産額)	(13,154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)	2,100,000,000	2,103,402,000	
	第439回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,602,720,000	
	第440回利付国債(2年)	900,000,000	901,593,000	
	第441回利付国債(2年)	3,700,000,000	3,706,771,000	
	第442回利付国債(2年)	1,770,000,000	1,773,451,500	
	第443回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,302,418,000	
	第444回利付国債(2年)	1,650,000,000	1,653,003,000	
	第445回利付国債(2年)	3,590,000,000	3,596,318,400	
	第446回利付国債(2年)	2,200,000,000	2,203,872,000	
	第447回利付国債(2年)	1,020,000,000	1,021,795,200	
	第448回利付国債(2年)	3,550,000,000	3,556,851,500	
	第141回利付国債(5年)	5,240,000,000	5,255,196,000	
	第142回利付国債(5年)	310,000,000	310,988,900	
	第143回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,398,614,800	
	第144回利付国債(5年)	6,380,000,000	6,404,626,800	
	第145回利付国債(5年)	6,410,000,000	6,437,947,600	
	第146回利付国債(5年)	4,470,000,000	4,491,098,400	
	第147回利付国債(5年)	1,680,000,000	1,683,897,600	
	第148回利付国債(5年)	3,300,000,000	3,307,392,000	
	第149回利付国債(5年)	6,630,000,000	6,643,923,000	
	第150回利付国債(5年)	1,480,000,000	1,482,826,800	
	第151回利付国債(5年)	750,000,000	751,260,000	
	第152回利付国債(5年)	3,930,000,000	3,950,514,600	
	第153回利付国債(5年)	6,040,000,000	6,047,187,600	
	第154回利付国債(5年)	5,730,000,000	5,755,441,200	
	第155回利付国債(5年)	1,950,000,000	1,974,882,000	
	第156回利付国債(5年)	4,950,000,000	4,989,897,000	
	第157回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,712,835,000	

第158回利付国債（5年）	9,200,000,000	9,223,828,000	
第1回利付国債（40年）	855,000,000	1,096,665,750	
第2回利付国債（40年）	1,335,000,000	1,647,643,650	
第3回利付国債（40年）	718,000,000	886,629,480	
第4回利付国債（40年）	1,218,000,000	1,505,874,300	
第5回利付国債（40年）	775,000,000	924,234,000	
第6回利付国債（40年）	1,230,000,000	1,443,970,800	
第7回利付国債（40年）	1,540,000,000	1,730,344,000	
第8回利付国債（40年）	1,510,000,000	1,579,384,500	
第9回利付国債（40年）	2,770,000,000	2,148,273,500	
第10回利付国債（40年）	2,620,000,000	2,374,244,000	
第11回利付国債（40年）	2,100,000,000	1,835,589,000	
第12回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,595,137,200	
第13回利付国債（40年）	2,800,000,000	2,170,308,000	
第14回利付国債（40年）	2,410,000,000	1,991,045,600	
第15回利付国債（40年）	3,500,000,000	3,168,305,000	
第16回利付国債（40年）	700,000,000	691,838,000	
第335回利付国債（10年）	3,890,000,000	3,920,497,600	
第336回利付国債（10年）	2,460,000,000	2,482,459,800	
第337回利付国債（10年）	1,620,000,000	1,629,979,200	
第338回利付国債（10年）	3,330,000,000	3,358,804,500	
第339回利付国債（10年）	4,020,000,000	4,059,476,400	
第340回利付国債（10年）	3,470,000,000	3,508,412,900	
第341回利付国債（10年）	3,320,000,000	3,352,204,000	
第342回利付国債（10年）	2,570,000,000	2,582,644,400	
第343回利付国債（10年）	4,870,000,000	4,894,690,900	
第344回利付国債（10年）	4,620,000,000	4,643,931,600	
第345回利付国債（10年）	6,340,000,000	6,373,158,200	
第346回利付国債（10年）	6,130,000,000	6,161,998,600	
第347回利付国債（10年）	5,700,000,000	5,728,386,000	
第348回利付国債（10年）	4,970,000,000	4,992,066,800	
第349回利付国債（10年）	6,090,000,000	6,113,142,000	
第350回利付国債（10年）	6,530,000,000	6,548,479,900	
第351回利付国債（10年）	4,570,000,000	4,581,333,600	
第352回利付国債（10年）	4,490,000,000	4,499,339,200	
第353回利付国債（10年）	2,580,000,000	2,584,205,400	

第354回利付国債（10年）	6,140,000,000	6,146,999,600	
第355回利付国債（10年）	5,060,000,000	5,062,985,400	
第356回利付国債（10年）	7,040,000,000	7,040,000,000	
第357回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,746,262,500	
第358回利付国債（10年）	6,790,000,000	6,778,660,700	
第359回利付国債（10年）	7,650,000,000	7,628,809,500	
第360回利付国債（10年）	6,430,000,000	6,402,351,000	
第361回利付国債（10年）	6,450,000,000	6,411,880,500	
第362回利付国債（10年）	5,890,000,000	5,842,938,900	
第363回利付国債（10年）	7,780,000,000	7,703,678,200	
第364回利付国債（10年）	7,140,000,000	7,056,390,600	
第365回利付国債（10年）	6,600,000,000	6,512,352,000	
第366回利付国債（10年）	3,500,000,000	3,477,600,000	
第367回利付国債（10年）	4,370,000,000	4,335,564,400	
第368回利付国債（10年）	6,300,000,000	6,240,591,000	
第369回利付国債（10年）	5,500,000,000	5,588,495,000	
第370回利付国債（10年）	4,090,000,000	4,147,709,900	
第1回利付国債（30年）	196,000,000	228,849,600	
第2回利付国債（30年）	268,000,000	308,526,960	
第3回利付国債（30年）	307,000,000	352,650,900	
第4回利付国債（30年）	252,000,000	302,384,880	
第5回利付国債（30年）	238,000,000	274,892,380	
第6回利付国債（30年）	339,000,000	399,453,870	
第7回利付国債（30年）	339,000,000	399,128,430	
第8回利付国債（30年）	302,000,000	343,280,380	
第9回利付国債（30年）	206,000,000	226,577,340	
第10回利付国債（30年）	398,000,000	426,484,860	
第11回利付国債（30年）	237,000,000	267,724,680	
第12回利付国債（30年）	325,000,000	380,435,250	
第13回利付国債（30年）	595,000,000	691,467,350	
第14回利付国債（30年）	683,000,000	823,520,420	
第15回利付国債（30年）	686,000,000	836,652,460	
第16回利付国債（30年）	547,000,000	668,324,600	
第17回利付国債（30年）	577,000,000	700,224,120	
第18回利付国債（30年）	687,000,000	827,670,120	
第19回利付国債（30年）	593,000,000	715,673,910	



第20回利付国債(30年)	655,000,000	807,870,450	
第21回利付国債(30年)	529,000,000	640,872,920	
第22回利付国債(30年)	975,000,000	1,206,913,500	
第23回利付国債(30年)	194,000,000	240,561,940	
第24回利付国債(30年)	981,000,000	1,219,216,230	
第25回利付国債(30年)	1,287,000,000	1,568,698,560	
第26回利付国債(30年)	1,014,000,000	1,250,262,000	
第27回利付国債(30年)	460,000,000	574,981,600	
第28回利付国債(30年)	1,426,000,000	1,787,818,980	
第29回利付国債(30年)	830,000,000	1,031,316,500	
第30回利付国債(30年)	1,721,000,000	2,114,145,240	
第31回利付国債(30年)	2,223,000,000	2,701,167,300	
第32回利付国債(30年)	1,989,000,000	2,452,695,570	
第33回利付国債(30年)	1,227,000,000	1,455,504,210	
第34回利付国債(30年)	2,231,000,000	2,718,049,610	
第35回利付国債(30年)	2,379,000,000	2,822,017,380	
第36回利付国債(30年)	1,929,000,000	2,291,111,880	
第37回利付国債(30年)	2,717,000,000	3,180,683,220	
第38回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,832,808,900	
第39回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,593,008,800	
第40回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,983,246,000	
第41回利付国債(30年)	1,210,000,000	1,372,648,200	
第42回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,724,896,000	
第43回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,680,051,600	
第44回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,850,897,600	
第45回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,622,331,600	
第46回利付国債(30年)	2,380,000,000	2,608,694,200	
第47回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,141,088,000	
第48回利付国債(30年)	1,870,000,000	2,009,707,700	
第49回利付国債(30年)	1,860,000,000	1,998,384,000	
第50回利付国債(30年)	2,090,000,000	1,990,453,300	
第51回利付国債(30年)	2,140,000,000	1,815,961,200	
第52回利付国債(30年)	2,020,000,000	1,792,406,600	
第53回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,648,628,800	
第54回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,521,965,200	
第55回利付国債(30年)	1,940,000,000	1,829,555,800	

第56回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,636,992,000	
第57回利付国債(30年)	1,900,000,000	1,783,169,000	
第58回利付国債(30年)	2,410,000,000	2,256,266,100	
第59回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,641,204,000	
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,551,808,900	
第61回利付国債(30年)	1,570,000,000	1,419,578,300	
第62回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,044,917,800	
第63回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,528,764,000	
第64回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,424,142,800	
第65回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,372,438,200	
第66回利付国債(30年)	2,390,000,000	1,965,249,200	
第67回利付国債(30年)	2,610,000,000	2,258,589,600	
第68回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,475,182,800	
第69回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,521,821,600	
第70回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,757,369,000	
第71回利付国債(30年)	1,950,000,000	1,718,749,500	
第72回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,680,246,100	
第73回利付国債(30年)	1,930,000,000	1,696,334,900	
第74回利付国債(30年)	2,720,000,000	2,584,435,200	
第75回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,912,262,000	
第76回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,168,966,700	
第77回利付国債(30年)	2,110,000,000	2,316,484,600	
第78回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,583,099,100	
第72回利付国債(20年)	1,079,000,000	1,108,780,400	
第73回利付国債(20年)	520,000,000	536,328,000	
第74回利付国債(20年)	698,000,000	720,950,240	
第75回利付国債(20年)	705,000,000	731,853,450	
第76回利付国債(20年)	410,000,000	424,198,300	
第77回利付国債(20年)	370,000,000	383,453,200	
第78回利付国債(20年)	310,000,000	322,272,900	
第79回利付国債(20年)	150,000,000	156,235,500	
第80回利付国債(20年)	585,000,000	610,482,600	
第81回利付国債(20年)	250,000,000	261,717,500	
第82回利付国債(20年)	1,082,000,000	1,135,137,020	
第83回利付国債(20年)	395,000,000	416,519,600	
第84回利付国債(20年)	880,000,000	925,751,200	

第85回利付国債（20年）	520,000,000	550,997,200	
第86回利付国債（20年）	1,047,000,000	1,115,138,760	
第87回利付国債（20年）	420,000,000	446,187,000	
第88回利付国債（20年）	1,264,000,000	1,353,478,560	
第89回利付国債（20年）	340,000,000	363,052,000	
第90回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,362,964,000	
第91回利付国債（20年）	548,000,000	589,889,120	
第92回利付国債（20年）	1,282,000,000	1,378,137,180	
第93回利付国債（20年）	190,000,000	204,474,200	
第94回利付国債（20年）	875,000,000	944,921,250	
第95回利付国債（20年）	1,107,000,000	1,209,552,480	
第96回利付国債（20年）	340,000,000	368,787,800	
第97回利付国債（20年）	573,000,000	626,489,550	
第98回利付国債（20年）	610,000,000	664,363,200	
第99回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,618,217,200	
第100回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,135,266,000	
第101回利付国債（20年）	723,000,000	803,722,950	
第102回利付国債（20年）	520,000,000	580,855,600	
第103回利付国債（20年）	760,000,000	845,165,600	
第104回利付国債（20年）	610,000,000	672,293,200	
第105回利付国債（20年）	920,000,000	1,018,164,000	
第106回利付国債（20年）	571,000,000	634,906,320	
第107回利付国債（20年）	607,000,000	674,474,120	
第108回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,100,240,000	
第109回利付国債（20年）	560,000,000	618,296,000	
第110回利付国債（20年）	876,000,000	977,186,760	
第111回利付国債（20年）	861,000,000	969,356,850	
第112回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,175,895,000	
第113回利付国債（20年）	922,000,000	1,036,540,060	
第114回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,805,504,000	
第115回利付国債（20年）	944,000,000	1,071,326,720	
第116回利付国債（20年）	461,000,000	525,175,810	
第117回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,494,952,800	
第118回利付国債（20年）	520,000,000	587,267,200	
第119回利付国債（20年）	400,000,000	446,212,000	
第120回利付国債（20年）	780,000,000	859,318,200	

第121回利付国債（20年）	1,299,000,000	1,461,647,790	
第122回利付国債（20年）	100,000,000	111,806,000	
第123回利付国債（20年）	1,318,000,000	1,505,933,620	
第124回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,407,648,000	
第125回利付国債（20年）	1,844,000,000	2,125,505,040	
第126回利付国債（20年）	200,000,000	227,486,000	
第127回利付国債（20年）	440,000,000	497,116,400	
第128回利付国債（20年）	1,974,000,000	2,235,851,100	
第129回利付国債（20年）	280,000,000	314,944,000	
第130回利付国債（20年）	1,862,000,000	2,098,194,700	
第131回利付国債（20年）	420,000,000	469,883,400	
第132回利付国債（20年）	187,000,000	209,608,300	
第133回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,619,767,200	
第134回利付国債（20年）	4,545,000,000	5,142,394,800	
第135回利付国債（20年）	50,000,000	56,145,000	
第136回利付国債（20年）	190,000,000	211,728,400	
第137回利付国債（20年）	4,342,000,000	4,884,272,380	
第138回利付国債（20年）	160,000,000	177,177,600	
第139回利付国債（20年）	310,000,000	345,997,200	
第140回利付国債（20年）	2,817,000,000	3,174,139,260	
第141回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,263,393,600	
第142回利付国債（20年）	3,090,000,000	3,514,102,500	
第143回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,947,373,200	
第144回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,686,835,200	
第145回利付国債（20年）	2,680,000,000	3,027,435,200	
第146回利付国債（20年）	3,420,000,000	3,866,549,400	
第147回利付国債（20年）	3,200,000,000	3,588,096,000	
第148回利付国債（20年）	2,940,000,000	3,267,633,600	
第149回利付国債（20年）	3,090,000,000	3,436,667,100	
第150回利付国債（20年）	3,250,000,000	3,580,102,500	
第151回利付国債（20年）	3,620,000,000	3,907,862,400	
第152回利付国債（20年）	2,910,000,000	3,140,879,400	
第153回利付国債（20年）	3,380,000,000	3,687,715,200	
第154回利付国債（20年）	3,320,000,000	3,583,774,000	
第155回利付国債（20年）	3,330,000,000	3,513,216,600	
第156回利付国債（20年）	3,100,000,000	3,039,240,000	

第157回利付国債(20年)	3,360,000,000	3,201,979,200	
第158回利付国債(20年)	2,900,000,000	2,866,186,000	
第159回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,526,837,500	
第160回利付国債(20年)	3,260,000,000	3,290,904,800	
第161回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,744,047,200	
第162回利付国債(20年)	3,820,000,000	3,790,165,800	
第163回利付国債(20年)	2,840,000,000	2,811,884,000	
第164回利付国債(20年)	3,600,000,000	3,506,184,000	
第165回利付国債(20年)	2,930,000,000	2,844,737,000	
第166回利付国債(20年)	3,510,000,000	3,500,347,500	
第167回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,451,912,800	
第168回利付国債(20年)	2,750,000,000	2,605,405,000	
第169回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,360,041,000	
第170回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,500,379,200	
第171回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,510,968,000	
第172回利付国債(20年)	2,230,000,000	2,087,592,200	
第173回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,611,084,000	
第174回利付国債(20年)	4,250,000,000	3,950,630,000	
第175回利付国債(20年)	2,690,000,000	2,535,109,800	
第176回利付国債(20年)	2,860,000,000	2,687,141,600	
第177回利付国債(20年)	3,010,000,000	2,770,644,800	
第178回利付国債(20年)	3,420,000,000	3,195,716,400	
第179回利付国債(20年)	2,730,000,000	2,544,851,400	
第180回利付国債(20年)	3,000,000,000	2,944,830,000	
第181回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,093,196,000	
第182回利付国債(20年)	2,780,000,000	2,864,095,000	
第183回利付国債(20年)	2,780,000,000	3,007,904,400	
第184回利付国債(20年)	2,140,000,000	2,196,966,800	
国債証券 合計	607,656,000,000	619,617,446,470	
地方債証券	第4回東京都公募公債(20年)	200,000,000	205,462,000
	第5回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,593,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,753,000
	第7回東京都公募公債(30年)	80,000,000	98,477,600
	第10回東京都公募公債(30年)	100,000,000	120,700,000
	第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,159,000
	第20回東京都公募公債(20年)	80,000,000	88,975,200

第21回東京都公募公債（20年）	80,000,000	89,780,000	
第28回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,699,000	
第33回東京都公募公債（20年）	100,000,000	92,982,000	
第738回東京都公募公債	100,000,000	100,603,000	
第747回東京都公募公債	500,000,000	504,960,000	
第750回東京都公募公債	200,000,000	202,028,000	
第751回東京都公募公債	500,000,000	504,150,000	
第757回東京都公募公債	150,000,000	149,883,000	
第758回東京都公募公債	150,000,000	149,883,000	
第782回東京都公募公債	100,000,000	100,197,000	
第809回東京都公募公債	100,000,000	98,378,000	
平成26年度第9回北海道公募公債	100,000,000	100,681,000	
平成26年度第13回北海道公募公債	100,000,000	100,648,000	
平成27年度第1回北海道公募公債	300,000,000	302,157,000	
平成27年度第5回北海道公募公債	100,000,000	101,082,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,809,000	
令和3年度第14回北海道公募公債（5年）	400,000,000	398,612,000	
第36回2号宮城県公募公債	342,000,000	336,870,000	
第2回神奈川県公募公債（20年）	680,000,000	698,659,200	
第2回神奈川県公募公債（30年）	180,000,000	226,571,400	
第3回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	520,625,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	124,523,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	552,735,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,719,000	
第234回神奈川県公募公債	100,000,000	100,316,000	
第243回神奈川県公募公債	100,000,000	98,720,000	
第256回神奈川県公募公債	350,000,000	344,085,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	220,000,000	244,609,200	
第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	110,513,000	
第179回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,874,000	
第184回大阪府公募公債（5年）	120,000,000	119,748,000	
第186回大阪府公募公債（5年）	300,000,000	299,301,000	
第191回大阪府公募公債（5年）	160,000,000	159,444,800	
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	210,000,000	211,520,400	
第393回大阪府公募公債	110,000,000	110,793,100	

第400回大阪府公募公債	136,000,000	137,506,880	
第407回大阪府公募公債	200,000,000	200,170,000	
第410回大阪府公募公債	200,000,000	199,572,000	
第415回大阪府公募公債	100,000,000	100,164,000	
第417回大阪府公募公債	300,000,000	301,608,000	
第420回大阪府公募公債	100,000,000	100,217,000	
第426回大阪府公募公債	100,000,000	100,034,000	
第435回大阪府公募公債	130,000,000	129,899,900	
第439回大阪府公募公債	100,000,000	99,799,000	
第455回大阪府公募公債	148,000,000	146,003,480	
第460回大阪府公募公債	194,000,000	190,847,500	
第464回大阪府公募公債	800,000,000	781,536,000	
第465回大阪府公募公債	500,000,000	489,760,000	
第467回大阪府公募公債	200,000,000	196,298,000	
第471回大阪府公募公債	97,000,000	94,194,760	
第483回大阪府公募公債	200,000,000	204,448,000	
平成26年度第2回京都府公募公債（15年）	200,000,000	209,562,000	
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	108,349,000	
第1回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	419,544,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	300,000,000	328,026,000	
第2回兵庫県公募公債（30年）	90,000,000	109,381,500	
第4回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	102,049,000	
第5回兵庫県公募公債（12年）	200,000,000	204,510,000	
第5回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	210,750,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,668,000	
第9回兵庫県公募公債（15年）	500,000,000	522,295,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	224,866,000	
第27回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	191,594,000	
平成28年度第29回兵庫県公募公債	100,000,000	100,496,000	
令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーン）	100,000,000	100,862,000	
第6回静岡県公募公債（15年）	300,000,000	314,388,000	
第11回静岡県公募公債（20年）	550,000,000	609,295,500	
第14回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	110,805,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	400,000,000	403,800,000	
令和2年度第15回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,888,400	
令和2年度第13回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,888,400	

平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	200,000,000	219,722,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	700,000,000	784,210,000	
平成23年度第13回愛知県公募公債	200,000,000	209,780,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	105,117,000	
平成26年度第7回愛知県公募公債	600,000,000	603,804,000	
平成26年度第15回愛知県公募公債	200,000,000	201,366,000	
平成27年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	101,081,000	
平成29年度第5回愛知県公募公債	600,000,000	602,172,000	
平成30年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	100,000,000	
平成30年度第8回愛知県公募公債	200,000,000	200,512,000	
令和3年度第18回愛知県公募公債	100,000,000	98,348,000	
平成26年度第7回広島県公募公債	260,000,000	261,950,000	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,071,000	
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	95,616,000	
平成30年度第4回広島県公募公債	200,000,000	200,470,000	
令和3年度第7回広島県公募公債	100,000,000	98,098,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,552,000	
第14回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	218,628,000	
第16回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	105,749,000	
平成26年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,497,000	
平成30年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,049,000	
令和2年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	98,851,000	
令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	110,000,000	109,877,900	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	86,752,400	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	95,855,200	
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	800,000,000	904,232,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,797,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	201,262,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,058,000	
令和2年度第4回福岡県公募公債	200,000,000	197,250,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン)	100,000,000	101,045,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,814,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	88,597,600	
第14回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	105,361,000	
平成27年度第3回千葉県公募公債	200,000,000	201,976,000	
平成27年度第6回千葉県公募公債	500,000,000	505,350,000	



平成28年度第3回千葉県公募公債	400,000,000	399,872,000	
平成30年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	99,559,000	
令和元年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,996,000	
平成27年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,455,000	
令和4年度第1回長野県公募公債	300,000,000	295,275,000	
第2回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	112,541,000	
第7回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	94,614,000	
平成27年度第1回岐阜県公募公債	300,000,000	303,255,000	
令和2年度第2回岐阜県公募公債(5年)	100,000,000	99,963,000	
平成27年度第1回大分県公募公債	203,400,000	205,501,122	
第136回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,947,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,404,000	
第142回共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,036,000	
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,534,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,688,000	
第148回共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,440,000	
第150回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,156,000	
第151回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,004,000	
第152回共同発行市場公募地方債	600,000,000	606,672,000	
第153回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,140,000	
第158回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,142,000	
第173回共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,484,000	
第185回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,612,000	
第193回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,224,000	
第198回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,674,000	
第232回共同発行市場公募地方債	450,000,000	444,708,000	
令和元年度第3回堺市公募公債	100,000,000	98,880,000	
平成27年度第1回長崎県公募公債	300,000,000	303,255,000	
平成27年度第1回佐賀県公募公債	500,000,000	505,340,000	
平成29年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,157,000	
平成30年度第1回福島県公募公債	100,000,000	100,263,000	
令和元年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	98,850,000	
令和2年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	98,448,000	
令和3年度第1回熊本県公募公債(5年)	200,000,000	199,658,000	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	111,736,000	
第15回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	112,976,000	

平成26年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	100,748,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	120,486,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	110,024,000	
第9回名古屋市公募公債(30年)	90,000,000	106,221,600	
第28回名古屋市公募公債(5年)	500,000,000	499,685,000	
第488回名古屋市公募公債	200,000,000	201,454,000	
第491回名古屋市公募公債	400,000,000	404,416,000	
第511回名古屋市公募公債	100,000,000	98,515,000	
第1回京都市公募公債(15年)	100,000,000	103,105,000	
第3回京都市公募公債(20年)	100,000,000	105,096,000	
第5回京都市公募公債(20年)	50,000,000	53,945,500	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	110,000,000	118,112,500	
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	220,156,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	111,060,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	104,244,000	
第7回横浜市公募公債(20年)	450,000,000	472,599,000	
第19回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	223,654,000	
平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	202,124,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	400,000,000	404,236,000	
平成27年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	303,132,000	
第27回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,793,000	
第33回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	94,895,000	
第35回横浜市公募公債(20年)	500,000,000	479,985,000	
第54回横浜市公募公債(5年)	300,000,000	299,889,000	
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	80,000,000	96,401,600	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	112,001,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債	400,000,000	420,288,000	
令和2年度第7回札幌市公募公債	200,000,000	196,506,000	
令和3年度第2回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	99,863,000	
第7回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	110,882,000	
第12回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	112,680,000	
第62回川崎市公募公債(5年)	490,000,000	489,162,100	
第17回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	109,010,000	
平成25年度第4回福岡市公募公債	50,000,000	50,110,000	
令和3年度第4回千葉市公募公債	100,000,000	97,347,000	
平成26年度第4回福井県公募公債	100,000,000	100,722,000	

	令和2年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	98,448,000	
	平成28年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	199,902,000	
	平成30年度第1回山梨県公募公債	100,000,000	100,417,000	
	令和2年度第1回山梨県公募公債	700,000,000	689,493,000	
	第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	110,737,000	
地方債証券 合計		39,570,400,000	40,666,562,742	
特殊債券	第4回政府保証新関西国際空港債券	104,000,000	104,986,960	
	第6回神奈川県住宅供給公社債券	100,000,000	99,060,000	
	第26回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	100,674,000	
	第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	30,000,000	32,419,800	
	第52回政府保証日本政策投資銀行	500,000,000	500,025,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	133,130,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	140,000,000	149,077,600	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	321,585,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	39,443,100	
	第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	258,298,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	216,164,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	110,000,000	140,305,000	
	第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	326,826,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	218,344,000	
	第28回道路債券（財投機関債）	100,000,000	121,571,000	
	第33回道路債券（財投機関債）	300,000,000	369,105,000	
	第38回道路債券（財投機関債）	200,000,000	205,524,000	
	第42回道路債券（財投機関債）	200,000,000	207,484,000	
	第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	150,000,000	167,821,500	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	111,027,000	
	第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,220,000	
	第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,757,000	
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,445,000		

第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,365,000	
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	106,438,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,348,000	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	300,000,000	313,407,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	114,606,000	
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,615,000	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	106,224,000	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,124,000	
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222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	124,000,000	124,798,560	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,333,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,183,000,000	1,191,340,150	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,701,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,584,000	
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	650,000,000	656,337,500	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	101,980,710	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,158,000	
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,894,000	
第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,844,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,806,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,698,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	300,000,000	
第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,949,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,975,000	
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	55,830,000	

第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）	100,000,000	123,397,000	
第9回公営企業債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	51,440,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	500,000,000	500,005,000	
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12回公営企業債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	310,314,000	
第13回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	112,832,000	
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	90,768,000	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	88,867,200	
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	150,000,000	159,528,000	
第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	108,584,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,300,000	
第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	329,514,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	200,000,000	221,154,000	
第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	55,700,000	
第27回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債）	100,000,000	99,953,000	
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	106,452,000	
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	241,588,800	
第67回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	170,000,000	171,191,700	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	304,847,860	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	403,716,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,878,000	
第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	303,090,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	151,351,500	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,345,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	674,000,000	674,107,840	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	102,000,000	102,001,020	
F90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,372,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	300,363,000	
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	325,000,000	324,918,750	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	131,000,000	131,265,930	
F104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,157,000	

第108回政府保証地方公共団体金融機構債券	223,000,000	223,000,000	
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,782,000	
F131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	76,043,800	
F151回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,994,000	
F203回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	207,840,000	
F234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	110,010,000	
第27回首都高速道路	100,000,000	99,863,000	
第24回阪神高速道路	200,000,000	199,860,000	
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	89,669,600	
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	88,743,200	
第5回本州四国連絡橋債券（財投機関債）	200,000,000	206,424,000	
第48回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	400,760,000	
第54回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,901,000	
第4回中部国際空港（財投機関債）	200,000,000	200,752,000	
第232回政府保証預金保険機構債券	400,000,000	400,576,000	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,747,000	30,897,352	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	35,828,000	35,685,762	
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4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	42,637,000	42,360,285	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,979,000	10,023,206	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	61,326,000	61,171,458	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,812,000	10,960,665	
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,674,000	20,786,673	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,590,000	20,709,176	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,725,000	20,799,420	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,051,000	21,095,256	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,202,000	20,167,860	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,964,000	38,680,608	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,763,000	9,802,833	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,574,000	40,332,202	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,725,000	21,634,205	
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,296,000	41,658,407	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,132,000	10,179,924	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,763,000	24,850,870	

第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,960,000	95,538,016	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,502,000	58,966,617	
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,362,000	17,027,933	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,892,000	36,390,611	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,646,000	37,107,486	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,822,000	38,273,523	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,788,000	40,340,683	
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,452,000	20,557,736	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,810,000	43,416,340	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,826,000	45,521,627	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,735,000	25,718,710	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,882,000	25,890,218	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,860,000	55,071,662	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,692,000	55,746,792	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,116,000	56,040,364	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,296,000	31,345,756	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,142,000	31,066,455	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,432,000	102,581,011	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,243,000	32,401,802	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,278,000	36,732,864	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,009,000	31,066,817	
第77回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	31,475,700	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,138,000	32,064,978	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,927,000	35,956,647	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,539,000	38,583,710	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,772,000	150,671,732	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,290,000	78,340,675	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	111,337,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,915,000	41,853,590	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,922,000	128,303,185	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,476,000	44,980,357	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	209,956,000	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,989,000	56,768,366	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,521,000	54,056,210	

第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,694,000	55,695,447	
第 1 0 0 回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	200,000,000	223,738,000	
第 1 0 2 回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	100,000,000	104,825,000	
第 1 0 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,052,000	59,016,824	
第 1 0 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,562,000	121,163,276	
第 1 0 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,244,000	124,275,863	
第 1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,920,000	262,194,460	
第 1 1 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	336,915,000	330,126,162	
第 1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	205,053,000	200,203,496	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,542,000	140,183,196	
第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	492,940,000	488,715,504	
第 1 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	130,000,000	155,825,800	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	218,448,000	215,809,148	
第 1 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	100,000,000	111,273,000	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,918,000	71,897,148	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,990,000	73,776,661	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,657,000	72,597,812	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,672,000	148,782,573	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,388,000	148,132,180	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,098,000	73,871,649	
第 1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,689,000	73,481,278	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	227,535,000	224,103,772	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,505,000	75,156,981	
第 1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,440,000	76,304,729	
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,622,000	153,637,819	
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,588,000	152,950,913	
第 1 4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券 (財投機関債)	100,000,000	104,887,000	
第 1 4 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,684,000	158,189,128	
第 1 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	247,833,000	238,288,951	
第 1 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	252,396,000	243,625,239	
第 1 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,974,000	164,587,523	
第 1 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,950,000	82,709,868	
第 1 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,828,000	165,386,997	



第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,149,000	85,933,815	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,209,000	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,216,000	173,439,811	
第164回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,986,000	
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168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	271,167,000	264,602,046	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,982,000	178,337,916	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,202,000	178,372,795	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,590,000	179,866,404	
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174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	187,853,400	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,210,000	91,624,877	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,612,000	182,700,899	
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,048,000	184,331,252	
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	189,848,000	185,976,999	
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,148,000	93,641,807	
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182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,664,000	189,423,391	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,436,000	190,578,950	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,008,000	190,657,481	
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,774,000	98,173,895	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,516,000	201,959,493	
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	99,493,000	101,770,394	
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	399,612,000	411,780,185	
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	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,886,000	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,370,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	51,957,000	
い第832号商工債券	100,000,000	99,950,000	
い第843号商工債券	200,000,000	199,956,000	

	い第848号商工債券	100,000,000	99,846,000	
	い第850号商工債券	300,000,000	299,349,000	
	い第852号商工債券	100,000,000	99,722,000	
	い第854号商工債券	500,000,000	498,310,000	
	い第857号商工債券	100,000,000	99,620,000	
	い第872号商工債券	400,000,000	402,572,000	
	第376回信金中金債	100,000,000	99,865,000	
	第11号商工債券(10年)	300,000,000	302,130,000	
	第2回信金中金債(10年)	100,000,000	100,977,000	
	第7回国際協力機構債券(財投機関債)	70,000,000	78,406,300	
	第83回東日本高速道路	400,000,000	398,800,000	
	第29回西日本高速道路	200,000,000	200,974,000	
	第56回西日本高速道路	900,000,000	899,397,000	
	第61回西日本高速道路	700,000,000	697,795,000	
	第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	103,698,000	
	特殊債券 合計	33,990,909,000	34,857,299,165	
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26回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,025,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,484,000	
	第35回フランス相互信用連合銀行	500,000,000	493,705,000	
	第38回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	301,665,000	
	第6回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	200,862,000	
	第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	300,000,000	300,024,000	
	第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,565,000	
	第1回サントナデル銀行(2019)	500,000,000	497,100,000	
	第12回新関西国際空港	100,000,000	104,146,000	
	第27回新関西国際空港	100,000,000	99,771,000	
	第32回成田国際空港	100,000,000	99,232,000	
	第17回ナショナル・オーストラリア銀行	300,000,000	300,213,000	
	第1回国際石油開発帝石	100,000,000	99,597,000	
	第48回鹿島建設(サステナビリティ)	100,000,000	100,950,000	
	第10回明治ホールディングス(サステナビリティ)	200,000,000	199,110,000	
	第16回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,651,000	
	第19回アサヒグループホールディングス	400,000,000	400,864,000	
	第9回サントリーホールディングス	200,000,000	200,378,000	

第5回サントリー食品インターナショナル	200,000,000	199,832,000	
第22回味の素	100,000,000	100,295,000	
第3回 キュービー	100,000,000	100,093,000	
第13回日本たばこ産業	200,000,000	199,744,000	
第16回日本たばこ産業	300,000,000	304,950,000	
第6回ヒューリック	400,000,000	398,896,000	
第4回トヨタ紡織	200,000,000	200,112,000	
第27回東急不動産ホールディングス (グリーン)	300,000,000	300,882,000	
第9回クラレ	100,000,000	99,972,000	
第16回旭化成	200,000,000	199,640,000	
第42回王子ホールディングス	300,000,000	298,944,000	
第11回イビデン	200,000,000	199,756,000	
第56回三井化学	100,000,000	100,121,000	
第4回野村総合研究所	100,000,000	99,516,000	
第6回花王	200,000,000	199,770,000	
第1回アステラス製薬	400,000,000	400,724,000	
第19回オリエンタルランド	300,000,000	299,745,000	
第12回ヤフー	500,000,000	495,870,000	
第19回Zホールディングス	400,000,000	396,464,000	
第22回Zホールディングス	200,000,000	199,832,000	
第8回住友三井オートサービス (サステナビリティ)	100,000,000	100,145,000	
第11回ブリヂストン	500,000,000	499,765,000	
第12回日本電気硝子	100,000,000	99,315,000	
第4回新日本製鐵	200,000,000	200,292,000	
第36回ジェイ エフ イー ホールディングス	400,000,000	399,664,000	
第14回LIXIL	200,000,000	200,198,000	
第1回日本郵政 (グリーン)	100,000,000	99,811,000	
第30回ダイキン工業	200,000,000	199,342,000	
第55回日本精工	100,000,000	100,229,000	
第19回日立製作所	100,000,000	99,521,000	
第17回パナソニック	500,000,000	502,375,000	
第18回パナソニック	100,000,000	99,802,000	
第22回パナソニック	100,000,000	99,012,000	
第18回デンソー	300,000,000	299,856,000	
第40回三菱重工業	300,000,000	299,307,000	

第10回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	100,000,000	99,681,000	
第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）	800,000,000	797,736,000	
第31回トヨタ自動車（サステナビリティ）	200,000,000	201,498,000	
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	200,000,000	199,840,000	
第63回三井物産	400,000,000	431,392,000	
第51回住友商事	100,000,000	104,041,000	
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	300,000,000	300,207,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	500,000,000	491,885,000	
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	224,394,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	205,974,000	
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	207,476,000	
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	100,000,000	110,463,000	
第88回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	107,697,000	
第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	98,065,000	
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	100,000,000	104,190,000	
第28回芙蓉総合リース	500,000,000	497,505,000	
第36回芙蓉総合リース	100,000,000	100,064,000	
第14回みずほリース	100,000,000	100,288,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,200,000,000	1,199,832,000	
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	299,535,000	
第20回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	600,000,000	599,184,000	
第52回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	199,344,000	
第53回日産フィナンシャルサービス	300,000,000	297,396,000	
第34回東京センチュリー	300,000,000	296,532,000	
第70回ホンダファイナンス	200,000,000	199,700,000	
第72回ホンダファイナンス	400,000,000	399,276,000	
第96回トヨタファイナンス	800,000,000	797,328,000	
第97回トヨタファイナンス	200,000,000	199,842,000	
第22回ポケットカード	100,000,000	99,661,000	
第31回リコーリース	100,000,000	100,138,000	
第41回リコーリース	500,000,000	498,070,000	
第79回アコム	300,000,000	299,787,000	

第80回アコム	200,000,000	198,764,000	
第81回アコム	100,000,000	98,789,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	300,000,000	301,242,000	
第1回三菱HCキャピタル	900,000,000	898,047,000	
第69回三菱UFJリース	500,000,000	498,985,000	
第3回野村ホールディングス	200,000,000	197,770,000	
第24回野村ホールディングス	100,000,000	103,493,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	103,440,000	
第83回三井不動産(グリーン)	200,000,000	201,780,000	
第137回三菱地所	300,000,000	299,478,000	
第143回三菱地所	100,000,000	101,059,000	
第111回住友不動産(グリーン)	100,000,000	100,431,000	
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,639,000	
第13回森トラスト総合リート投資法人	200,000,000	199,930,000	
第76回東京急行電鉄	200,000,000	209,636,000	
第36回京王電鉄	200,000,000	199,870,000	
第53回東日本旅客鉄道	300,000,000	328,272,000	
第100回東日本旅客鉄道	200,000,000	221,080,000	
第102回東日本旅客鉄道	100,000,000	100,555,000	
第163回東日本旅客鉄道	600,000,000	596,994,000	
第174回東日本旅客鉄道	700,000,000	698,621,000	
第73回西日本旅客鉄道	400,000,000	398,096,000	
第42回東海旅客鉄道	100,000,000	110,728,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	108,860,000	
第28回東京地下鉄	300,000,000	298,407,000	
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	198,750,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	199,128,000	
第8回ニッコンホールディングス	100,000,000	100,021,000	
第1回横浜高速鉄道	300,000,000	301,947,000	
第9回九州旅客鉄道	200,000,000	199,502,000	
第31回KDDI(サステナビリティ)	200,000,000	200,508,000	
第9回ソフトバンク	300,000,000	296,457,000	
第14回ソフトバンク	100,000,000	98,932,000	
第16回ソフトバンク	500,000,000	474,195,000	
第548回東京電力	100,000,000	103,675,000	
第567回東京電力	100,000,000	101,364,000	

第508回関西電力	200,000,000	200,492,000	
第510回関西電力	500,000,000	501,705,000	
第511回関西電力	100,000,000	99,975,000	
第518回関西電力	200,000,000	199,562,000	
第524回関西電力	200,000,000	199,886,000	
第532回関西電力	100,000,000	100,016,000	
第543回関西電力	200,000,000	199,512,000	
第393回中国電力	100,000,000	99,831,000	
第400回中国電力	200,000,000	199,738,000	
第409回中国電力	200,000,000	199,232,000	
第433回中国電力	400,000,000	398,820,000	
第448回中国電力	200,000,000	201,196,000	
第307回北陸電力	100,000,000	102,315,000	
第322回北陸電力	100,000,000	100,121,000	
第485回東北電力	100,000,000	99,846,000	
第494回東北電力	200,000,000	200,360,000	
第529回東北電力	500,000,000	496,915,000	
第552回東北電力	400,000,000	407,136,000	
第449回九州電力	300,000,000	300,681,000	
第468回九州電力	100,000,000	99,723,000	
第471回九州電力	300,000,000	299,130,000	
第484回九州電力	400,000,000	394,388,000	
第493回九州電力	400,000,000	397,396,000	
第511回九州電力	600,000,000	603,228,000	
第50回電源開発	200,000,000	200,272,000	
第57回電源開発	100,000,000	99,390,000	
第59回電源開発	300,000,000	298,719,000	
第64回電源開発	600,000,000	595,416,000	
第67回電源開発	200,000,000	195,682,000	
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	100,000,000	100,668,000	
第13回東京電力パワーグリッド	300,000,000	300,153,000	
第15回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,454,000	
第25回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,081,000	
第28回東京電力パワーグリッド	400,000,000	403,912,000	
第31回東京電力パワーグリッド	300,000,000	302,073,000	

第33回東京電力パワーグリッド	200,000,000	200,394,000	
第35回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,647,000	
第39回東京電力パワーグリッド	400,000,000	403,104,000	
第41回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,142,000	
第47回東京電力パワーグリッド	200,000,000	193,916,000	
第49回東京電力パワーグリッド	400,000,000	399,292,000	
第16回JERA	200,000,000	201,472,000	
第17回JERA	200,000,000	203,094,000	
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3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	400,000,000	402,612,000	
第51回大阪ガス	100,000,000	100,793,000	
第13回広島ガス	200,000,000	198,452,000	
第7回ファーストリテイリング	100,000,000	100,151,000	
社債券 合計	42,900,000,000	43,011,888,000	
合計	724,117,309,000	738,153,196,377	

## 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	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



金)	
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

定)		
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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	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	
カナダドル合計			94,670,000.00	86,266,693.04 (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 SINGAPOGOVT 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 アリンギ ット	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. 502MALAYSIAGOV 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			
マレーシアアリンギット合計			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%
マレーシアリンギット	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。

## 新興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	742,783,877
コール・ローン	56,197,963
国債証券	75,077,835,894
派生商品評価勘定	149,274
未収入金	306,443,996
未収利息	935,101,349
前払費用	102,847,802
流動資産合計	77,221,360,155
資産合計	77,221,360,155
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	268,583
未払金	48,463,190
未払解約金	28,580,648
未払利息	141
流動負債合計	77,312,562
負債合計	77,312,562
純資産の部	
元本等	
元本	46,015,699,639
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	31,128,347,954
元本等合計	77,144,047,593
純資産合計	77,144,047,593
負債純資産合計	77,221,360,155

### 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	39,808,276,620円
期中追加設定元本額	8,062,573,090円
期中一部解約元本額	1,855,150,071円
元本の内訳※	
eMAXIS バランス (8資産均等型)	3,526,371,738円
eMAXIS バランス (波乗り型)	333,283,516円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1,144,406,446円
海外債券セレクション (ラップ向け)	519,667,726円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	15,544,785,100円
つみたて8資産均等バランス	7,441,868,126円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,354,674円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,321,327円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,357,649円
ラップ向けインデックスf 新興国債券	1,910,824,737円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,166,797,912円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	11,223,113,228円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	87,056,415円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	497,359,290円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	383,164,678円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	179,982,851円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	6,099,084円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	10,364,781円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	34,520,361円
合計	46,015,699,639円
2. 受益権の総数	46,015,699,639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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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)
国債証券	766,813,731
合計	766,813,731

(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	44,302,335	—	44,155,802	△146,533
	マレーシアリンギット	26,107,750	—	26,076,385	△31,365

	メキシコペソ	20,821,000	—	20,935,250	114,250
	南アフリカランド	3,862,250	—	3,824,150	△38,100
	売建				
	チリペソ	44,302,335	—	44,354,920	△52,585
	チェココルナ	7,271,990	—	7,268,910	3,080
	ハンガリーフォリント	11,001,342	—	10,977,018	24,324
	ルーマニアレイ	9,471,560	—	9,463,940	7,620
	合計	167,140,562	—	167,056,375	△119,309

(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	1.6765円
(1万口当たり純資産額)	(16,765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
マレーシアリング ット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	17,800,000.00	16,289,062.47	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	14,600,000.00	14,539,441.39	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	14,700,000.00	14,406,574.60	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	8,850,000.00	8,877,286.32	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	13,700,000.00	12,939,610.68	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	11,570,000.00	11,363,394.51	

		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	2,400,000.00	2,421,215.04	
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	14,450,000.00	14,513,731.72	
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	12,600,000.00	12,728,455.74	
		3. 9 MALAYSIAGOV 261130	12,720,000.00	12,864,031.10	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	2,700,000.00	2,732,991.30	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	25,600,000.00	25,848,071.68	
		4. 059 MALAYSIAGOV 240930	12,400,000.00	12,493,767.56	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	10,100,000.00	9,779,047.65	
		4. 181 MALAYSIAGOV 240715	10,150,000.00	10,223,438.29	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	9,550,000.00	9,716,024.84	
		4. 369 MALAYSIA IN 281031	12,800,000.00	13,241,731.84	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	2,400,000.00	2,487,463.68	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	5,340,000.00	5,673,017.88	
		4. 762 MALAYSIAGOV 370407	9,400,000.00	10,051,031.78	
		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	6,300,000.00	6,876,282.42	
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	5,500,000.00	6,064,239.49	
マレーシアリングット合計			235,630,000.00	236,129,911.98 (7,245,315,767)	
タイバーツ	国債証券	0. 75 THAILAND 240617	69,800,000.00	68,935,243.61	
		0. 75 THAILAND 240917	81,300,000.00	79,982,745.69	
		0. 95 THAILAND 250617	99,000,000.00	96,789,645.81	
		1 THAILAND 270617	108,700,000.00	103,560,679.21	
		1. 45 THAILAND 241217	87,600,000.00	86,775,915.26	
		1. 585 THAILAND 351217	80,900,000.00	71,200,447.57	
		1. 6 THAILAND 291217	74,500,000.00	70,857,831.33	
		1. 6 THAILAND 350617	38,200,000.00	33,946,680.21	
		2 THAILAND 311217	115,900,000.00	112,100,475.79	
		2 THAILAND 420617	53,500,000.00	45,980,349.23	
		2. 125 THAILAND 261217	87,300,000.00	86,963,475.08	
		2. 35 THAILAND 260617	79,700,000.00	80,126,243.57	
		2. 65 THAILAND 280617	74,600,000.00	75,609,211.18	
		2. 875 THAILAND 281217	84,400,000.00	86,494,284.72	
		2. 875 THAILAND 460617	62,700,000.00	59,019,578.34	
		3. 3 THAILAND 380617	91,000,000.00	95,844,730.80	
		3. 35 THAILAND 330617	44,000,000.00	46,859,234.40	
		3. 39 THAILAND 370617	42,400,000.00	45,070,903.20	

		3. 4 THAILAND 360617	68,000,000.00	72,211,845.20	
		3. 45 THAILAND 430617	34,400,000.00	36,341,570.40	
		3. 65 THAILAND 310620	70,100,000.00	76,179,730.94	
		3. 775 THAILAND 320625	88,600,000.00	97,781,715.46	
		3. 85 THAILAND 251212	74,700,000.00	77,759,174.16	
		4. 875 THAILAND 290622	76,300,000.00	86,768,642.31	
タイパーツ合計			1,787,600,000.00	1,793,160,353.47 (7,298,162,638)	
フィリピン	国債証券	6. 25 PHILIPPI(GL) 360114	20,000,000.00	19,598,044.40	
フィリピン合計			20,000,000.00	19,598,044.40 (50,423,808)	
インドネシア	国債証券	10. 5 INDONESIA 300815	7,050,000,000.00	8,716,214,625.00	
		11 INDONESIA 250915	5,250,000,000.00	5,819,188,725.00	
		5. 125 INDONESIA 270415	28,800,000,000.00	28,323,072,000.00	
		5. 5 INDONESIA 260415	33,900,000,000.00	33,730,500,000.00	
		6. 125 INDONESIA 280515	29,000,000,000.00	29,162,400,000.00	
		6. 25 INDONESIA 360615	6,000,000,000.00	5,960,400,000.00	
		6. 375 INDONESIA 280815	16,000,000,000.00	16,355,920,000.00	
		6. 375 INDONESIA 320415	41,200,000,000.00	41,405,176,000.00	
		6. 375 INDONESIA 370715	4,000,000,000.00	3,964,780,000.00	
		6. 5 INDONESIA 250615	39,900,000,000.00	40,394,760,000.00	
		6. 5 INDONESIA 310215	35,900,000,000.00	36,183,753,600.00	
		6. 625 INDONESIA 330515	20,400,000,000.00	20,769,240,000.00	
		7 INDONESIA 270515	23,450,000,000.00	24,223,850,000.00	
		7 INDONESIA 300915	44,700,000,000.00	46,496,940,000.00	
		7 INDONESIA 330215	22,100,000,000.00	23,229,420,500.00	
		7. 125 INDONESIA 420615	24,600,000,000.00	25,738,980,000.00	
		7. 125 INDONESIA 430615	8,000,000,000.00	8,461,160,000.00	
		7. 5 INDONESIA 320815	8,400,000,000.00	9,089,640,000.00	
		7. 5 INDONESIA 350615	32,300,000,000.00	35,006,740,000.00	
		7. 5 INDONESIA 380515	23,200,000,000.00	25,206,800,000.00	
7. 5 INDONESIA 400415	18,400,000,000.00	19,960,320,000.00			
8. 125 INDONESIA 240515	20,000,000,000.00	20,421,000,000.00			
8. 25 INDONESIA 290515	24,500,000,000.00	27,050,450,000.00			
8. 25 INDONESIA 320615	19,000,000,000.00	21,426,070,100.00			

		8. 25 INDONESIA 360515	26,600,000,000.00	30,635,220,000.00	
		8. 375 INDONESIA 240315	22,200,000,000.00	22,624,020,000.00	
		8. 375 INDONESIA 260915	33,930,000,000.00	36,420,462,000.00	
		8. 375 INDONESIA 340315	35,700,000,000.00	41,142,465,000.00	
		8. 375 INDONESIA 390415	23,200,000,000.00	27,118,480,000.00	
		8. 75 INDONESIA 310515	15,400,000,000.00	17,705,380,000.00	
		9 INDONESIA 290315	20,100,000,000.00	22,952,190,000.00	
		9. 5 INDONESIA 310715	12,200,000,000.00	14,640,662,460.00	
インドネシアルピア合計			725,380,000,000.00	770,335,655,010.00	(7,395,222,288)
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	73,700,000.00	73,251,915.79	
		10 MEXICAN BONOS 361120	18,200,000.00	20,171,970.00	
		5 MEXICAN BONOS 250306	47,000,000.00	43,420,480.00	
		5. 5 MEXICAN BONOS 270304	66,200,000.00	59,113,952.00	
		5. 75 MEXICAN BONO 260305	118,200,000.00	108,112,320.28	
		7. 5 MEXICAN BONOS 270603	98,200,000.00	93,622,898.00	
		7. 5 MEXICAN BONOS 330526	40,000,000.00	37,024,400.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 310529	111,500,000.00	105,986,325.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 341123	24,400,000.00	22,854,504.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 421113	72,600,000.00	64,996,602.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	68,000,000.00	65,886,711.64	
		8 MEXICAN BONOS 471107	65,400,000.00	59,740,284.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	32,400,000.00	29,217,348.00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290531	69,600,000.00	69,271,488.00	
8. 5 MEXICAN BONOS 381118	57,500,000.00	55,830,775.00			
メキシコペソ合計			962,900,000.00	908,501,973.71	(7,610,793,584)
ブラジル リアル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	36,270,000.00	37,483,719.69	
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	29,100,000.00	30,013,400.11	
		10 (IN)BRAZIL NTN 310101	12,100,000.00	12,168,671.85	
		10 (IN)BRAZIL NTN 330101	4,600,000.00	4,584,544.64	
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	24,700,000.00	25,138,072.77	
		BRAZIL-LTN 240101	69,400,000.00	65,163,349.18	
		BRAZIL-LTN 240701	17,500,000.00	15,628,937.09	
		BRAZIL-LTN 250701	31,500,000.00	25,687,294.92	
		BRAZIL-LTN 260101	51,100,000.00	39,714,273.57	

		BRAZIL-LTN 260701	22,400,000.00	16,579,115.60	
ブラジルリアル合計			298,670,000.00	272,161,379.42 (8,159,370,938)	
チリペソ	国債証券	2.3 BONOS TESORER 281001	480,000,000.00	417,576,000.00	
		2.5 BONOS TESORER 250301	2,060,000,000.00	1,936,091,000.00	
		4.5 BONOS TESORER 260301	1,420,000,000.00	1,401,043,000.00	
		4.7 BONOS TESORER 300901	1,520,000,000.00	1,497,732,000.00	
		5 BONOS TESORERIA 281001	410,000,000.00	407,340,547.00	
		5 BONOS TESORERIA 350301	1,560,000,000.00	1,578,990,238.00	
		6 BONOS TESORERIA 330401	950,000,000.00	1,024,677,951.00	
		6 BONOS TESORERIA 430101	1,315,000,000.00	1,498,245,250.00	
		7 BONOS TESORERIA 340501	350,000,000.00	407,822,065.00	
チリペソ合計			10,065,000,000.00	10,169,518,051.00 (1,809,919,975)	
チェココ ルナ	国債証券	0.05 CZECH REPUB 291129	58,000,000.00	44,027,800.00	
		0.25 CZECH REPUB 270210	143,500,000.00	122,282,090.00	
		1.5 CZECH REPUBLI 400424	17,500,000.00	11,515,000.00	
		1.75 CZECH REPUB 320623	121,200,000.00	98,838,600.00	
		1.95 CZECH REPUB 370730	14,300,000.00	10,796,500.00	
		3.5 CZECH REPUBLI 350530	83,500,000.00	77,613,250.00	
		5 CZECH REPUBLIC 300930	30,000,000.00	31,200,000.00	
		5.5 CZECH REPUBLI 281212	68,000,000.00	71,777,400.00	
		6 CZECH REPUBLIC 260226	71,500,000.00	73,752,250.00	
		CZECH REPUBLIC 241212	86,000,000.00	79,421,000.00	
チェココルナ合計			693,500,000.00	621,223,890.00 (4,106,849,014)	
エジプト ボンド	国債証券	13.536 EGYPT GOVE 250114	7,000,000.00	6,101,965.31	
		14.06 EGYPT GOVER 260112	27,000,000.00	22,117,187.16	
		14.292 EGYPT GOVE 280105	10,000,000.00	7,562,398.00	
		14.369 EGYPT GOVE 251020	17,000,000.00	14,194,552.05	
		14.4 EGYPT GOVERN 290910	9,000,000.00	6,400,865.79	
		14.483 EGYPT GOVE 260406	23,000,000.00	18,719,039.67	
		14.531 EGYPT GOVE 240914	20,000,000.00	18,305,624.40	
		14.556 EGYPT GOVE 271013	15,000,000.00	11,373,097.35	
		14.563 EGYPT GOVE 260706	6,500,000.00	5,271,562.33	
		14.664 EGYPT GOVE 301006	7,000,000.00	4,912,263.58	

		16.1 EGYPT GOVERN 290507	4,500,000.00	3,470,296.81	
エジプトポンド合計			146,000,000.00	118,428,852.45 (549,083,531)	
コロンビアペソ	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	7,700,000,000.00	7,716,822,729.00	
		13.25 TITULOS DE 330209	5,200,000,000.00	6,044,396,176.00	
		5.75 TITULOS DE T 271103	5,900,000,000.00	5,059,621,464.00	
		6 TITULOS DE TESO 280428	11,980,000,000.00	10,232,102,426.00	
		6.25 TITULOS DE T 251126	7,190,000,000.00	6,644,750,664.00	
		6.25 TITULOS DE T 360709	4,900,000,000.00	3,411,621,766.00	
		7 TITULOS DE TESO 310326	10,700,000,000.00	8,878,265,829.00	
		7 TITULOS DE TESO 320630	11,700,000,000.00	9,464,263,146.00	
		7.25 TITULOS DE T 341018	10,000,000,000.00	7,840,768,900.00	
		7.25 TITULOS DE T 501026	8,600,000,000.00	5,907,588,024.00	
		7.5 TITULOS DE TE 260826	11,120,000,000.00	10,416,256,566.40	
		7.75 TITULOS DE T 300918	8,340,000,000.00	7,327,159,625.40	
		9.25 TITULOS DE T 420528	9,700,000,000.00	8,438,465,724.00	
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	1,290,000,000.00	1,253,749,400.40	
コロンビアペソ合計			114,320,000,000.00	98,635,832,440.20 (3,383,702,231)	
ハンガリーフォリント	国債証券	1 HUNGARY 251126	427,000,000.00	351,207,500.00	
		1.5 HUNGARY 260422	660,000,000.00	537,669,000.00	
		1.5 HUNGARY 260826	360,000,000.00	288,594,000.00	
		2 HUNGARY 290523	430,000,000.00	322,483,660.00	
		2.25 HUNGARY 330420	540,000,000.00	365,013,000.00	
		2.25 HUNGARY 340622	150,000,000.00	98,445,000.00	
		2.5 HUNGARY 241024	390,000,000.00	348,037,560.00	
		2.75 HUNGARY 261222	373,000,000.00	305,464,620.00	
		3 HUNGARY 240626	159,000,000.00	145,841,955.00	
		3 HUNGARY 271027	521,000,000.00	425,240,200.00	
		3 HUNGARY 300821	498,000,000.00	386,701,980.00	
		3 HUNGARY 381027	352,000,000.00	226,353,600.00	
		3 HUNGARY 410425	240,000,000.00	150,072,000.00	
		3.25 HUNGARY 311022	618,000,000.00	474,809,400.00	
		4.5 HUNGARY 280323	250,000,000.00	215,093,125.00	
		4.75 HUNGARY 321124	330,000,000.00	276,547,972.80	
5.5 HUNGARY 250624	492,000,000.00	450,087,996.00			



		6. 75 HUNGARY 281022	352,000,000.00	334,132,374.40	
ハンガリーフォリント合計			7,142,000,000.00	5,701,794,943.20 (2,409,225,031)	
ペルーヌエボソル	国債証券	5. 35 PERU 400812	3,250,000.00	2,715,191.86	
		5. 4 PERU 340812	5,200,000.00	4,585,844.94	
		5. 7 PERU 240812	1,050,000.00	1,044,292.86	
		5. 94 PERU 290212	6,600,000.00	6,451,803.79	
		6. 15 PERU 320812	7,400,000.00	7,052,075.16	
		6. 35 PERU 280812	4,500,000.00	4,531,781.92	
		6. 9 PERU 370812	7,000,000.00	6,915,472.48	
		6. 95 PERU 310812	6,800,000.00	6,883,258.99	
		8. 2 PERU 260812	3,000,000.00	3,188,713.68	
ペルーヌエボソル合計			44,800,000.00	43,368,435.68 (1,711,188,366)	
ポーランドズロチ	国債証券	0 POLAND 251025	1,800,000.00	1,585,800.00	
		0. 25 POLAND 261025	14,200,000.00	11,866,940.00	
		0. 75 POLAND 250425	12,500,000.00	11,432,500.00	
		1. 25 POLAND 301025	13,900,000.00	10,299,205.00	
		1. 75 POLAND 320425	14,400,000.00	10,463,040.00	
		2. 25 POLAND 241025	15,500,000.00	14,776,150.00	
		2. 5 POLAND 240425	9,100,000.00	8,843,471.00	
		2. 5 POLAND 260725	17,000,000.00	15,455,890.00	
		2. 5 POLAND 270725	10,900,000.00	9,636,690.00	
		2. 75 POLAND 280425	13,250,000.00	11,615,082.50	
		2. 75 POLAND 291025	19,200,000.00	16,314,240.00	
		3. 25 POLAND 250725	14,500,000.00	13,779,422.50	
		3. 75 POLAND 270525	15,100,000.00	14,012,498.00	
		6 POLAND 331025	3,400,000.00	3,430,430.00	
		7. 5 POLAND 280725	8,500,000.00	9,156,416.75	
ポーランドズロチ合計			183,250,000.00	162,667,775.75 (5,731,924,414)	
南アフリカランド	国債証券	10. 5 SOUTH AFRICA 261221	125,500,000.00	129,807,787.50	
		6. 25 SOUTH AFRICA 360331	39,800,000.00	25,095,890.00	
		6. 5 SOUTH AFRICA 410228	37,300,000.00	21,839,150.00	
		7 SOUTH AFRICA 310228	66,000,000.00	52,301,700.00	
		8 SOUTH AFRICA 300131	150,800,000.00	131,957,540.00	

		8. 25 SOUTH AFRICA 320331	116,200,000.00	96,835,270.00	
		8. 5 SOUTH AFRICA 370131	103,600,000.00	78,321,600.00	
		8. 75 SOUTH AFRICA 440131	86,800,000.00	63,229,460.00	
		8. 75 SOUTH AFRICA 480228	139,900,000.00	100,776,965.00	
		8. 875 SOUTH AFRIC 350228	105,500,000.00	85,571,050.00	
		9 SOUTH AFRICA 400131	80,000,000.00	60,940,000.00	
南アフリカランド合計			1,051,400,000.00	846,676,412.50 (6,477,074,555)	
ウルグアイペソ	国債証券	8. 25 URUGUAY 310521	17,000,000.00	15,569,283.40	
		8. 5 URUGUAY(GL) 280315	7,000,000.00	6,663,826.47	
ウルグアイペソ合計			24,000,000.00	22,233,109.87 (84,705,925)	
中国元	国債証券	1. 99 CHINA GOVT 250409	14,000,000.00	13,949,040.00	
		2. 18 CHINA GOVT 250825	3,000,000.00	2,994,564.06	
		2. 24 CHINA GOVT 250525	3,000,000.00	3,000,762.30	
		2. 26 CHINA GOVT 250224	3,000,000.00	3,001,551.00	
		2. 28 CHINA GOVT 251125	4,000,000.00	3,999,725.04	
		2. 37 CHINA GOVT 270120	5,000,000.00	4,992,796.35	
		2. 44 CHINA GOVT 271015	4,000,000.00	3,995,738.64	
		2. 46 CHINA GOVT 260215	6,000,000.00	6,027,259.20	
		2. 47 CHINA GOVT 240902	3,000,000.00	3,013,661.10	
		2. 48 CHINA GOVT 270415	5,000,000.00	5,006,619.00	
		2. 5 CHINA GOVT 270725	7,000,000.00	7,011,333.70	
		2. 6 CHINA GOVT 320901	5,000,000.00	4,946,828.50	
		2. 62 CHINA GOVT 280415	3,000,000.00	3,020,171.40	
		2. 62 CHINA GOVT 290925	6,000,000.00	5,989,657.02	
		2. 64 CHINA GOVT 280115	5,000,000.00	5,034,649.50	
		2. 68 CHINA GOVT 300521	18,000,000.00	18,022,942.80	
		2. 69 CHINA GOVT 260812	10,000,000.00	10,100,903.00	
		2. 69 CHINA GOVT 320815	8,000,000.00	7,972,238.88	
		2. 75 CHINA GOVT 290615	3,000,000.00	3,020,082.90	
		2. 75 CHINA GOVT 320217	7,000,000.00	7,010,677.80	
		2. 76 CHINA GOVT 320515	7,000,000.00	7,027,384.00	
		2. 79 CHINA GOVT 291215	4,000,000.00	4,028,341.60	
		2. 8 CHINA GOVT 290324	2,000,000.00	2,023,474.20	
2. 8 CHINA GOVT 300325	3,000,000.00	3,025,031.40			

		2. 8 CHINA GOVT 321115	7,000,000.00	7,034,129.20	
		2. 84 CHINA GOVT 240408	2,000,000.00	2,013,817.00	
		2. 85 CHINA GOVT 270604	12,000,000.00	12,185,232.00	
		2. 88 CHINA GOVT 330225	7,000,000.00	7,113,005.90	
		2. 89 CHINA GOVT 311118	4,000,000.00	4,049,551.20	
		2. 91 CHINA GOVT 281014	2,000,000.00	2,038,805.80	
		2. 94 CHINA GOVT 241017	16,000,000.00	16,183,249.60	
		3. 01 CHINA GOVT 280513	12,000,000.00	12,294,912.00	
		3. 02 CHINA GOVT 251022	15,000,000.00	15,269,389.50	
		3. 02 CHINA GOVT 310527	11,000,000.00	11,271,656.00	
		3. 03 CHINA GOVT 260311	7,000,000.00	7,138,687.50	
		3. 12 CHINA GOVT 261205	7,000,000.00	7,178,133.20	
		3. 12 CHINA GOVT 521025	2,000,000.00	2,013,156.40	
		3. 13 CHINA GOVT 291121	14,000,000.00	14,436,325.40	
		3. 19 CHINA GOVT 240411	10,000,000.00	10,103,738.00	
		3. 19 CHINA GOVT 530415	1,000,000.00	1,028,442.90	
		3. 22 CHINA GOVT 251206	9,000,000.00	9,210,640.50	
		3. 25 CHINA GOVT 260606	15,200,000.00	15,635,682.16	
		3. 25 CHINA GOVT 281122	10,000,000.00	10,422,721.00	
		3. 27 CHINA GOVT 301119	8,000,000.00	8,401,040.00	
		3. 28 CHINA GOVT 271203	11,000,000.00	11,401,932.30	
		3. 29 CHINA GOVT 290523	15,000,000.00	15,665,367.00	
		3. 32 CHINA GOVT 520415	4,000,000.00	4,150,863.20	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	3,000,000.00	3,226,653.90	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	5,000,000.00	5,550,287.00	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	12,000,000.00	13,498,813.20	
中国元合計			359,200,000.00	366,731,665.25 (7,324,584,857)	
ドミニカ ペソ	国債証券	13. 625 DOMINICAN 330203	16,000,000.00	19,802,450.40	
		9. 75 DOMINICAN 260605	32,000,000.00	32,576,000.00	
ドミニカペソ合計			48,000,000.00	52,378,450.40 (136,388,246)	
セルビア ディナール	国債証券	4. 5 SERBIA TREASU 260111	61,000,000.00	60,389,644.98	
		4. 5 SERBIA TREASU 320820	74,000,000.00	65,953,098.66	
		5. 875 SERBIA TREA 280208	50,000,000.00	51,624,005.00	
セルビアディナール合計			185,000,000.00	177,966,748.64	

				(237,076,268)
ルーマニア アレイ	国債証券	2.5 ROMANIA GOVER 271025	4,000,000.00	3,424,013.20
		3.25 ROMANIA GOVE 240429	4,400,000.00	4,296,072.00
		3.25 ROMANIA GOVE 260624	3,200,000.00	2,945,991.58
		3.5 ROMANIA GOVER 251125	1,500,000.00	1,411,863.78
		3.65 ROMANIA GOVE 250728	4,000,000.00	3,815,861.16
		3.65 ROMANIA GOVE 310924	5,500,000.00	4,543,935.00
		3.7 ROMANIA GOVER 241125	4,600,000.00	4,454,224.34
		4.15 ROMANIA GOVE 280126	5,200,000.00	4,741,670.54
		4.15 ROMANIA GOVE 301024	5,000,000.00	4,326,616.80
		4.25 ROMANIA GOVE 360428	3,800,000.00	3,026,168.00
		4.5 ROMANIA GOVER 240617	5,100,000.00	5,019,649.50
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	6,900,000.00	6,737,953.50
		4.75 ROMANIA GOVE 341011	5,200,000.00	4,453,072.00
		4.85 ROMANIA GOVE 260422	4,900,000.00	4,725,290.50
		4.85 ROMANIA GOVE 290725	4,800,000.00	4,420,512.00
		5 ROMANIA GOVERN 290212	6,260,000.00	5,837,606.50
		5.8 ROMANIA GOV 270726	6,800,000.00	6,646,592.00
		6.7 ROMANIA GOVER 320225	5,400,000.00	5,458,763.34
8.25 ROMANIA GOVE 320929	3,700,000.00	4,122,824.90		
8.75 ROMANIA GOVE 281030	2,500,000.00	2,749,896.25		
ルーマニアアレイ合計			92,760,000.00	87,158,576.89 (2,750,445,779)
トルコ リラ	国債証券	10.5 TURKEY GOVT 270811	23,900,000.00	22,250,900.00
		10.6 TURKEY GOVT 260211	9,600,000.00	8,855,961.60
		11 TURKEY GOVT 270224	4,500,000.00	4,126,500.00
		11.7 TURKEY GOVT 301113	14,100,000.00	13,398,525.00
		12.4 TURKEY GOVT 280308	10,100,000.00	8,968,901.00
		12.6 TURKEY GOVT 251001	14,600,000.00	14,600,000.00
		16.9 TURKEY GOVT 260902	19,500,000.00	21,021,000.00
		8 TURKEY GOVT 250312	6,300,000.00	5,651,100.00
		9 TURKEY GOVT 240724	8,300,000.00	7,814,425.10
トルコリラ合計			110,900,000.00	106,687,312.70 (606,378,679)
合計				75,077,835,894 (75,077,835,894)

(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
マレーシアリングット	国債証券 22 銘柄	100.00%	9.65%
タイバーツ	国債証券 24 銘柄	100.00%	9.72%
フィリピンペソ	国債証券 1 銘柄	100.00%	0.07%
インドネシアルピア	国債証券 32 銘柄	100.00%	9.85%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.00%	10.14%
ブラジルリアル	国債証券 10 銘柄	100.00%	10.87%
チリペソ	国債証券 9 銘柄	100.00%	2.41%
チェココルナ	国債証券 10 銘柄	100.00%	5.47%
エジプトポンド	国債証券 11 銘柄	100.00%	0.73%
コロンビアペソ	国債証券 14 銘柄	100.00%	4.51%
ハンガリーフォリント	国債証券 18 銘柄	100.00%	3.21%
ペルーヌエボソル	国債証券 9 銘柄	100.00%	2.28%
ポーランドズロチ	国債証券 15 銘柄	100.00%	7.63%
南アフリカランド	国債証券 11 銘柄	100.00%	8.63%
ウルグアイペソ	国債証券 2 銘柄	100.00%	0.11%
中国元	国債証券 50 銘柄	100.00%	9.76%
ドミニカペソ	国債証券 2 銘柄	100.00%	0.18%
セルビアディナール	国債証券 3 銘柄	100.00%	0.32%
ルーマニアレイ	国債証券 20 銘柄	100.00%	3.66%
トルコリラ	国債証券 9 銘柄	100.00%	0.81%

#### 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。

#### 東証REIT指数マザーファンド

#### 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	11,133,498,412
投資証券	85,867,698,200

未収配当金	397,603,298
未収利息	436,453
前払金	20,225,050
その他未収収益	237,170
差入委託証拠金	111,262,500
流動資産合計	97,530,961,083
資産合計	97,530,961,083
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,572,100
未払金	306,098,594
未払解約金	18,664,449
未払利息	27,983
受入担保金	9,585,854,355
流動負債合計	9,925,217,481
負債合計	9,925,217,481
純資産の部	
元本等	
元本	24,950,627,372
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	62,655,116,230
元本等合計	87,605,743,602
純資産合計	87,605,743,602
負債純資産合計	97,530,961,083

## 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

### (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	19,319,075,748円
期中追加設定元本額	8,381,976,252円
期中一部解約元本額	2,750,424,628円
元本の内訳※	
eMAXIS 国内リートインデックス	4,200,137,311円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,610,000,776円
eMAXIS バランス(波乗り型)	161,542,125円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド	655,176,909円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	382,567,500円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	62,963,668円

オルタナティブ資産セレクション (ラップ向け)	1,020,056,567 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	7,130,566,887 円
つみたて8資産均等バランス	3,410,110,854 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	627,167 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,149,826 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	427,140 円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	3,797,519,894 円
ラップ向けインデックスf 国内リート	445,712,906 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	58,115,393 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	253,980,410 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	2,627,765 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	1,936,093 円
三菱UFJ 国内リートインデックスファンド	21,289,729 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	4,281,487 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	2,964,387 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	22,277,579 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	25,805,203 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	40,510,272 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	169,842,974 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	138,713,770 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	56,132,667 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	11,539,911 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)	113,103 円
MUKAM 3資産インカムバランスファンド (適格機関投資家転売制限付)	359,112,707 円
日本リートインデックスファンドS	208,767,999 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)	36,872,615 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)	36,352,853 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)	36,383,347 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)	36,098,235 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)	36,247,289 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)	36,375,423 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)	35,735,992 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)	35,712,758 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)	36,183,882 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)	36,150,033 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)	41,025,580 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)	40,524,225 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)	41,189,187 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)	40,129,598 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)	41,380,171 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)	43,683,780 円

格機関投資家限定) MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適 格機関投資家限定)	42,265,508 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)	41,745,917 円
合計	24,950,627,372 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。 投資証券	9,079,393,650 円
3. 受益権の総数	24,950,627,372 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、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用しております。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	(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)



投資証券	737,798,679
合計	737,798,679

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[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	不動産投信指数先物取引				
	買建	1,918,822,050	—	1,904,256,000	△14,566,050
	合計	1,918,822,050	—	1,904,256,000	△14,566,050

(注)時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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	3.5112円
(1万口当たり純資産額)	(35,112円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,671	198,849,000	貸付有価証券 189口
	サンケイリアルエステート投資法人	2,634	232,055,400	貸付有価証券 283口
	SOSiLA物流リート投資法人	4,089	542,610,300	貸付有価証券 258口
	東海道リート投資法人	1,367	168,414,400	貸付有価証券

			82 口
日本アコモデーションファンド投資法人	2,839	1,856,706,000	貸付有価証券 384 口
森ヒルズリート投資法人	9,668	1,411,528,000	貸付有価証券 1,331 口
産業ファンド投資法人	12,544	1,924,249,600	貸付有価証券 1,491 口
アドバンス・レジデンス投資法人	8,220	2,877,000,000	貸付有価証券 1,099 口
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,029	1,326,982,900	貸付有価証券 754 口
アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,340	1,742,510,000	貸付有価証券 580 口
G L P 投資法人	27,718	3,985,848,400	貸付有価証券 3,326 口
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,931	1,369,953,500	貸付有価証券 505 口
日本プロロジスリート投資法人	14,296	4,095,804,000	貸付有価証券 1,750 口
星野リゾート・リート投資法人	1,438	890,122,000	貸付有価証券 176 口
One リート投資法人	1,434	345,307,200	貸付有価証券 180 口
イオンリート投資法人	9,438	1,447,789,200	貸付有価証券 1,173 口
ヒューリックリート投資法人	7,692	1,191,490,800	貸付有価証券 931 口
日本リート投資法人	2,670	903,795,000	
積水ハウス・リート投資法人	24,705	2,028,280,500	貸付有価証券 3,402 口
トーセイ・リート投資法人	1,824	239,856,000	貸付有価証券 256 口
ケネディクス商業リート投資法人	3,574	985,709,200	貸付有価証券 425 口
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,027	328,779,400	貸付有価証券 247 口
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,137	254,730,400	貸付有価証券 223 口
野村不動産マスターファンド投資法人	26,586	4,306,932,000	貸付有価証券 3,740 口
いちごホテルリート投資法人	1,362	138,243,000	貸付有価証券 202 口
ラサールロジポート投資法人	10,065	1,539,945,000	貸付有価証券 1,081 口
スターアジア不動産投資法人	10,265	598,449,500	貸付有価証券 1,100 口
マリモ地方創生リート投資法人	1,256	164,912,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,248	1,630,496,000	貸付有価証券 332 口

大江戸温泉リート投資法人	1,327	85,458,800	貸付有価証券 187口
投資法人みらい	9,988	454,953,400	貸付有価証券 1,249口
三菱地所物流リート投資法人	2,825	1,169,550,000	貸付有価証券 230口
CREロジスティクスファンド投資法人	3,522	649,809,000	
ガイマックス・リート投資法人	1,334	150,875,400	貸付有価証券 177口
タカラレーベン不動産投資法人	3,875	364,637,500	貸付有価証券 347口
アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,584	480,614,400	貸付有価証券 365口
日本ビルファンド投資法人	9,591	5,495,643,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	8,431	4,620,188,000	貸付有価証券 1,157口
日本都市ファンド投資法人	41,482	3,936,641,800	貸付有価証券 5,787口
オリックス不動産投資法人	16,381	2,891,246,500	貸付有価証券 2,304口
日本プライムリアルティ投資法人	5,623	1,973,673,000	
NTT都市開発リート投資法人	7,903	1,032,922,100	貸付有価証券 1,045口
東急リアル・エステート投資法人	5,512	1,043,421,600	貸付有価証券 775口
グローバル・ワン不動産投資法人	6,050	662,475,000	貸付有価証券 803口
ユナイテッド・アーバン投資法人	18,391	2,653,821,300	貸付有価証券 2,473口
森トラストリート投資法人	15,302	1,083,381,600	貸付有価証券 2,114口
インヴィンシブル投資法人	36,186	2,055,364,800	
フロンティア不動産投資法人	3,050	1,470,100,000	
平和不動産リート投資法人	5,793	837,088,500	貸付有価証券 720口
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,543	1,754,359,500	貸付有価証券 756口
福岡リート投資法人	4,252	692,650,800	貸付有価証券 598口
ケネディクス・オフィス投資法人	4,784	1,581,112,000	貸付有価証券 716口
いちごオフィスリート投資法人	6,737	595,550,800	貸付有価証券 959口
大和証券オフィス投資法人	1,703	1,018,394,000	貸付有価証券 247口
阪急阪神リート投資法人	3,714	530,730,600	貸付有価証券 522口

スタートプロシード投資法人	1,425	327,892,500	貸付有価証券 180口
大和ハウスリート投資法人	12,393	3,410,553,600	貸付有価証券 1,650口
ジャパン・ホテル・リート投資法人	26,513	1,908,936,000	
大和証券リビング投資法人	11,393	1,289,687,600	貸付有価証券 1,459口
ジャパンエクセレント投資法人	7,542	918,615,600	
合計	501,216	85,867,698,200	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## MUAM G-REIT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	602,789,206
コール・ローン	194,560,522
投資証券	99,323,002,361
未収入金	3,037,480
未収配当金	390,108,186
差入委託証拠金	828,558,094
流動資産合計	101,342,055,849
資産合計	101,342,055,849
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	76,207,423
未払金	70,868,648
未払解約金	191,561,717
未払利息	489
流動負債合計	338,638,277
負債合計	338,638,277
純資産の部	
元本等	
元本	44,563,359,638
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	56,440,057,934
元本等合計	101,003,417,572
純資産合計	101,003,417,572

## 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	35,139,058,758円
期中追加設定元本額	12,615,269,148円
期中一部解約元本額	3,190,968,268円
元本の内訳※	
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	116,158,360円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	104,052,241円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	32,015,084円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	62,398,412円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	28,848,722円
ファンド・マネジャー(海外リート)	440,139円
eMAXIS 先進国リートインデックス	6,382,604,332円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,503,715,992円
eMAXIS バランス(波乗り型)	235,511,348円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	3,334,910,039円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	616,476,888円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	1,526,300,260円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,043,903,531円
つみたて8資産均等バランス	5,301,909,219円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,437,273円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,627,579円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	958,499円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	9,622,843,810円
三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド	93,390,877円
ラップ向けインデックスf 先進国リート	768,501,138円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	91,464,525円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	802,539,817円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	313,539,279円
ラップ向けインデックスf 先進国リート(為替ヘッジあり)	324,260円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	3,944,730円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	34,400,995円

eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	58,856,277 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	92,701,138 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	395,961,007 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	326,684,215 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	128,003,088 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	18,595,646 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)	127,368 円
海外リートインデックスファンドS	517,213,550 円
合計	44,563,359,638 円
2. 受益権の総数	44,563,359,638 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、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、不動産投信指数先物取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[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)	
投資証券		△4,592,774,391
合計		△4,592,774,391

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[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	不動産投信指数先物取引				
	買建	1,789,262,904	—	1,713,231,857	△76,031,047
合計		1,789,262,904	—	1,713,231,857	△76,031,047

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[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	54,510,544	—	54,509,480	△1,064
	ユーロ	33,086,910	—	33,013,840	△73,070
	売建				
	アメリカドル	36,344,606	—	36,440,872	△96,266
	カナダドル	9,035,629	—	9,041,605	△5,976
合計		132,977,689	—	133,005,797	△176,376

(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	2,2665円
(1万口当たり純資産額)	(22,665円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	54,731	737,226.57	
		AGREE REALTY CORP	52,743	3,429,877.29	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	42,082	745,272.22	
		ALEXANDER'S INC	1,131	200,775.12	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	89,100	9,719,028.00	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	8,816	134,355.84	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,861	539,886.88	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	177,811	5,995,786.92	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	152,892	4,722,833.88	
		APARTMENT INCOME REIT CO	84,436	2,840,427.04	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	86,842	692,130.74	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	119,596	1,717,398.56	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	38,034	436,249.98	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,953	56,314.09	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,360	14,574,893.20	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,466	22,986.88	
		BOSTON PROPERTIES INC	81,067	4,174,950.50	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	25,650	100,035.00	



BRANDYWINE REALTY TRUST	96,861	397,130.10	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	170,563	3,542,593.51	
BROADSTONE NET LEASE INC	105,943	1,610,333.60	
BRT APARTMENTS CORP	8,081	154,347.10	
CAMDEN PROPERTY TRUST	60,419	6,395,955.34	
CARETRUST REIT INC	56,295	1,090,997.10	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	12,462	268,182.24	
CENTERSPACE	8,971	520,766.55	
CHATHAM LODGING TRUST	29,966	272,390.94	
CITY OFFICE REIT INC	18,294	94,762.92	
CLIPPER REALTY INC	2,958	16,860.60	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	13,231	418,761.15	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	64,183	1,468,507.04	
COUSINS PROPERTIES INC	87,172	1,790,512.88	
CTO REALTY GROWTH INC	9,484	152,882.08	
CUBESMART	127,150	5,515,767.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	117,278	897,176.70	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	177,000	84,960.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	164,880	17,172,252.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	143,987	285,094.26	
DOUGLAS EMMETT INC	93,795	1,067,387.10	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	202,000	—	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	52,164	724,557.96	
EASTGROUP PROPERTIES INC	25,133	4,147,447.66	
ELME COMMUNITIES	51,661	816,243.80	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	78,964	527,479.52	
EPR PROPERTIES	42,602	1,861,281.38	
EQUINIX INC	52,927	39,489,363.97	
EQUITY COMMONWEALTH	62,302	1,262,861.54	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	99,058	6,465,515.66	
EQUITY RESIDENTIAL	192,988	12,034,731.68	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	84,231	1,929,732.21	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	36,322	7,991,566.44	
EXTRA SPACE STORAGE INC	76,428	10,849,718.88	
FARMLAND PARTNERS INC	29,083	343,179.40	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	41,539	3,742,663.90	

FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,014	3,757,451.26	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	49,250	1,229,280.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	34,251	46,238.85	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	148,643	7,018,922.46	
GETTY REALTY CORP	25,489	841,137.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	24,371	288,552.64	
GLADSTONE LAND CORP	18,797	299,624.18	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	36,267	324,589.65	
GLOBAL NET LEASE INC	60,394	574,346.94	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	215,986	3,915,826.18	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	309,557	5,965,163.39	
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	24,442	139,074.98	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	60,234	1,278,767.82	
HOST HOTELS & RESORTS INC	402,507	6,536,713.68	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	65,609	267,684.72	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	126,945	2,199,956.85	
INDUS REALTY TRUST INC	2,511	168,136.56	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	28,183	80,603.38	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,866	1,119,980.94	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	36,842	842,576.54	
INVITATION HOMES INC	328,983	10,770,903.42	
IRON MOUNTAIN INC	165,036	8,906,992.92	
JBG SMITH PROPERTIES	56,300	764,554.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	384,700	113,486.50	
KILROY REALTY CORP	60,641	1,698,554.41	
KIMCO REALTY CORP	350,811	6,461,938.62	
KITE REALTY GROUP TRUST	124,121	2,569,304.70	
LIFE STORAGE INC	48,154	6,097,741.02	
LTC PROPERTIES INC	24,391	788,073.21	
LXP INDUSTRIAL TRUST	165,578	1,543,186.96	
MACERICH CO/THE	121,973	1,272,178.39	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,011,020	174,906.46	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	338,591	2,938,969.88	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,020	9,615,152.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	45,824	1,549,767.68	
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,037	1,285,399.58	

NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	74,716	466,975.00	
NETSTREIT CORP	34,443	594,486.18	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,000	170,080.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,180	559,886.40	
NNN REIT INC	103,047	4,250,688.75	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	25,363	181,345.45	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	133,179	4,007,356.11	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	9,253	187,743.37	
ORION OFFICE REIT INC	36,842	234,315.12	
PARAMOUNT GROUP INC	86,188	359,403.96	
PARK HOTELS & RESORTS INC	121,485	1,495,480.35	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	70,524	910,464.84	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	66,383	2,137,532.60	
PHYSICIANS REALTY TRUST	134,915	1,818,654.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	73,777	490,617.05	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	20,594	456,157.10	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	8,862	127,878.66	
PRIME US REIT	348,400	73,164.00	
PROLOGIS INC	522,610	61,093,109.00	
PUBLIC STORAGE	89,546	25,393,454.68	
REALTY INCOME CORP	380,991	22,387,031.16	
REGENCY CENTERS CORP	87,085	5,050,930.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	72,391	936,739.54	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	113,723	5,712,306.29	
RLJ LODGING TRUST	88,059	858,575.25	
RPT REALTY	50,900	482,532.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	33,454	2,994,467.54	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	130,968	1,496,964.24	
SAFEHOLD INC	23,857	532,488.24	
SAUL CENTERS INC	8,150	290,140.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	92,844	766,891.44	
SIMON PROPERTY GROUP INC	185,050	19,937,287.00	
SITE CENTERS CORP	103,029	1,274,468.73	
SL GREEN REALTY CORP	37,326	879,027.30	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	79,963	3,052,987.34	
STAG INDUSTRIAL INC	101,969	3,495,497.32	

		STAR HOLDINGS	7,714	102,904.76	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	61,291	372,649.28	
		SUN COMMUNITIES INC	70,405	8,809,777.65	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	119,621	1,150,754.02	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	59,524	1,219,051.52	
		TERRENO REALTY CORP	41,935	2,374,359.70	
		UDR INC	175,109	7,044,635.07	
		UMH PROPERTIES INC	31,957	487,663.82	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,436	343,097.04	
		URBAN EDGE PROPERTIES	64,213	916,319.51	
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	17,559	351,531.18	
		VENTAS INC	226,398	10,067,919.06	
		VERIS RESIDENTIAL INC	45,278	739,842.52	
		VICI PROPERTIES INC	568,320	17,407,641.60	
		VORNADO REALTY TRUST	92,209	1,339,796.77	
		WELLTOWER INC	281,281	21,456,114.68	
		WHITESTONE REIT	27,990	262,546.20	
		WP CAREY INC	121,048	8,024,271.92	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	64,037	751,794.38	
アメリカドル合計			14,579,675	538,069,928.38	(77,207,654,023)
カナダドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	36,000	740,160.00	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	36,990	245,243.70	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	7,600	84,436.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	12,410	738,146.80	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	8,000	130,640.00	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	17,900	53,342.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,880	2,240,395.20	
		CHOICE PROPERTIES REIT	92,687	1,216,980.31	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	30,230	399,338.30	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	29,700	430,353.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	72,000	936,720.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	12,310	152,397.80	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	16,200	45,036.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	58,800	800,856.00	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	17,600	1,291,488.00	

		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	74,409	737,393.19	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	7,700	24,409.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	41,700	504,153.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	30,200	511,286.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	12,300	168,879.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	10,800	171,720.00	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	24,200	194,084.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	66,500	424,935.00	
		PRIMARIS REIT	25,577	312,039.40	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	13,000	67,600.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	81,070	1,490,877.30	
		SLATE GROCERY REIT-CL U	14,400	182,736.00	
		SLATE OFFICE REIT	13,500	25,650.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,700	973,278.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	29,800	68,242.00	
カナダドル合計			982,163	15,362,815.00	(1,673,778,694)
オーストラリアドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	258,313	676,780.06	
		ARENA REIT	193,872	717,326.40	
		BWP TRUST	286,513	1,017,121.15	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	425,249	667,640.93	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	297,354	900,982.62	
		CENTURIA OFFICE REIT	223,021	306,653.87	
		CHARTER HALL GROUP	268,887	2,863,646.55	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	376,657	1,468,962.30	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	292,723	1,045,021.11	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	195,853	554,263.99	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	821,364	410,682.00	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	105,284	275,844.08	
		DEXUS/AU	608,686	4,668,621.62	
		GDI PROPERTY GROUP	256,139	169,051.74	
		GOODMAN GROUP	968,421	19,010,104.23	
		GPT GROUP	1,084,067	4,357,949.34	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	156,679	435,567.62	
		HEALTHCO REIT	240,367	314,880.77	
HMC CAPITAL LTD	137,705	656,852.85			

		HOMECO DAILY NEEDS REIT	888,369	1,008,298.81	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	115,529	363,916.35	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	212,031	803,597.49	
		MIRVAC GROUP	2,218,110	4,879,842.00	
		NATIONAL STORAGE REIT	694,402	1,583,236.56	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	140,944	95,841.92	
		REGION RE LTD	641,141	1,429,744.43	
		RURAL FUNDS GROUP	228,339	384,751.21	
		SCENTRE GROUP	2,937,349	7,343,372.50	
		STOCKLAND	1,338,987	5,369,337.87	
		VICINITY CENTRES	2,189,798	3,919,738.42	
		WAYPOINT REIT	384,457	1,011,121.91	
オーストラリアドル合計			19,186,610	68,710,752.70 (6,580,428,786)	
イギリス ポンド	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	189,691	89,154.77	
		AEW UK REIT PLC	65,842	61,298.90	
		ASSURA PLC	1,641,964	722,464.16	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	418,813	280,185.89	
		BIG YELLOW GROUP PLC	99,083	1,028,481.54	
		BRITISH LAND CO PLC	532,607	1,584,505.82	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	336,153	267,913.94	
		CLS HOLDINGS PLC	90,000	114,300.00	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	219,819	181,130.85	
		DERWENT LONDON PLC	64,143	1,273,238.55	
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	100,700	60,621.40	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	372,068	317,001.93	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	147,127	605,574.73	
		HAMMERSON PLC	2,333,062	557,601.81	
		HELICAL PLC	60,734	157,908.40	
		HOME REIT PLC	398,800	151,743.40	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	246,077	217,039.91	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	421,804	2,360,415.18	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	568,489	919,815.20	
		LXI REIT PLC	989,382	833,554.33	
NEWRIVER REIT PLC	188,335	163,663.11			
PICTON PROPERTY INCOME LTD	276,666	193,942.86			

		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	742,515	679,029.96	
		PRS REIT PLC/THE	310,645	233,605.04	
		REGIONAL REIT LTD	221,335	97,498.06	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,639	1,004,129.94	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	308,300	125,323.95	
		SEGRO PLC	692,587	4,873,042.13	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,105,342	1,243,509.75	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	677,428	483,006.16	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	175,846	84,406.08	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,052,003	1,307,639.72	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	464,477	225,968.06	
		UNITE GROUP PLC/THE	226,563	1,941,644.91	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	260,093	295,465.64	
		WAREHOUSE REIT PLC	260,780	204,190.74	
		WORKSPACE GROUP PLC	78,706	357,640.06	
イギリスポンド合計			16,459,618	25,297,656.88	(4,621,628,935)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	1,129,000	2,969,270.00	
		FORTUNE REIT	855,000	4,702,500.00	
		LINK REIT	1,445,300	63,737,730.00	
		PROSPERITY REIT	760,000	1,292,000.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	635,000	1,828,800.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	1,304,000	2,125,520.00	
香港ドル合計			6,128,300	76,655,820.00	(1,404,334,622)
シンガポ ールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	333,000	399,600.00	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,912,600	5,106,642.00	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,247,974	1,347,811.92	
		CAPITALAND CHINA TRUST	703,900	700,380.50	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,864,432	5,471,065.12	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	469,600	554,128.00	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	246,000	148,830.00	
		EC WORLD REIT	199,400	64,805.00	
		ESR-LOGOS REIT	3,770,568	1,206,581.76	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	549,800	329,880.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	758,400	193,392.00	

		FRASERS CENTREPOINT TRUST	620,400	1,346,268.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,656,566	2,037,576.18	
		KEPPEL DC REIT	758,200	1,569,474.00	
		KEPPEL REIT	1,091,300	949,431.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,007,000	659,585.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,132,700	2,491,940.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,874,300	3,055,109.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,276,500	2,055,165.00	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,306,932	418,218.24	
		PARAGON REIT	599,300	560,345.50	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	207,700	789,260.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	272,500	189,387.50	
		STARHILL GLOBAL REIT	710,000	355,000.00	
		SUNTEC REIT	1,274,200	1,605,492.00	
シンガポールドル合計			26,843,272	33,605,367.72 (3,568,553,998)	
ニュージーランドドル	投資証券	ARGOSY PROPERTY LTD	451,499	496,648.90	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	573,906	1,259,723.67	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	876,670	784,619.65	
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	717,221	910,870.67	
		STRIDE PROPERTY GROUP	293,324	398,920.64	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	276,202	640,788.64	
ニュージーランドドル合計			3,188,822	4,491,572.17 (396,695,654)	
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	42,272	138,018,080.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	12,700	66,675,000.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	96,143	384,572,000.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	34,908	159,704,100.00	
		JR REIT XXVII	87,237	383,842,800.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	18,324	98,949,600.00	
		LOTTE REIT CO LTD	80,098	303,571,420.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	61,664	259,913,760.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	32,547	118,471,080.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	44,672	273,839,360.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	18,100	65,974,500.00	
		SK REITS CO LTD	35,300	182,501,000.00	



韓国ウォン合計			563,965	2,436,032,700.00 (267,476,390)
イスラエル ルシェケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	406,762	684,580.44
		REIT 1 LTD	109,796	1,732,580.88
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	113,370	853,676.10
イスラエルシェケル合計			629,928	3,270,837.42 (129,468,576)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	26,655	1,492,680.00
		AEDIFICA SA-RIGHTS	22,134	15,493.80
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	5,778	29,814.48
		ALTAREA	2,731	275,831.00
		CARE PROPERTY INVEST	19,286	244,932.20
		CARMILA	31,800	428,664.00
		COFINIMMO	17,234	1,189,146.00
		COVIVIO	26,710	1,147,461.60
		CROMWELL REIT EUR	208,700	325,572.00
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	24,838	503,714.64
		GECINA SA	30,532	2,865,428.20
		HAMBORNER REIT AG	37,259	246,654.58
		ICADE	18,221	686,931.70
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	22,501	54,002.40
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	170,569	926,189.67
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	15,340	223,964.00
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	229,201	219,803.75
		KLEPIERRE	110,392	2,405,441.68
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	32,964	176,687.04
		MERCIALYS	41,427	336,801.51
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	188,869	1,429,738.33
		MONTEA NV	7,449	534,838.20
		NSI NV	9,441	182,966.58
		RETAIL ESTATES	6,890	427,869.00
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	60,589	2,762,858.40
		VASTNED RETAIL NV	9,168	178,959.36
WAREHOUSES DE PAUW SCA	86,532	2,154,646.80		
WERELDHAVE NV	24,111	327,186.27		
XIOR STUDENT HOUSING NV	14,342	400,141.80		

ユーロ合計	1,501,663	22,194,418.99 (3,472,982,683)	
合計		99,323,002,361 (99,323,002,361)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 145 銘柄	100.00%	77.73%
カナダドル	投資証券 30 銘柄	100.00%	1.69%
オーストラリアドル	投資証券 31 銘柄	100.00%	6.63%
イギリスポンド	投資証券 37 銘柄	100.00%	4.65%
香港ドル	投資証券 6 銘柄	100.00%	1.41%
シンガポールドル	投資証券 25 銘柄	100.00%	3.59%
ニュージーランドドル	投資証券 6 銘柄	100.00%	0.40%
韓国ウォン	投資証券 12 銘柄	100.00%	0.27%
イスラエルシェケル	投資証券 3 銘柄	100.00%	0.13%
ユーロ	投資証券 29 銘柄	100.00%	3.50%

#### 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。

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」に掲げられているつみたて8資産均等バランスの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、つみたて8資産均等バランスの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。

【つみたて8資産均等バランス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 [ 2023年6月26日現在 ]	第7期中間計算期間末 [ 2023年12月26日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,201,084,834	1,463,978,909
親投資信託受益証券	97,452,318,686	112,706,078,880
未収入金	347,453	46,072,520
流動資産合計	98,653,750,973	114,216,130,309
資産合計	98,653,750,973	114,216,130,309
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	110,443,556	242,340,808
未払受託者報酬	9,482,707	11,712,691
未払委託者報酬	94,826,984	117,126,863
未払利息	3,018	415
その他未払費用	1,706,836	2,108,224
流動負債合計	216,463,101	373,289,001
負債合計	216,463,101	373,289,001
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	68,841,777,700	77,054,244,101
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	29,595,510,172	36,788,597,207
(分配準備積立金)	13,860,681,854	13,267,612,536
元本等合計	98,437,287,872	113,842,841,308
純資産合計	98,437,287,872	113,842,841,308
負債純資産合計	98,653,750,973	114,216,130,309

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期中間計算期間 自 2022年6月28日 至 2022年12月27日	第7期中間計算期間 自 2023年6月27日 至 2023年12月26日
<b>営業収益</b>		
受取利息	583	7,979
有価証券売買等損益	△1,763,392,469	3,626,317,801
営業収益合計	△1,763,391,886	3,626,325,780
<b>営業費用</b>		
支払利息	211,915	249,978
受託者報酬	8,184,076	11,712,691
委託者報酬	81,840,645	117,126,863
その他費用	1,473,070	2,108,224

営業費用合計	91,709,706	131,197,756
営業利益又は営業損失(△)	△1,855,101,592	3,495,128,024
経常利益又は経常損失(△)	△1,855,101,592	3,495,128,024
中間純利益又は中間純損失(△)	△1,855,101,592	3,495,128,024
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(△)	23,310,564	82,325,253
期首剰余金又は期首欠損金(△)	16,216,099,527	29,595,510,172
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,455,435,065	5,173,769,351
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,455,435,065	5,173,769,351
剰余金減少額又は欠損金増加額	467,491,182	1,393,485,087
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	467,491,182	1,393,485,087
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	17,325,631,254	36,788,597,207

### (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6期 [2023年6月26日現在]	第7期中間計算期間末 [2023年12月26日現在]
1. 期首元本額	51,057,799,028円	68,841,777,700円
期中追加設定元本額	21,419,739,926円	11,441,160,420円
期中一部解約元本額	3,635,761,254円	3,228,694,019円
2. 受益権の総数	68,841,777,700口	77,054,244,101口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期中間計算期間 自2022年6月28日 至2022年12月27日	第7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6期 [2023年6月26日現在]	第7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。 (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。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 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	(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6期 [2023年6月26日現在]	第7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	1,4299円	1,4774円
(1万口当たり純資産額)	(14,299円)	(14,774円)

(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



金)	
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 トピックスインドックスファンド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(適格機関投資家限定)	35,980,732円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07(適格機関投資家限定)	94,510,806円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09(適格機関投資家限定)	35,434,968円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11(適格機関投資家限定)	35,501,352円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01(適格機関投資家限定)	35,160,631円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03(適格機関投資家限定)	35,822,253円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05(適格機関投資家限定)	35,950,680円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07(適格機関投資家限定)	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

格機関投資家限定)	
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (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 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  
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

- 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。

(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
(1万口当たり純資産額)	(28,349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	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	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)		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	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)

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	25,046,539,230
コール・ローン	1,527,897,782
株式	527,279,662,418
投資証券	786,975,472
派生商品評価勘定	561,538,212
未収配当金	910,498,515
差入委託証拠金	4,849,296,020
流動資産合計	560,962,407,649
資産合計	560,962,407,649
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,622,986
未払解約金	787,647,352
未払利息	433
流動負債合計	796,270,771
負債合計	796,270,771
純資産の部	
元本等	
元本	167,917,761,171
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	392,248,375,707
元本等合計	560,166,136,878
純資産合計	560,166,136,878
負債純資産合計	560,962,407,649

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。なお、ロシア株式(DR(預託証券)を含みます。以下、同じ。)の評価については、「追加情報」に記載しております。 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。

(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	141,910,940,342円

期中追加設定元本額	36,632,941,006円
期中一部解約元本額	10,626,120,177円
元本の内訳※	
MAXIS全世界株式(オール・カントリー) 上場投信	1,026,081,706円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,715,490,592円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,784,283,507円
eMAXIS バランス(波乗り型)	86,836,082円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	595,066,784円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	8,703,584,928円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	37,893,630,247円
つみたて新興国株式	8,186,395,290円
つみたて8資産均等バランス	4,236,736,530円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	589,159円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,741,483円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,888,660円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	11,562,993,775円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	959,911,728円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	55,084,685,675円
新興国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	2,870,831,638円
つみたて全世界株式	124,455,388円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	931,065,699円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	47,918,887円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	1,193,295,196円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	912,066,949円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	16,540,341,116円
新興国株式インデックスオープン	452,676,012円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,170,224,226円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	160,969,588円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	34,987,542円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	205,165,906円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	213,279,207円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	877,396,003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)	1,055,988,083円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	18,002,222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)	9,393,592円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	54,049,359円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	52,940,703円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	53,411,773円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	47,269,664円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	47,116,272円
合計	167,917,761,171円
2. 受益権の総数	167,917,761,171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	時価で計上しているためその差額はありません。

額	
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	31,455,107,402	—	32,007,881,836	552,774,434
合計		31,455,107,402	—	32,007,881,836	552,774,434

(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	688,899,316	—	689,040,108	140,792
合計		688,899,316	—	689,040,108	140,792

(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。
  - 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。
  - 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。
    - 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 (1万口当たり純資産額)	3,3360円 (33,360円)

(追加情報)

自 2023年6月27日 至 2023年12月26日
<p>当ファンドは、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、「当該株式」）を組み入れております。2022年2月24日に発生したロシアのウクライナ侵攻による当ファンドへの影響は以下の通りです。</p> <p>ロシアが、2022年2月24日に首都キーウを含むウクライナ国内の複数の都市への軍事侵攻に踏み切った以降、期末日時点においてロシア軍とウクライナ軍の戦闘が続いております。</p> <p>2022年2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やSWIFTからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。</p> <p>時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022年3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。2022年3月11日時点の当ファンドにおける当該株式の保有割合は0.55%です。</p> <p>なお、2022年3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。</p> <p>今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。</p>

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年12月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,018,178,158
国債証券	645,238,826,520
地方債証券	41,559,791,002
特殊債券	35,986,640,897
社債券	47,885,941,000
派生商品評価勘定	879,065
未収利息	940,855,254
前払費用	37,966,815
差入委託証拠金	7,538,914
流動資産合計	774,676,617,625
資産合計	774,676,617,625
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	392,805
前受金	1,010,000
未払金	434,852,600
未払解約金	509,665,242
未払利息	856
流動負債合計	945,921,503
負債合計	945,921,503
純資産の部	
元本等	
元本	603,046,524,361
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	170,684,171,761
元本等合計	773,730,696,122
純資産合計	773,730,696,122
負債純資産合計	774,676,617,625

## 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	562,256,036,879円
期中追加設定元本額	76,742,624,669円
期中一部解約元本額	35,952,137,187円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	7,427,833,415円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	10,665,800,691円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	2,726,166,718円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	56,402,778,235円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	101,608,558,904円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	32,107,927,108円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	207,354,499円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	186,227,255円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,868,601,438円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,910,515,309円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	4,295,898,271円
eMAXIS バランス(波乗り型)	165,656,356円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	16,719,254,654円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	41,881,697,734円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	10,713,917,884円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	4,864,927,705円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	2,191,718,107円

eMAXIS Slim 国内債券インデックス	16,636,295,671円
国内債券セレクション (ラップ向け)	10,067,507,654円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	20,959,385,113円
つみたて8資産均等バランス	10,220,916,070円
つみたて4資産均等バランス	3,776,516,797円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	17,997,391円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	13,722,186円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	347,411円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	5,950,984,616円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	2,582,471,442円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	1,007,809,842円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	6,946,088,158円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	6,577,725,772円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	3,950,756,426円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	728,940,999円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	1,310,163,242円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	1,667,056,931円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	330,625,985円
ラップ向けインデックスf 国内債券	6,085,174,624円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	2,204,333,840円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,284,828,803円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	7,099,806円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	2,122,894円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	129,703,024円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	177,956,270円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	78,887,430円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,518,353,903円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,835,485,789円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	1,067,265,346円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	2,161,133,810円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	111,600,244円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	44,196,680円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	5,966,949,888円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	1,726円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	26,415,312円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	8,992,209,469円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	665,924,893円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,475,427,204円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	117,304,619,562円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	454,712,623円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,521,746円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	293,333円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,310,442,492円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,490,890,163円

MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	3,019,129,541 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	505,798,345 円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	13,082,778,585 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	1,859,395,378 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,054,382 円
日本債券インデックスファンドS	4,316,648,108 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	429,832,474 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	424,280,144 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	424,729,389 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	421,626,267 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	419,477,595 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	420,955,442 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	413,671,752 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	416,234,104 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	418,690,273 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	416,840,490 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	462,440,331 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	469,323,041 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	477,586,919 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	478,244,702 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	476,937,873 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	490,248,647 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	476,919,903 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	477,769,455 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	18,184,141 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	22,527,951 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,132,087 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	9,796,273 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	17,603,378 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	43,665,322 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	8,936,127 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	27,416,825 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,301,068,527 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,214,118,713 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,627,103,549 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド	2,872,446,522 円



(成長型) 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,991,214,943 円
合計	603,046,524,361 円
2. 受益権の総数	603,046,524,361 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	(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

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	585,430,000	—	585,920,000	490,000
	合計	585,430,000	—	585,920,000	490,000

(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ぬ。

※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ぬ。

(1口当たり情報)

	[2023年12月26日現在]
1口当たり純資産額	1.2830 円
(1万口当たり純資産額)	(12,830 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
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	(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)

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)

新興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	1,970,578,187
コール・ローン	60,380,828
国債証券	82,045,079,595
派生商品評価勘定	24,300
未収入金	26,430,072
未収利息	992,420,831
前払費用	127,088,000
流動資産合計	85,222,001,813
資産合計	85,222,001,813
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,340
未払金	30,744,920
未払解約金	87,460,224
未払利息	17
流動負債合計	118,261,501
負債合計	118,261,501
純資産の部	
元本等	
元本	49,180,030,663
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	35,923,709,649
元本等合計	85,103,740,312
純資産合計	85,103,740,312
負債純資産合計	85,222,001,813

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	46,015,699,639円
期中追加設定元本額	4,064,031,002円
期中一部解約元本額	899,699,978円
元本の内訳※	
eMAXIS バランス (8資産均等型)	3,470,250,581円
eMAXIS バランス (波乗り型)	314,392,275円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1,156,243,699円
海外債券セレクション (ラップ向け)	521,700,608円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	16,904,236,500円
つみたて8資産均等バランス	8,245,147,456円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,527,554円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,869,048円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,544,778円
ラップ向けインデックスf 新興国債券	2,156,102,563円
eMAXIS 新興国債券インデックス	3,127,096,090円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	11,993,709,253円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	90,525,734円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	531,443,770円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	414,132,035円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	196,665,650円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	6,099,084円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	10,364,781円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	34,979,204円
合計	49,180,030,663円
2. 受益権の総数	49,180,030,663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	(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  
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				
	メキシコペソ	8,343,500	—	8,373,800	△30,300
	ハンガリーフォリント	10,244,010	—	10,261,440	△17,430
	南アフリカランド	5,796,375	—	5,772,075	24,300
	ルーマニアレイ	9,442,200	—	9,450,810	△8,610
合計		33,826,085	—	33,858,125	△32,040

(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	1.7305円
(1万口当たり純資産額)	(17,305円)

東証REIT指数マザーファンド

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	10,693,130,237
投資証券	96,222,904,350



未収入金	63,118,630
未収配当金	453,584,126
未収利息	78,734
前払金	63,458,330
その他未収収益	231,180
差入委託証拠金	109,462,181
流動資産合計	107,605,967,768
資産合計	107,605,967,768
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,886,430
未払金	181,359,397
未払解約金	95,907,538
未払利息	3,035
受入担保金	9,142,207,987
流動負債合計	9,482,364,387
負債合計	9,482,364,387
純資産の部	
元本等	
元本	28,593,001,470
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	69,530,601,911
元本等合計	98,123,603,381
純資産合計	98,123,603,381
負債純資産合計	107,605,967,768

## 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

### (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	24,950,627,372円
期中追加設定元本額	4,850,673,087円
期中一部解約元本額	1,208,298,989円
元本の内訳※	
eMAXIS 国内リートインデックス	4,222,433,195円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,695,599,070円
eMAXIS バランス(波乗り型)	155,326,948円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド	698,936,339円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	424,916,319円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	86,335,598円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	1,123,095,066円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	8,267,305,598円
つみたて8資産均等バランス	4,079,392,684円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	750,907円

eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,441,700円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	514,515円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	4,319,170,195円
ラップ向けインデックスf 国内リート	507,228,704円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	104,487,466円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	785,212,053円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	105,723,123円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	6,565,832円
三菱UFJ 国内リートインデックスファンド	33,689,953円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	9,961,707円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	2,964,387円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	22,277,579円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	27,536,941円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	44,706,878円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	195,437,910円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	163,496,059円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	65,067,434円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	12,854,751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)	243,749円
MUKAM 3資産インカムバランスファンド (適格機関投資家転売制限付)	369,183,368円
日本リートインデックスファンドS	367,089,049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)	36,872,615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)	36,352,853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)	36,383,347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)	36,098,235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)	36,247,289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)	36,375,423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)	35,735,992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)	35,712,758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)	36,183,882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)	36,150,033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)	41,025,580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)	40,524,225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)	41,189,187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)	40,129,598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)	41,380,171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)	43,683,780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)	42,265,508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)	41,745,917円

格機関投資家限定) 合計	28,593,001,470 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。 投資証券	8,591,653,450 円
3. 受益権の総数	28,593,001,470 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

投資証券関連

[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	不動産投信指数先物取引 買建	2,078,373,830	—	2,015,494,000	△62,879,830
合計		2,078,373,830	—	2,015,494,000	△62,879,830

(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	3.4317 円
(1万口当たり純資産額)	(34,317 円)

MUAM G-REIT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	1,014,709,216
コール・ローン	36,175,861
投資証券	113,677,009,938
派生商品評価勘定	20,675,716
未収入金	16,103
未収配当金	383,096,720
差入委託証拠金	918,203,159
流動資産合計	116,049,886,713
資産合計	116,049,886,713
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	187,703
未払金	17,781,474
未払解約金	227,333,440
未払利息	10
流動負債合計	245,302,627
負債合計	245,302,627
純資産の部	
元本等	
元本	45,667,548,312
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	70,137,035,774
元本等合計	115,804,584,086
純資産合計	115,804,584,086
負債純資産合計	116,049,886,713

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(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	44,563,359,638 円
期中追加設定元本額	4,948,287,725 円
期中一部解約元本額	3,844,099,051 円
元本の内訳※	
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	108,538,894 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	96,143,139 円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	29,997,986 円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	56,654,312 円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	25,677,994 円
eMAXIS 先進国リートインデックス	6,029,085,008 円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,373,653,134 円
eMAXIS バランス(波乗り型)	214,979,729 円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	3,264,618,989 円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	635,154,765 円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	1,590,538,506 円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,626,531,437 円
つみたて8資産均等バランス	5,655,527,923 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,591,598 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,074,028 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,062,095 円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	10,020,020,109 円
三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド	102,074,957 円
ラップ向けインデックスf 先進国リート	868,221,416 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	64,670,216 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	777,967,410 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	300,321,949 円
ラップ向けインデックスf 先進国リート(為替ヘッジあり)	297,659 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	3,944,730 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	34,400,995 円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	57,134,173 円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	93,042,069 円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	417,372,507 円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	341,028,909 円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	135,291,935 円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	19,214,985 円
マルチアセット運用戦略ファンド(適格機関投資家限定)	151,675 円
海外リートインデックスファンドS	719,563,081 円
合計	45,667,548,312 円
2. 受益権の総数	45,667,548,312 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	<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</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	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)  
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  
投資証券関連

[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	不動産投信指数先物取引 買建	2,102,400,616	—	2,122,941,558	20,540,942
合計		2,102,400,616	—	2,122,941,558	20,540,942

(注) 時価の算定方法

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

通貨関連

[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	191,978,254	—	192,032,234	△53,980
	カナダドル	3,327,958	—	3,326,098	1,860
	オーストラリアドル	7,728,568	—	7,742,784	△14,216
	イギリスポンド	3,988,820	—	3,975,413	13,407
合計		207,023,600	—	207,076,529	△52,929

(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	2.5358円
(1万口当たり純資産額)	(25,358円)

2【ファンドの現況】

【つみたて8資産均等バランス】

【純資産額計算書】

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	115,739,219,973
II 負債総額	182,717,048
III 純資産総額 (I - II)	115,556,502,925
IV 発行済口数	77,367,454,178口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.4936
(10,000口当たり)	(14,936)

(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)

新興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	578,081,828,083
II 負債総額	284,020,666
III 純資産総額 (I - II)	577,797,807,417
IV 発行済口数	168,916,701,836口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.4206
(10,000口当たり)	(34,206)

日本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	782,836,626,946
II 負債総額	6,304,724,657
III 純資産総額 (I - II)	776,531,902,289
IV 発行済口数	605,303,833,833口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.2829
(10,000口当たり)	(12,829)

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)

新興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	85,379,989,494
II 負債総額	41,072,108
III 純資産総額 (I - II)	85,338,917,386
IV 発行済口数	49,247,481,247口
V 1口当たり純資産価額 (Ⅲ/Ⅳ)	1.7329
(10,000口当たり)	(17,329)

東証REIT指数マザーファンド

純資産額計算書

2023年12月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	110,810,909,123
II 負債総額	9,593,438,752
III 純資産総額 (I - II)	101,217,470,371
IV 発行済口数	28,741,009,134口
V 1口当たり純資産価額 (Ⅲ/Ⅳ)	3.5217
(10,000口当たり)	(35,217)

MUAM G-REIT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	117,777,244,339
II 負債総額	273,586,968
III 純資産総額 (I - II)	117,503,657,371
IV 発行済口数	45,577,584,293口
V 1口当たり純資産価額 (Ⅲ/Ⅳ)	2.5781
(10,000口当たり)	(25,781)

#### 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、解約請求の受付け、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まいります。



2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間財務諸表  
(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間  
(2023 年 9 月 30 日現在)

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

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間  
(2023 年 9 月 30 日現在)

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

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間  
(2023 年 9 月 30 日現在)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

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

（単位：千円）

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

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

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

## [重要な会計方針]

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

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



5. 収益および費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 投資顧問料

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

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

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

※2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

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

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

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

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

(リース取引関係)

第 39 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日現在)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

(金融商品関係)

第 39 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注 2) 市場価格のない株式等

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

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

金銭の信託

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

(有価証券関係)

第 39 期中間会計期間（2023 年 9 月 30 日現在）

### 1. 子会社及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

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

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

## 3. 減損処理を行った有価証券

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

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

### (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの  
当該資産除去債務の総額の増減

	第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
期首残高	—
有形固定資産の取得に伴う増加	704,072 千円
時の経過による調整額	—
中間期末残高	704,072 千円

### (収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

### (セグメント情報等)

#### [セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### [関連情報]

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

#### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2. 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

##### (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

#### (1 株当たり情報)

1 株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)
1 株当たり純資産額	418,897.70 円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額 (千円)	88,630,795
普通株式に係る中間期末の純資産額 (千円)	88,630,795
1 株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数 (株)	211,581

1 株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
1 株当たり中間純利益金額	25,548.29 円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額 (千円)	5,405,533
普通株主に帰属しない金額 (千円)	—
普通株式に係る中間純利益金額 (千円)	5,405,533
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581

(注) 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

#### (重要な後発事象)

##### 共通支配下の取引等

当社は 2023 年 7 月 31 日開催の取締役会において、三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社(旧商号：MU 投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を 2023 年 10 月 1 日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社は、2023 年 10 月 1 日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023 年 10 月 1 日付で当社は「三菱UFJ アセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

#### (1) 取引の概要

##### ①被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

##### ②企業結合日

2023 年 10 月 1 日

##### ③企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

##### ④結合後企業の名称

分割会社：三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱UFJ アセットマネジメント株式会社

##### ⑤企業結合を行う主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱UFJ アセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

#### (2) 実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準 (企業会計基準第 21 号 2019 年 1 月 16 日)」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針 (企業会計基準適用指針第 10 号 2019 年 1 月 16 日)」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

#### 5 【その他】

##### ①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### ②訴訟事件その他重要事項

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

つみたて8資産均等バランス

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社



## つみたて8資産均等バランス

### 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、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）およびS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の各対象インデックスを12.5%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果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、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAMG-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

##### (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、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAMG-REITマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として対象インデックスに採用されている日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を合成ベンチマークの変動率に連動させることを目的とした運用を行います。
- ② 国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ12.5%とします。
- ③ 合成ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
- ④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 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は、信託財産の純資産総額の50%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スワップ取引を行うことができます。
- ⑧金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。
- ⑨外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑩デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、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。
- ⑪外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

### 3. 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つた利益については、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  
『つみたて8資産均等バランス』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31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第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52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28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「外貨建価値証券」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30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第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(投資対象国・地域における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受付

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取りを取消することができます。

- 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39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦ 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、新興国株式インデックスマザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMGR-EIT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、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50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株式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。

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。

⑦ 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。

- ⑧ 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31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、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条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- 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条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

- 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、委託者及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53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

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、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図)

第24条 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物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、為替先渡取引および直物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、為替先渡取引および直物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または価格情報会社の提供する価額で評価する

ものとしします。

- ④ 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物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、投資信託証券(金融商品取引所に上場されているものに限り、以下本条において同じ。)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します。
2. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとしします。
3. 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します。

(有価証券の空売りの指図範囲)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第28条の規定により借り入れた有価証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、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとしします。

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内としします。

- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとしします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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します。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内としします。

- 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有価証券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

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

(外国為替予約取引の指図)

第30条 委託者は、信託財産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。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、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。

(信託業務の委託等)

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の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32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33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

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34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、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37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金立替え）

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株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39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2018年6月25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40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- 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41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立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。）に相当する金額は、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42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の22の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の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43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44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45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47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45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45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こと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47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46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47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ます。
- 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ます。
- 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（投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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48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48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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 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49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53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50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53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51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52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53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53条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- 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54条 第48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47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。

(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った場合には、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45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。

第5条 第24条に規定する「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、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の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

信託契約締結日 2017年8月16日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47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
- 香港取引所の休業日
- 香港の銀行の休業日
- オーストラリア証券取引所の休業日
- シドニーの銀行の休業日

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント