

投資信託説明書  
(請求目論見書)

使用開始日 2024.2.10

# 三菱UFJ <DC>インデックス・ ライフ・バランス ファンド(積極型)

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

この目論見書により行う「三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2023年8月10日に関東財務局長に提出しており、2023年8月11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】	41
第3【ファンドの経理状況】	46
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	275
第三部【委託会社等の情報】	276
第1【委託会社等の概況】	276
約款	320

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）  
（「ファンド」といいます。）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### (3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

1円以上1円単位

### (7)【申込期間】

2023年8月11日から2024年8月9日まで

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

### (8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みに限り取り扱うものとします。

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

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

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を含む) 日本 北米 欧州	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ ファンズ	あり ( ) なし	日経225 TOPIX その他 (合成ベンチ マーク)	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ( )	年12回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ( )	オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (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)))						
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。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成 12 年政令 480 号）第 12 条第 1 号および第 2 号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和 32 年法律第 26 号）第 9 条の 4 の 2 に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

#### 属性区分の定義

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

		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（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。
	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

内外の債券・株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を図るため各資産の指数を独自に合成した指数をベンチマークとし、当該ベンチマークと同程度の投資成果をあげることがをめざします。

## ファンドの特色



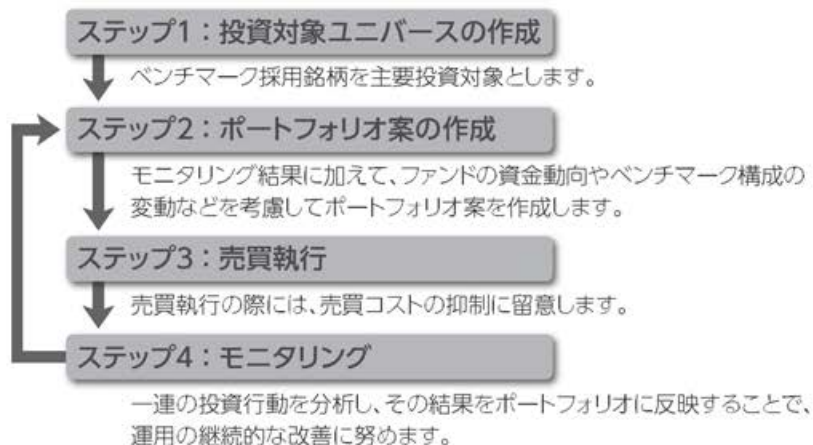
主として、日本債券インデックスマザーファンド、TOPIXマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンドおよび外国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、内外の主要金融資産にバランスよく分散投資を行います。

マザーファンドの基本方針は以下の通りです。

ファンド名	基本方針
日本債券インデックスマザーファンド	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。
TOPIXマザーファンド	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国債券インデックスマザーファンド	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。
外国株式インデックスマザーファンド	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。

マザーファンドの債券や株式の実質投資比率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。

マザーファンドの運用プロセスは以下の通りです。



❗ 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。

📄 「運用担当に係る事項」については、委託会社のホームページをご覧ください。  
<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

## 特色2

国内債券27%、国内株式40%、外国債券5%、外国株式25%および短期金融商品3%の比率で配分した基本ポートフォリオのもと、個別資産毎におけるパッシブ運用を行い、委託会社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマーク<sup>(注1)</sup>として、ベンチマークと同程度の投資成果をあげることをめざします。

委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、NOMURA-BPI総合インデックス27%、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)40%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)5%、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)25%、無担保コール翌日物レート(短資協会発表)の平均値3%を合成したものです。

資産配分については、三菱UFJ信託銀行株式会社からの投資助言を受けることとします。<sup>(注2)</sup>

長期的な運用環境の動向等により、基本ポートフォリオを見直す場合があります。

(注1)ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

(注2)投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

## 特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

実質的な組入外貨建資産については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。

### ■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、内外の債券・株式へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



### ■主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。
- ・同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%未満とします。
- ・デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

## ■ 分配方針

- ・年1回の決算時(5月12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。

## 指数について

NOMURA-BPI総合インデックスとは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の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。

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。

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。

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。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

2001年12月19日

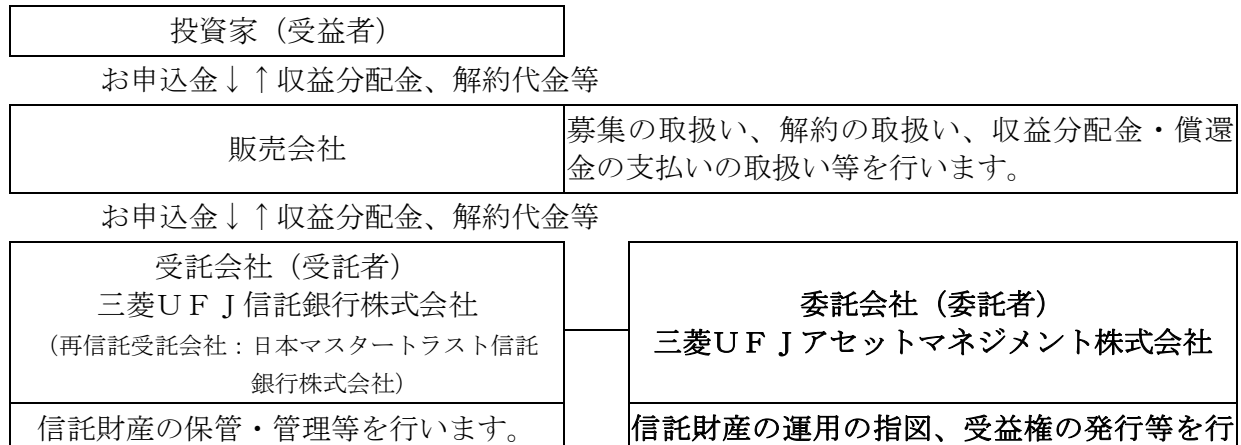
設定日、信託契約締結、運用開始

2005年10月1日

ファンドの委託会社としての業務をユーエフジェイパートナーズ投信株式会社から三菱UFJ投信株式会社に承継  
名称を「UFJパートナーズ<DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)」から「三菱UFJ<DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(積極型)」に変更

## (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



	います。
投資↓↑損益	
マザーファンド	
投資↓↑損益	
有価証券等	

## 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11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】

日本債券インデックスマザーファンド受益証券、TOPIX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および外国株式インデックス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、内外の株式・公社債に直接投資することがあります。

主として、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、TOPIX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および外国株式インデックスマザーファンド受益証券へ

の投資を通して、国内債券・国内株式・外国債券・外国株式への分散投資を行います。  
国内債券 27%、国内株式 40%、外国債券 5%、外国株式 25%および短期金融商品 3%の比率で配分した基本ポートフォリオのもと、個別資産毎におけるパッシブ運用を行い、委託会社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマークとして、ベンチマークと同程度の投資成果をあげることをめざします。

長期的な運用環境の動向等により、基本ポートフォリオを見直す場合があります。

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。

株式以外の資産への実質投資割合（信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と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総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合）は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。

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。

## (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

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日本債券インデックスマザーファンド、TOPIXマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンドおよび外国株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および

#### 新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から 12. の証券または証書の性質を有するもの
  14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
  16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りします。）
  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. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします。）
  22. 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。）
  23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  24. 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、1. から23. に該当するものを除きます。）
  25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- 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. 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5. に該当するものを除きます。）
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの

#### 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>

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。

## 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。

## 外国債券インデックスマザーファンド

### (基本方針)

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

### (運用方法)

#### ①投資対象

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

#### ②投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### (投資制限)

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引を行うことができます。
- ⑩外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑪デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑫外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

## 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、M S C I 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

M S C I 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。

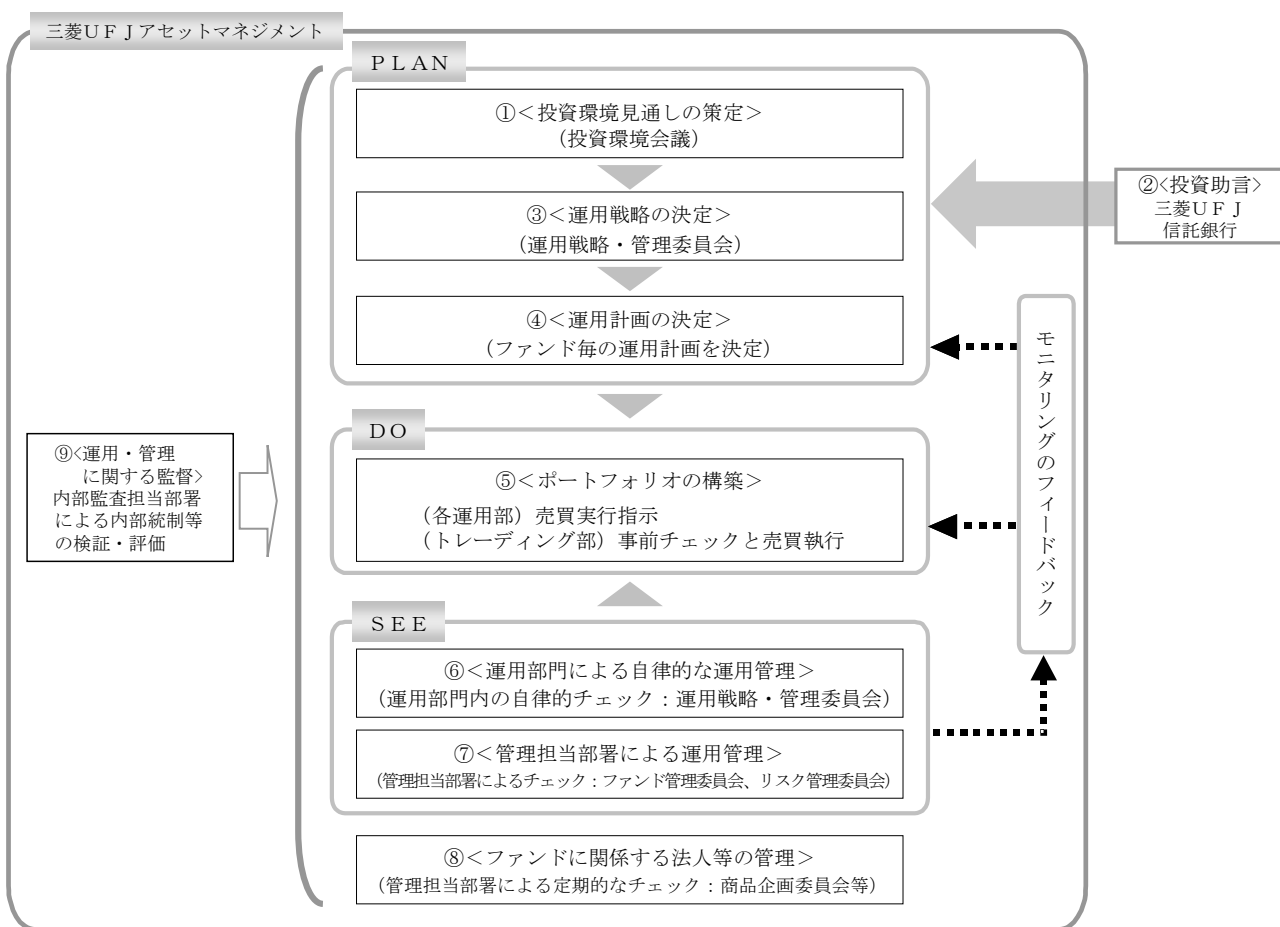


- ・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を 100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
  - ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
- 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(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。

(3) 【運用体制】



①投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投

資環境見通しを策定します。

②投資助言

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

③運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。

④運用計画の決定

③で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

⑤ポートフォリオの構築

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

⑥運用部門による自律的な運用管理

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

⑦管理担当部署による運用管理

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

⑧ファンドに係る法人等の管理

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

⑨運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

③収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5)【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①株式

a. 委託会社は、信託財産に属する株式（株式を組入可能な投資信託証券、新株引受権証券および新

株予約権証券を含みます。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 80 以上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外貨建資産

- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（外貨建資産を組入可能な投資信託証券を含みます。以下②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との合計額が信託財産の純資産総額の 100 分の 45 以上となる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により 100 分の 45 以上となった場合には、速やかにこれを調整します。
- 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。

#### ③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。

#### ④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（マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。）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。

#### ⑤同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

#### ⑥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。

#### ⑦スワップ取引

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

- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### ⑧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（⑥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。）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

#### ⑨外国為替予約取引

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

#### ⑩有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

#### ⑪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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 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。

#### ⑫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。

#### ⑬有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 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。)

#### ①価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### ②為替変動リスク

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

は、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

### ③信用リスク

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

### ④流動性リスク

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

## ※留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、当ファンドが損失を被る可能性があります。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要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当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。当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の方が小さかった場合も同様です。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。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- 当ファンドは、ベンチマークと同程度の投資成果をあげ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。

## (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。

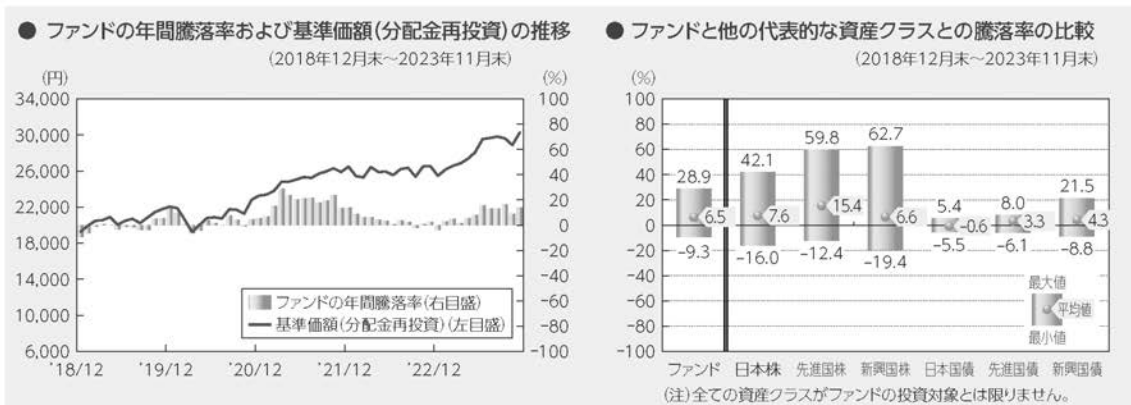
③内部監査担当部署

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に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
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いません。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。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.03%）が差し引かれます。

※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0.407%（税抜0.37%）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	0.2%	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	0.12%	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	0.05%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

##### (4) 【その他の手数料等】

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

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

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付

運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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。

上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

##### 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（配当控除の適用があります）・申告分離課税を選択することもできます。

###### 2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

##### ②法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として 15.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

#### ◇個別元本について

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

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行う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 11 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。

## 5 【運用状況】

### 【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）【投資状況】

2023 年 11 月 30 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	9,186,153,683	97.00
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	284,013,073	3.00
純資産総額		9,470,166,756	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 11 月 30 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	TOPIXマザーファンド	1,315,601,001	2.5263	3,323,602,809	2.8784	3,786,825,921	39.99
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	2,011,826,505	1.3053	2,626,037,137	1.2776	2,570,309,542	27.14
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	405,033,851	4.9408	2,001,191,252	5.8148	2,355,190,836	24.87
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	187,165,186	2.3484	439,545,792	2.5316	473,827,384	5.00

（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 11 月 30 日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.00
合計	97.00

（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11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13計算期間末日 (2014年5月12日)	3,985,789,295	3,985,789,295	15,107	15,107
第14計算期間末日 (2015年5月12日)	4,915,177,130	4,915,177,130	18,591	18,591
第15計算期間末日 (2016年5月12日)	4,597,329,193	4,597,329,193	17,102	17,102
第16計算期間末日 (2017年5月12日)	5,266,579,410	5,266,579,410	19,314	19,314
第17計算期間末日 (2018年5月14日)	6,114,874,188	6,114,874,188	21,064	21,064
第18計算期間末日 (2019年5月13日)	6,110,048,430	6,110,048,430	20,226	20,226
第19計算期間末日 (2020年5月12日)	6,056,586,806	6,056,586,806	19,998	19,998
第20計算期間末日 (2021年5月12日)	7,858,814,292	7,858,814,292	24,528	24,528
第21計算期間末日 (2022年5月12日)	7,449,887,062	7,449,887,062	25,046	25,046
第22計算期間末日 (2023年5月12日)	8,413,119,365	8,413,119,365	27,461	27,461
2022年11月末日	7,981,073,613	—	26,414	—
12月末日	7,729,073,508	—	25,361	—
2023年1月末日	7,964,428,226	—	26,035	—
2月末日	8,047,510,380	—	26,451	—
3月末日	8,211,543,174	—	26,721	—
4月末日	8,360,083,156	—	27,219	—
5月末日	8,612,000,023	—	27,951	—
6月末日	9,112,524,588	—	29,405	—
7月末日	9,234,793,097	—	29,530	—
8月末日	9,282,917,788	—	29,683	—
9月末日	9,278,628,715	—	29,482	—
10月末日	9,073,842,309	—	28,749	—
11月末日	9,470,166,756	—	30,140	—

②【分配の推移】

	1 万口当たりの分配金
第 13 計算期間	0 円
第 14 計算期間	0 円
第 15 計算期間	0 円
第 16 計算期間	0 円
第 17 計算期間	0 円
第 18 計算期間	0 円
第 19 計算期間	0 円
第 20 計算期間	0 円
第 21 計算期間	0 円
第 22 計算期間	0 円

### ③ 【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 13 計算期間	3.21
第 14 計算期間	23.06
第 15 計算期間	△8.00
第 16 計算期間	12.93
第 17 計算期間	9.06
第 18 計算期間	△3.97
第 19 計算期間	△1.12
第 20 計算期間	22.65
第 21 計算期間	2.11
第 22 計算期間	9.64
第 23 中間計算期間	8.15

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配金の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配金の額）を控除した額を当該基準価額（分配金の額）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 13 計算期間	539,147,482	467,757,667	2,638,439,007
第 14 計算期間	749,070,498	743,723,036	2,643,786,469
第 15 計算期間	432,999,552	388,526,540	2,688,259,481
第 16 計算期間	454,146,257	415,607,930	2,726,797,808
第 17 計算期間	553,502,152	377,293,404	2,903,006,556
第 18 計算期間	436,172,848	318,229,329	3,020,950,075
第 19 計算期間	524,064,538	516,351,595	3,028,663,018
第 20 計算期間	636,876,195	461,517,148	3,204,022,065
第 21 計算期間	633,640,786	863,145,472	2,974,517,379
第 22 計算期間	423,114,832	333,923,056	3,063,709,155

第 23 中間計算期間	268, 106, 350	176, 773, 258	3, 155, 042, 247
-------------	---------------	---------------	------------------

(参考)

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

2023 年 11 月 30 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	649, 091, 590, 530	84. 30
地方債証券	日本	41, 401, 451, 710	5. 38
特殊債券	日本	35, 178, 617, 255	4. 57
社債券	日本	47, 011, 754, 000	6. 11
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	△2, 665, 178, 638	△0. 36
純資産総額		770, 018, 234, 857	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 11 月 30 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	292, 920, 000	0. 04

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

2023 年 11 月 30 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 3 5 9 回利付国債 (10 年)	8, 150, 000, 000	99. 39	8, 100, 848, 000	98. 21	8, 004, 115, 000	0. 100000	2030/6/20	1. 04
日本	国債証券	第 3 6 5 回利付国債 (10 年)	8, 080, 000, 000	98. 12	7, 928, 654, 600	96. 60	7, 805, 603, 200	0. 100000	2031/12/20	1. 01
日本	国債証券	第 3 6 3 回利付国債 (10 年)	7, 920, 000, 000	98. 45	7, 797, 404, 400	97. 16	7, 695, 072, 000	0. 100000	2031/6/20	1. 00
日本	国債証券	第 3 5 6 回利付国債 (10 年)	7, 740, 000, 000	99. 65	7, 713, 526, 400	98. 80	7, 647, 274, 800	0. 100000	2029/9/20	0. 99
日本	国債証券	第 3 6 4 回利付国債 (10 年)	7, 220, 000, 000	98. 38	7, 103, 699, 600	96. 85	6, 992, 570, 000	0. 100000	2031/9/20	0. 91
日本	国債証券	第 3 6 8 回利付国債 (10 年)	7, 080, 000, 000	98. 12	6, 947, 028, 500	96. 65	6, 843, 174, 000	0. 200000	2032/9/20	0. 89
日本	国債証券	第 3 5 8 回利付国債	6, 790, 000, 000	99. 55	6, 760, 056, 100	98. 42	6, 683, 261, 200	0. 100000	2030/3/20	0. 87

		債(10年)								
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	6,670,000,000	98.88	6,595,743,400	97.94	6,533,131,600	0.100000	2030/9/20	0.85
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	99.59	6,503,553,500	0.100000	2028/3/20	0.84
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	6,640,000,000	98.74	6,556,616,000	97.42	6,468,887,200	0.100000	2031/3/20	0.84
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	6,550,000,000	99.50	6,517,307,000	98.63	6,460,592,500	0.100000	2029/12/20	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	100.17	6,420,961,100	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	100.17	6,390,846,000	0.100000	2025/6/20	0.83
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	6,340,000,000	100.43	6,367,388,800	100.04	6,342,853,000	0.100000	2026/12/20	0.82
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,370,000,000	100.86	6,424,931,800	98.81	6,294,451,800	0.500000	2033/3/20	0.82
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	99.06	6,161,532,000	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	99.98	6,128,957,900	0.100000	2027/3/20	0.80
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	99.71	6,072,826,200	0.100000	2027/12/20	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	97.67	6,065,555,400	0.100000	2030/12/20	0.79
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	6,040,000,000	99.95	6,037,523,600	99.57	6,014,330,000	0.005000	2027/6/20	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	99.01	6,010,089,100	0.500000	2032/12/20	0.78
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	99.82	5,720,201,700	0.100000	2027/9/20	0.74
日本	国債証券	第162回利付国債(5年)	5,690,000,000	99.60	5,667,593,500	100.23	5,703,485,300	0.300000	2028/9/20	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	99.91	5,694,927,000	0.100000	2027/6/20	0.74
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,550,000,000	100.08	5,554,503,000	99.83	5,540,676,000	0.005000	2026/9/20	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	100.16	5,388,715,600	0.100000	2025/3/20	0.70
日本	国債証券	第163回利付国債(5年)	5,300,000,000	100.66	5,335,086,000	100.68	5,336,411,000	0.400000	2028/9/20	0.69
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	96.94	5,225,227,700	0.200000	2032/6/20	0.68
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	5,310,000,000	97.41	5,172,484,700	97.70	5,188,241,700	0.400000	2033/6/20	0.67
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	5,157,879,500	0.100000	2025/12/20	0.67

(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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.30
地方債証券	5.38
特殊債券	4.57
社債券	6.11

合計	100.35
----	--------

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

2023年11月30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23年12月限	買建	2	円	290,661,870	292,920,000	0.04

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

#### TOPIXマザーファンド

#### 投資状況

2023年11月30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	1,150,093,270,300	98.78
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	14,161,699,038	1.22
純資産総額		1,164,254,969,338	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11月30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	12,046,320,000	1.03

(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11月30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	18,716,900	1,894.95	35,467,706,372	2,794.50	52,304,377,050	4.49
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,411,200	11,712.03	28,240,065,754	12,820.00	30,911,584,000	2.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	21,024,800	875.97	18,417,126,961	1,255.00	26,386,124,000	2.27



日本	株式	キーエンス	電気機器	341,000	62,230.29	21,220,531,791	63,350.00	21,602,350,000	1.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	101,690,800	161.16	16,389,324,841	173.10	17,602,677,480	1.51
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	721,400	16,896.19	12,188,912,651	24,025.00	17,331,635,000	1.49
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,386,900	5,386.03	12,855,937,010	7,258.00	17,324,120,200	1.49
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,654,600	7,357.60	12,173,897,677	10,285.00	17,017,561,000	1.46
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,382,100	5,147.85	12,262,700,279	6,886.00	16,403,140,600	1.41
日本	株式	信越化学工業	化学	3,096,200	4,275.40	13,237,520,718	5,212.00	16,137,394,400	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	2,152,100	5,296.63	11,398,878,766	6,912.00	14,875,315,200	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	2,717,300	4,125.26	11,209,576,547	5,392.00	14,651,681,600	1.26
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,594,200	3,868.25	10,035,039,622	5,505.00	14,281,071,000	1.23
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,424,300	4,479.80	10,860,399,996	5,738.00	13,910,633,400	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,025,600	4,326.45	13,090,131,128	4,165.00	12,601,624,000	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	8,312,400	1,195.15	9,934,615,692	1,509.00	12,543,411,600	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,641,700	4,147.72	10,957,048,400	4,625.00	12,217,862,500	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,318,300	2,653.40	8,804,796,426	3,648.00	12,105,158,400	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	2,978,200	4,638.36	13,813,976,043	4,000.00	11,912,800,000	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,531,500	1,929.97	8,745,693,067	2,512.00	11,383,128,000	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	677,000	14,319.08	9,694,021,665	16,665.00	11,282,205,000	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,686,400	5,190.64	8,753,503,682	6,020.00	10,152,128,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	5,500,500	1,564.26	8,604,230,704	1,798.50	9,892,649,250	0.85
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,854,400	4,517.64	8,377,514,581	5,025.00	9,318,360,000	0.80
日本	株式	ダイキン工業	機械	411,000	23,521.73	9,667,433,548	22,155.00	9,105,705,000	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,101,200	2,621.19	8,128,844,970	2,883.50	8,942,310,200	0.77
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,039,500	2,826.40	5,764,448,866	3,801.00	7,752,139,500	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	3,831,800	1,614.71	6,187,246,309	2,009.00	7,698,086,200	0.66
日本	株式	SMC	機械	103,100	69,391.64	7,154,278,170	74,450.00	7,675,795,000	0.66
日本	株式	丸紅	卸売業	3,006,900	1,857.18	5,584,357,169	2,307.00	6,936,918,300	0.60

(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11月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.37
	建設業	2.05
	食料品	3.39
	繊維製品	0.41
	パルプ・紙	0.17
	化学	5.91
	医薬品	4.70

	石油・石炭製品	0.47
	ゴム製品	0.71
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.97
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.52
	機械	5.15
	電気機器	17.09
	輸送用機器	8.57
	精密機器	2.30
	その他製品	2.27
	電気・ガス業	1.36
	陸運業	2.75
	海運業	0.75
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.59
	卸売業	6.94
	小売業	4.23
	銀行業	7.09
	証券、商品先物取引業	0.78
	保険業	2.41
	その他金融業	1.14
	不動産業	1.93
	サービス業	4.75
	小計	98.78
合計		98.78

(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11月30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 23年12月限	買建	507	円	11,636,785,850	12,046,320,000	1.03

(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11月30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	234,005,752,315	46.75
	フランス	42,145,633,214	8.42
	イタリア	37,437,169,582	7.48
	中国	35,331,389,677	7.06
	ドイツ	30,412,203,282	6.08
	スペイン	26,490,167,089	5.29
	イギリス	25,003,161,529	5.00
	カナダ	9,570,630,588	1.91
	ベルギー	8,717,891,507	1.74
	オランダ	7,447,046,027	1.49
	オーストラリア	7,173,333,403	1.43
	オーストリア	5,874,195,687	1.17
	メキシコ	4,403,588,270	0.88
	アイルランド	2,910,605,779	0.58
	フィンランド	2,570,099,583	0.51
	マレーシア	2,530,554,432	0.51
	ポーランド	2,475,190,729	0.49
	シンガポール	2,087,970,224	0.42
	イスラエル	1,532,028,362	0.31
	デンマーク	1,507,812,260	0.30
ニュージーランド	1,100,166,928	0.22	
スウェーデン	962,174,712	0.19	
ノルウェー	837,648,092	0.17	
	小計	492,526,413,271	98.41
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	7,982,430,282	1.59
純資産総額		500,508,843,553	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11月30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	13,977.49	2,325,855,707	14,238.21	2,369,238,872	3.875000	2033/8/15	0.47

アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	15,100,000	15,563.68	2,350,116,146	14,526.60	2,193,518,037	4.125000	2032/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	17,720,000	12,510.71	2,216,898,933	11,823.33	2,095,095,218	1.250000	2031/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	15,100,000	14,836.83	2,240,362,107	13,833.77	2,088,899,553	3.500000	2033/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	15,480,000	14,115.34	2,185,056,071	13,242.33	2,049,913,027	2.875000	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	14,900,000	14,181.95	2,113,110,654	13,682.10	2,038,633,785	3.375000	2033/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	16,700,000	12,571.61	2,099,459,300	11,857.23	1,980,157,663	1.375000	2031/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	16,730,000	12,361.23	2,068,034,364	11,755.54	1,966,702,918	0.875000	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	16,360,000	12,425.63	2,032,833,159	11,922.72	1,950,557,570	1.125000	2031/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	14,710,000	13,894.49	2,043,880,030	13,069.69	1,922,552,478	2.750000	2032/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	15,460,000	12,969.73	2,005,121,127	12,258.51	1,895,166,298	1.625000	2031/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	16,160,000	12,115.85	1,957,921,545	11,598.70	1,874,351,530	0.625000	2030/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	15,260,000	13,031.87	1,988,663,775	12,278.33	1,873,673,808	1.875000	2032/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	11,490,000	14,139.40	1,624,617,257	14,044.89	1,613,758,754	2.000000	2025/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	11,540,000	13,700.48	1,581,036,510	13,471.84	1,554,650,534	1.500000	2027/1/31	0.31
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	9,590,000	16,081.42	1,542,208,321	15,937.29	1,528,386,122	2.500000	2030/5/25	0.31
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	9,750,000	14,779.94	1,441,045,033	14,846.49	1,447,533,738	0.750000	2028/5/25	0.29
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	10,290,000	14,192.82	1,460,442,149	14,048.05	1,445,545,107	2.250000	2025/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	10,310,000	14,270.70	1,471,310,126	13,833.48	1,426,232,266	2.875000	2028/8/15	0.28
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	12,090,000	12,223.47	1,477,817,550	11,695.22	1,413,952,660	0.625000	2030/5/15	0.28
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	9,560,000	14,849.13	1,419,577,538	14,780.65	1,413,030,355	1.500000	2031/5/25	0.28
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	10,090,000	14,334.69	1,446,370,546	13,869.10	1,399,392,502	2.875000	2028/5/15	0.28
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 251031	10,300,000	13,515.79	1,392,126,422	13,524.98	1,393,073,185	0.250000	2025/10/31	0.28
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	9,990,000	14,296.23	1,428,194,180	13,834.63	1,382,079,892	2.750000	2028/2/15	0.28
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	8,490,000	16,307.21	1,384,482,339	16,180.81	1,373,751,172	2.750000	2027/10/25	0.27
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 251130	10,150,000	13,532.16	1,373,514,595	13,521.53	1,372,435,837	0.375000	2025/11/30	0.27
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280930	10,700,000	13,159.82	1,408,101,125	12,783.88	1,367,875,949	1.250000	2028/9/30	0.27
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260215	9,760,000	13,935.45	1,360,100,598	13,807.91	1,347,652,968	1.625000	2026/2/15	0.27
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 260831	10,100,000	13,351.82	1,348,534,467	13,319.31	1,345,250,723	0.750000	2026/8/31	0.27
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 260930	10,000,000	13,483.33	1,348,333,172	13,345.74	1,334,574,082	0.875000	2026/9/30	0.27

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
----	----------

国債証券	98.41
合計	98.41

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックスマザーファンド

#### 投資状況

2023年11月30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	2,414,611,087,205	70.27
	イギリス	139,707,554,132	4.07
	カナダ	109,636,198,288	3.19
	フランス	104,719,523,127	3.05
	スイス	94,059,189,817	2.74
	ドイツ	81,249,257,118	2.36
	オーストラリア	63,859,638,802	1.86
	オランダ	58,160,830,400	1.69
	デンマーク	31,878,273,313	0.93
	スウェーデン	30,996,780,497	0.90
	スペイン	25,604,143,391	0.75
	香港	18,952,225,736	0.55
	イタリア	18,312,547,590	0.53
	シンガポール	10,411,538,875	0.30
	フィンランド	8,114,812,461	0.24
	ベルギー	7,255,424,532	0.21
	ノルウェー	6,389,945,575	0.19
	アイルランド	4,808,282,707	0.14
	イスラエル	3,489,654,872	0.10
	オーストリア	1,887,573,041	0.05
	ニュージーランド	1,786,263,450	0.05
	ポルトガル	1,751,147,836	0.05
	ルクセンブルグ	1,741,525,701	0.05
バミューダ	561,514,946	0.02	
小計		3,239,944,933,412	94.28

投資証券	アメリカ	56,828,151,955	1.65
	オーストラリア	3,773,931,978	0.11
	シンガポール	1,273,921,778	0.04
	フランス	1,233,667,847	0.04
	イギリス	1,135,148,114	0.03
	香港	836,944,392	0.02
	ベルギー	291,851,826	0.01
	カナダ	289,515,855	0.01
	小計	65,663,133,745	1.91
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	130,807,172,686	3.81
純資産総額		3,436,415,239,843	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11月30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	94,242,836,543	2.74
	買建	カナダ	4,380,065,946	0.13
	買建	ドイツ	15,177,634,143	0.44
	買建	オーストラリア	4,072,917,877	0.12
	買建	イギリス	5,340,455,193	0.16
	買建	スイス	3,479,309,327	0.10

(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11月30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	6,552,111	25,779.91	168,912,868,083	27,850.64	182,480,523,358	5.31
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2,942,522	46,075.81	135,579,098,346	55,717.46	163,949,879,788	4.77
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	3,847,453	16,947.82	65,205,954,082	21,519.28	82,794,427,628	2.41
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・	1,029,208	45,572.33	46,903,416,814	70,799.49	72,867,409,738	2.12

			半導体製造装置						
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,092,102	18,046.98	55,803,128,762	19,852.97	61,387,436,999	1.79
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	922,074	36,189.26	33,369,181,913	48,856.65	45,049,450,380	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,188,903	27,455.47	32,641,895,870	35,905.66	42,688,358,542	1.24
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,589,297	17,457.20	27,744,689,892	20,060.34	31,881,850,895	0.93
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	388,122	72,081.28	27,976,333,915	78,679.50	30,537,248,237	0.89
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	336,384	65,935.69	22,179,712,267	87,044.85	29,280,494,890	0.85
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	539,462	48,057.56	25,925,228,504	52,752.53	28,457,989,816	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,216,924	20,249.96	24,642,666,754	22,695.84	27,619,115,317	0.80
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	184,823	101,000.69	18,667,251,652	138,367.86	25,573,564,486	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	673,821	34,114.29	22,986,930,501	37,389.60	25,193,901,772	0.73
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1,668,646	15,648.24	26,111,386,432	15,051.14	25,115,030,897	0.73
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	1,002,869	23,694.78	23,762,769,092	22,370.81	22,434,999,576	0.65
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	980,746	22,651.29	22,215,166,670	22,226.68	21,798,736,428	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	352,287	56,620.87	19,946,798,313	60,272.22	21,233,122,174	0.62
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	1,362,579	12,619.37	17,194,893,223	14,932.40	20,346,580,110	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	419,095	42,896.44	17,977,683,903	45,741.71	19,170,122,539	0.56
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,111,239	19,133.65	21,262,059,426	16,709.35	18,568,084,496	0.54
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	190,114	54,425.04	10,346,963,811	90,799.54	17,262,265,135	0.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	168,602	96,364.48	16,247,245,007	101,622.09	17,133,687,955	0.50
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	755,402	23,111.83	17,458,728,036	21,164.84	15,987,965,261	0.47
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・	184,614	74,958.57	13,838,403,052	86,456.57	15,961,093,251	0.46

			小売り						
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	1,057,781	17,037.04	18,021,457,838	14,873.18	15,732,576,839	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	735,643	21,519.78	15,830,881,130	20,369.19	14,984,455,717	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	1,707,890	9,279.07	15,847,647,329	8,563.88	14,626,175,431	0.43
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需 品流通・ 小売り	616,364	22,661.72	13,967,869,764	22,954.68	14,148,441,835	0.41
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバ コ	572,620	28,333.95	16,224,591,495	24,584.22	14,077,416,744	0.41

(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11月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	4.74
	素材	3.85
	資本財	6.42
	商業・専門サービス	1.53
	運輸	1.72
	自動車・自動車部品	2.01
	耐久消費財・アパレル	1.51
	消費者サービス	2.01
	メディア・娯楽	5.81
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.43
	生活必需品流通・小売り	1.62
	食品・飲料・タバコ	3.49
	家庭用品・パーソナル用品	1.64
	ヘルスケア機器・サービス	4.23
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.67
	銀行	5.11
	金融サービス	6.43
	保険	3.06
	ソフトウェア・サービス	10.03
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.69	
電気通信サービス	1.17	



	公益事業	2.63
	半導体・半導体製造装置	6.15
	不動産管理・開発	0.32
	小計	94.28
投資証券	—	1.91
合計		96.19

(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11月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額 (円)	評価金額	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2312	買建	2,811	アメリカドル	613,334,384.38	90,203,087,910	640,802,587.5	94,242,836,543	2.74
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602312	買建	167	カナダドル	39,134,059.25	4,234,696,551	40,477,460	4,380,065,946	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2312	買建	2,146	ユーロ	89,848,128.78	14,511,371,279	93,973,340	15,177,634,143	0.44
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2312	買建	237	オーストラリアドル	41,522,201.75	4,046,338,560	41,794,950	4,072,917,877	0.12
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2312	買建	384	イギリスポンド	28,489,580	5,322,993,127	28,583,040	5,340,455,193	0.16
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2312	買建	191	スイスフラン	20,250,063.35	3,413,350,678	20,641,370	3,479,309,327	0.10

(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。

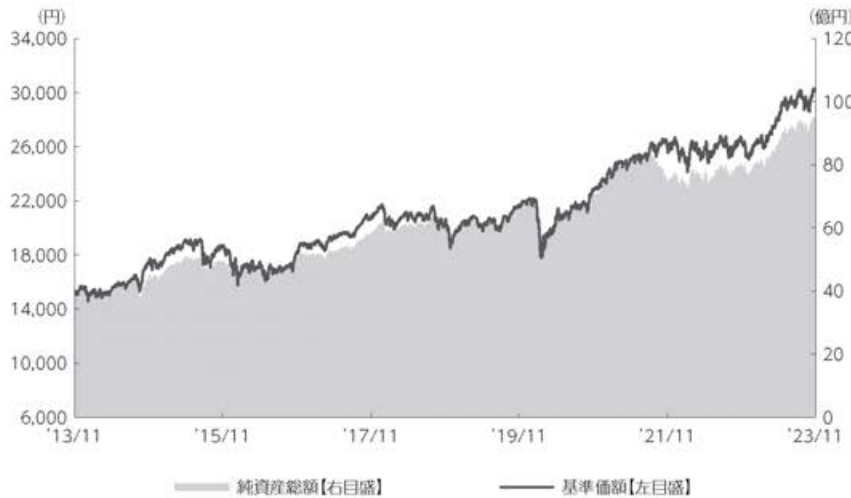
《参考情報》



# 運用実績

2023年11月30日現在

## ■基準価額・純資産の推移 2013年11月29日～2023年11月30日



・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	30,140円
純資産総額	94.7億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

## ■分配の推移

2023年5月	0円
2022年5月	0円
2021年5月	0円
2020年5月	0円
2019年5月	0円
2018年5月	0円
設定来累計	50円

・分配金は1万口当たり、税引前

## ■主要な資産の状況

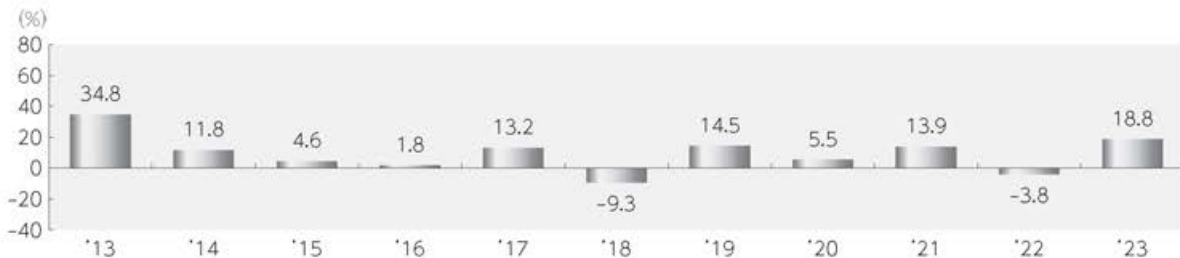
資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	39.5%	1 円	70.1%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	1.8%
国内債券	27.2%	2 アメリカドル	21.0%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.3%
外国株式	23.9%	3 ユーロ	4.0%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.2%
外国債券	4.9%	4 イギリスポンド	1.3%	ソニーグループ	株式	電気機器	日本	1.1%
		5 カナダドル	0.9%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.9%
		6 スイスフラン	0.7%	第359回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
		7 オーストラリアドル	0.6%	第365回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
		8 中国元	0.4%	第363回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
コールローン他 (負債控除後)	4.5%	9 デンマーククローネ	0.3%	第356回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
合計	100.0%	10 スウェーデンクローネ	0.2%	第364回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.2%

### ■その他資産の状況

株価指数先物取引 (買建)	1.3%
債券先物取引 (買建)	0.0%

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

## ■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2023年は年初から11月30日までの収益率を表示

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。  
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### ②申込単位

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申込価額の照会方法

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）

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。

#### ⑧申込受付時間

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

#### ⑨取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止すること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。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

### 2【換金（解約）手続等】

#### ①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

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

す。

②解約単位

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から信託財産留保額を差引いた価額

④信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%をかけた額

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

(受付時間：営業日の9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

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

⑧解約請求受付時間

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

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

⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること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（2001年12月19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5月13日から翌年5月12日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

## (5)【その他】

### ①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

### ②信託約款の変更

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

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

### ③ファンドの償還等に関する開示方法

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

### ④異議申立ておよび反対者の買取請求権

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

### ⑤関係法人との契約の更改

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

### ⑥運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

### ⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

⑩公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

収益分配金は、「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 5 月 13 日から 2023 年 5 月 12 日まで）の財務諸表について、PwC あらた有限責任監査法人により監査を受けております。



# 独立監査人の監査報告書

2023年7月19日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所  
指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）の2023年5月13日から2023年5月12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、三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）の2023年5月12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】

【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) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 21 期 [ 2022 年 5 月 12 日現在 ]	第 22 期 [ 2023 年 5 月 12 日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	169,981,241	270,992,581
親投資信託受益証券	7,224,512,485	8,161,342,739
未収入金	109,897,896	8,100,891
流動資産合計	7,504,391,622	8,440,436,211
資産合計	7,504,391,622	8,440,436,211
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	39,083,428	10,980,551
未払受託者報酬	2,063,867	2,186,305
未払委託者報酬	13,208,700	13,992,316
未払利息	23	320
その他未払費用	148,542	157,354
流動負債合計	54,504,560	27,316,846
負債合計	54,504,560	27,316,846
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,974,517,379	3,063,709,155
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,475,369,683	5,349,410,210
（分配準備積立金）	1,651,225,364	2,177,088,522
元本等合計	7,449,887,062	8,413,119,365
純資産合計	7,449,887,062	8,413,119,365
負債純資産合計	7,504,391,622	8,440,436,211

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 21 期 自 2021 年 5 月 13 日 至 2022 年 5 月 12 日	第 22 期 自 2022 年 5 月 13 日 至 2023 年 5 月 12 日
<b>営業収益</b>		
受取利息	736	1,343
有価証券売買等損益	223,501,677	765,671,233
営業収益合計	223,502,413	765,672,576
<b>営業費用</b>		
支払利息	48,045	93,569
受託者報酬	4,303,922	4,328,069

委託者報酬	27,544,963	27,699,558
その他費用	309,760	311,500
営業費用合計	32,206,690	32,432,696
営業利益又は営業損失(△)	191,295,723	733,239,880
経常利益又は経常損失(△)	191,295,723	733,239,880
当期純利益又は当期純損失(△)	191,295,723	733,239,880
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(△)	95,701,844	34,451,311
期首剰余金又は期首欠損金(△)	4,654,792,227	4,475,369,683
剰余金増加額又は欠損金減少額	984,941,003	679,357,464
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	984,941,003	679,357,464
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,259,957,426	504,105,506
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,259,957,426	504,105,506
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	4,475,369,683	5,349,410,210

### (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌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21期 [2022年5月12日現在]	第22期 [2023年5月12日現在]
1. 期首元本額	3,204,022,065円	2,974,517,379円
期中追加設定元本額	633,640,786円	423,114,832円
期中一部解約元本額	863,145,472円	333,923,056円
2. 受益権の総数	2,974,517,379口	3,063,709,155口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自2021年5月13日 至2022年5月12日			第22期 自2022年5月13日 至2023年5月12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	94,405,678円	費用控除後の配当等収益額	A	141,257,245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	1,188,201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	557,531,324円
収益調整金額	C	3,392,966,529円	収益調整金額	C	3,718,204,127円
分配準備積立金額	D	1,555,631,485円	分配準備積立金額	D	1,478,299,953円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,044,191,893円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,895,292,649円
当ファンドの期末残存口数	F	2,974,517,379口	当ファンドの期末残存口数	F	3,063,709,155口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	16,957円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	19,242円
1万口当たり分配金額	H	—円	1万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第 21 期 自 2021 年 5 月 13 日 至 2022 年 5 月 12 日	第 22 期 自 2022 年 5 月 13 日 至 2023 年 5 月 12 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 21 期 [2022 年 5 月 12 日現在]	第 22 期 [2023 年 5 月 12 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 21 期 [2022 年 5 月 12 日現在]	第 22 期 [2023 年 5 月 12 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	102,748,262	706,622,509
合計	102,748,262	706,622,509

(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21期 [2022年5月12日現在]	第22期 [2023年5月12日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5046円 (25,046円)	2.7461円 (27,461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	TOPIXマザーファンド	1,354,656,899	3,403,710,924	
	外国株式インデックスマザーファンド	422,493,043	2,076,468,807	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,730,531,829	2,264,227,845	
	外国債券インデックスマザーファンド	178,017,661	416,935,163	
合計		3,685,699,432	8,161,342,739	

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。

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5月12日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,791,086,826
国債証券	603,890,129,920
地方債証券	39,739,492,910
特殊債券	33,842,491,649
社債券	43,326,876,000
派生商品評価勘定	15,164,665
未収入金	1,422,633,900
未収利息	1,274,872,862
前払費用	70,332,476
差入委託証拠金	9,300,000
流動資産合計	725,382,381,208
資産合計	725,382,381,208
負債の部	
流動負債	
前受金	14,670,000
未払金	1,337,327,944
未払解約金	552,833,163
未払利息	2,119
流動負債合計	1,904,833,226
負債合計	1,904,833,226
純資産の部	
元本等	
元本	552,953,193,068
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	170,524,354,914
元本等合計	723,477,547,982
純資産合計	723,477,547,982
負債純資産合計	725,382,381,208

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5月12日現在]
1. 期首	2022年5月13日
期首元本額	505,301,120,122円
期中追加設定元本額	136,351,256,491円
期中一部解約元本額	88,699,183,545円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	6,856,365,619円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	9,257,933,215円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	2,283,730,876円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	53,292,981,188円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	90,894,262,647円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	26,757,132,595円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	192,273,147円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	167,572,867円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	2,059,583,616円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,903,499,724円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	3,811,118,987円
eMAXIS バランス(波乗り型)	475,193,577円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	14,137,980,746円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	40,144,545,982円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	9,100,321,586円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	3,702,243,851円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	1,643,127,680円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	14,361,338,339円
国内債券セレクション(ラップ向け)	8,651,501,655円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	16,907,291,170円
つみたて8資産均等バランス	8,074,347,512円
つみたて4資産均等バランス	2,858,251,331円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	14,268,228円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	10,787,577円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	257,508円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	4,597,272,186円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	1,930,693,096円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	730,381,530円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	4,950,442,822円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	4,972,729,003円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	2,682,815,893円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	507,480,082円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	1,058,810,755円
国内債券インデックスファンド(ラップ向け)	2,925,521,581円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065(確定拠出年金)	197,170,754円
ラップ向けインデックスf 国内債券	5,678,326,069円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	2,106,034,462円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	2,159,745,479円
三菱UFJ DC年金バランス(株式80)	2,446,516円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	112,114,045円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	150,524,199円



eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	72,708,769 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,185,572,136 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,695,685,409 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	887,846,440 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	1,794,266,682 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	90,139,485 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	34,999,568 円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	6,368,468,343 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)	132,813 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	27,636,299 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	8,948,944,800 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	712,581,726 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,387,550,381 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)	116,121,862,701 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	448,276,674 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,426,520 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	1,438,842 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,217,058,411 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,573,771,336 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)	3,854,583,062 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	431,694,209 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)	13,109,035,096 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)	3,850,978,535 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)	2,809,470 円
日本債券インデックスファンドS	2,117,680,073 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

格機関投資家限定)	
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (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)	481,227,287 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)	479,565,718 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	17,283,391 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	22,706,550 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,931,596 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	8,354,145 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	16,520,699 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	53,960,847 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	14,248,579 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	45,904,144 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,251,387,969 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)	2,102,609,182 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)	4,272,747,781 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)	2,610,464,306 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)	1,730,531,829 円
合計	552,953,193,068 円
2. 受益権の総数	552,953,193,068 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 5 月 13 日 至 2023 年 5 月 12 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

### 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023 年 5 月 12 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5月12日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	△7,748,204,540	
地方債証券	△422,728,062	
特殊債券	△502,119,218	
社債券	△229,795,000	
合計	△8,902,846,820	

(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5月12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	729,630,000	—	744,800,000	15,170,000
合計		729,630,000	—	744,800,000	15,170,000

(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5月12日現在]
1口当たり純資産額	1.3084円
(1万口当たり純資産額)	(13,084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437回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,802,628,000	
	第438回利付国債(2年)	2,100,000,000	2,103,066,000	
	第439回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,802,718,000	
	第440回利付国債(2年)	900,000,000	901,404,000	
	第441回利付国債(2年)	3,700,000,000	3,705,883,000	
	第442回利付国債(2年)	1,770,000,000	1,772,849,700	
	第443回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,302,210,000	
	第444回利付国債(2年)	3,150,000,000	3,155,134,500	
	第445回利付国債(2年)	3,590,000,000	3,595,528,600	
	第446回利付国債(2年)	2,200,000,000	2,203,146,000	
	第447回利付国債(2年)	1,020,000,000	1,021,438,200	
	第140回利付国債(5年)	1,270,000,000	1,273,136,900	
	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	310,967,200	
	第143回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,397,377,400	
	第144回利付国債(5年)	6,380,000,000	6,402,074,800	
	第145回利付国債(5年)	5,810,000,000	5,832,542,800	
	第146回利付国債(5年)	4,970,000,000	4,990,675,200	
	第147回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,282,188,800	
	第148回利付国債(5年)	2,180,000,000	2,183,379,000	
	第149回利付国債(5年)	6,630,000,000	6,638,884,200	
	第150回利付国債(5年)	4,990,000,000	4,994,491,000	
	第151回利付国債(5年)	750,000,000	750,285,000	
	第152回利付国債(5年)	3,630,000,000	3,644,628,900	
	第153回利付国債(5年)	6,040,000,000	6,037,523,600	
	第154回利付国債(5年)	5,730,000,000	5,744,898,000	
	第155回利付国債(5年)	2,550,000,000	2,577,463,500	
	第156回利付国債(5年)	3,850,000,000	3,872,946,000	
	第157回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,708,194,000	

第1回利付国債（40年）	675,000,000	855,407,250	
第2回利付国債（40年）	1,035,000,000	1,262,844,900	
第3回利付国債（40年）	718,000,000	875,342,520	
第4回利付国債（40年）	1,218,000,000	1,484,608,020	
第5回利付国債（40年）	575,000,000	677,194,750	
第6回利付国債（40年）	1,230,000,000	1,425,471,600	
第7回利付国債（40年）	1,540,000,000	1,709,492,400	
第8回利付国債（40年）	1,510,000,000	1,558,033,100	
第9回利付国債（40年）	2,770,000,000	2,115,781,400	
第10回利付国債（40年）	2,370,000,000	2,117,310,600	
第11回利付国債（40年）	2,100,000,000	1,809,129,000	
第12回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,573,594,800	
第13回利付国債（40年）	2,800,000,000	2,140,600,000	
第14回利付国債（40年）	2,410,000,000	1,965,885,200	
第15回利付国債（40年）	3,500,000,000	3,128,020,000	
第334回利付国債（10年）	3,990,000,000	4,021,800,300	
第335回利付国債（10年）	3,890,000,000	3,922,325,900	
第336回利付国債（10年）	2,460,000,000	2,483,443,800	
第337回利付国債（10年）	1,620,000,000	1,630,238,400	
第338回利付国債（10年）	3,330,000,000	3,359,237,400	
第339回利付国債（10年）	4,020,000,000	4,059,275,400	
第340回利付国債（10年）	3,470,000,000	3,507,961,800	
第341回利付国債（10年）	3,320,000,000	3,351,108,400	
第342回利付国債（10年）	2,570,000,000	2,581,333,700	
第343回利付国債（10年）	4,870,000,000	4,891,866,300	
第344回利付国債（10年）	4,620,000,000	4,640,882,400	
第345回利付国債（10年）	6,340,000,000	6,367,388,800	
第346回利付国債（10年）	6,130,000,000	6,154,703,900	
第347回利付国債（10年）	5,700,000,000	5,719,836,000	
第348回利付国債（10年）	4,970,000,000	4,982,922,000	
第349回利付国債（10年）	6,090,000,000	6,099,744,000	
第350回利付国債（10年）	6,530,000,000	6,531,567,200	
第351回利付国債（10年）	4,570,000,000	4,568,811,800	
第352回利付国債（10年）	3,870,000,000	3,867,910,200	
第353回利付国債（10年）	5,500,000,000	5,493,840,000	
第354回利付国債（10年）	5,740,000,000	5,731,619,600	

第355回利付国債（10年）	5,060,000,000	5,049,272,800	
第356回利付国債（10年）	7,040,000,000	7,020,006,400	
第357回利付国債（10年）	5,250,000,000	5,231,100,000	
第358回利付国債（10年）	6,790,000,000	6,760,056,100	
第359回利付国債（10年）	7,250,000,000	7,206,790,000	
第360回利付国債（10年）	6,430,000,000	6,378,752,900	
第361回利付国債（10年）	5,630,000,000	5,575,276,400	
第362回利付国債（10年）	5,890,000,000	5,821,970,500	
第363回利付国債（10年）	5,860,000,000	5,783,292,600	
第364回利付国債（10年）	7,890,000,000	7,774,095,900	
第365回利付国債（10年）	6,300,000,000	6,199,515,000	
第366回利付国債（10年）	3,500,000,000	3,468,325,000	
第367回利付国債（10年）	5,020,000,000	4,966,737,800	
第368回利付国債（10年）	530,000,000	523,507,500	
第370回利付国債（10年）	2,280,000,000	2,305,946,400	
第1回利付国債（30年）	196,000,000	228,888,800	
第2回利付国債（30年）	268,000,000	308,411,720	
第3回利付国債（30年）	307,000,000	352,442,140	
第4回利付国債（30年）	252,000,000	302,279,040	
第5回利付国債（30年）	238,000,000	274,675,800	
第6回利付国債（30年）	339,000,000	399,287,760	
第7回利付国債（30年）	339,000,000	398,853,840	
第8回利付国債（30年）	302,000,000	342,670,340	
第9回利付国債（30年）	206,000,000	226,089,120	
第10回利付国債（30年）	398,000,000	425,195,340	
第11回利付国債（30年）	237,000,000	267,162,990	
第12回利付国債（30年）	325,000,000	379,723,500	
第13回利付国債（30年）	595,000,000	690,051,250	
第14回利付国債（30年）	683,000,000	822,010,990	
第15回利付国債（30年）	686,000,000	834,649,340	
第16回利付国債（30年）	547,000,000	666,650,780	
第17回利付国債（30年）	577,000,000	697,962,280	
第18回利付国債（30年）	687,000,000	824,839,680	
第19回利付国債（30年）	593,000,000	713,141,800	
第20回利付国債（30年）	655,000,000	804,575,800	
第21回利付国債（30年）	529,000,000	638,079,800	

第22回利付国債(30年)	975,000,000	1,202,399,250	
第23回利付国債(30年)	194,000,000	239,636,560	
第24回利付国債(30年)	541,000,000	669,292,740	
第25回利付国債(30年)	1,287,000,000	1,561,118,130	
第26回利付国債(30年)	1,014,000,000	1,245,739,560	
第27回利付国債(30年)	460,000,000	572,451,600	
第28回利付国債(30年)	1,426,000,000	1,778,378,860	
第29回利付国債(30年)	530,000,000	654,433,400	
第30回利付国債(30年)	1,421,000,000	1,735,410,460	
第31回利付国債(30年)	2,223,000,000	2,682,694,170	
第32回利付国債(30年)	1,989,000,000	2,431,910,520	
第33回利付国債(30年)	1,227,000,000	1,443,626,850	
第34回利付国債(30年)	2,231,000,000	2,695,605,750	
第35回利付国債(30年)	2,029,000,000	2,388,031,550	
第36回利付国債(30年)	1,929,000,000	2,272,728,510	
第37回利付国債(30年)	2,717,000,000	3,154,355,490	
第38回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,814,158,200	
第39回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,576,702,400	
第40回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,962,623,200	
第41回利付国債(30年)	1,210,000,000	1,358,152,400	
第42回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,706,473,600	
第43回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,661,936,400	
第44回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,829,137,100	
第45回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,602,899,200	
第46回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,241,499,500	
第47回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,115,091,200	
第48回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,984,874,100	
第49回利付国債(30年)	1,860,000,000	1,973,497,200	
第50回利付国債(30年)	2,090,000,000	1,962,969,800	
第51回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,663,062,900	
第52回利付国債(30年)	2,020,000,000	1,765,298,200	
第53回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,525,508,100	
第54回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,500,326,800	
第55回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,663,930,300	
第56回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,613,397,600	
第57回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,664,820,000	

第58回利付国債（30年）	2,570,000,000	2,370,953,500	
第59回利付国債（30年）	1,800,000,000	1,617,030,000	
第60回利付国債（30年）	1,630,000,000	1,530,472,200	
第61回利付国債（30年）	1,570,000,000	1,399,812,000	
第62回利付国債（30年）	1,320,000,000	1,113,538,800	
第63回利付国債（30年）	1,630,000,000	1,332,427,200	
第64回利付国債（30年）	1,720,000,000	1,401,043,200	
第65回利付国債（30年）	1,520,000,000	1,236,170,400	
第66回利付国債（30年）	1,830,000,000	1,480,122,300	
第67回利付国債（30年）	2,830,000,000	2,408,867,700	
第68回利付国債（30年）	1,710,000,000	1,450,917,900	
第69回利付国債（30年）	1,720,000,000	1,496,692,400	
第70回利付国債（30年）	1,990,000,000	1,728,215,500	
第71回利付国債（30年）	1,950,000,000	1,691,781,000	
第72回利付国債（30年）	1,910,000,000	1,655,435,200	
第73回利付国債（30年）	1,930,000,000	1,671,148,400	
第74回利付国債（30年）	2,720,000,000	2,548,803,200	
第75回利付国債（30年）	1,870,000,000	1,885,913,700	
第76回利付国債（30年）	2,190,000,000	2,262,948,900	
第77回利付国債（30年）	2,110,000,000	2,284,349,300	
第78回利付国債（30年）	500,000,000	516,860,000	
第70回利付国債（20年）	732,000,000	752,327,640	
第71回利付国債（20年）	360,000,000	369,205,200	
第72回利付国債（20年）	1,079,000,000	1,111,326,840	
第73回利付国債（20年）	520,000,000	537,456,400	
第74回利付国債（20年）	698,000,000	722,548,660	
第75回利付国債（20年）	705,000,000	733,348,050	
第76回利付国債（20年）	410,000,000	424,973,200	
第77回利付国債（20年）	370,000,000	384,193,200	
第78回利付国債（20年）	310,000,000	322,799,900	
第79回利付国債（20年）	150,000,000	156,508,500	
第80回利付国債（20年）	585,000,000	611,611,650	
第81回利付国債（20年）	250,000,000	262,152,500	
第82回利付国債（20年）	1,082,000,000	1,137,149,540	
第83回利付国債（20年）	395,000,000	417,214,800	
第84回利付国債（20年）	880,000,000	927,203,200	



第 8 5 回利付国債（20年）	520,000,000	551,943,600	
第 8 6 回利付国債（20年）	1,047,000,000	1,117,295,580	
第 8 7 回利付国債（20年）	420,000,000	447,001,800	
第 8 8 回利付国債（20年）	1,264,000,000	1,355,968,640	
第 8 9 回利付国債（20年）	340,000,000	363,684,400	
第 9 0 回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,365,211,900	
第 9 1 回利付国債（20年）	548,000,000	590,924,840	
第 9 2 回利付国債（20年）	1,282,000,000	1,379,906,340	
第 9 3 回利付国債（20年）	190,000,000	204,654,700	
第 9 4 回利付国債（20年）	875,000,000	945,857,500	
第 9 5 回利付国債（20年）	1,107,000,000	1,210,604,130	
第 9 6 回利付国債（20年）	340,000,000	369,036,000	
第 9 7 回利付国債（20年）	573,000,000	626,753,130	
第 9 8 回利付国債（20年）	610,000,000	664,570,600	
第 9 9 回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,618,498,400	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,134,864,300	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	723,000,000	803,585,580	
第 1 0 2 回利付国債（20年）	520,000,000	580,668,400	
第 1 0 3 回利付国債（20年）	760,000,000	844,816,000	
第 1 0 4 回利付国債（20年）	610,000,000	671,884,500	
第 1 0 5 回利付国債（20年）	920,000,000	1,017,648,800	
第 1 0 6 回利付国債（20年）	571,000,000	634,649,370	
第 1 0 7 回利付国債（20年）	607,000,000	674,037,080	
第 1 0 8 回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,099,320,000	
第 1 0 9 回利付国債（20年）	560,000,000	617,870,400	
第 1 1 0 回利付国債（20年）	876,000,000	976,696,200	
第 1 1 1 回利付国債（20年）	861,000,000	969,124,380	
第 1 1 2 回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,175,506,500	
第 1 1 3 回利付国債（20年）	922,000,000	1,036,079,060	
第 1 1 4 回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,804,480,000	
第 1 1 5 回利付国債（20年）	944,000,000	1,070,816,960	
第 1 1 6 回利付国債（20年）	461,000,000	524,866,940	
第 1 1 7 回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,493,923,200	
第 1 1 8 回利付国債（20年）	520,000,000	586,539,200	
第 1 1 9 回利付国債（20年）	400,000,000	445,572,000	
第 1 2 0 回利付国債（20年）	780,000,000	857,929,800	

第121回利付国債（20年）	1,299,000,000	1,458,971,850	
第122回利付国債（20年）	100,000,000	111,590,000	
第123回利付国債（20年）	1,318,000,000	1,503,772,100	
第124回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,405,502,800	
第125回利付国債（20年）	1,844,000,000	2,123,163,160	
第126回利付国債（20年）	200,000,000	227,196,000	
第127回利付国債（20年）	440,000,000	496,443,200	
第128回利付国債（20年）	1,974,000,000	2,232,534,780	
第129回利付国債（20年）	280,000,000	314,448,400	
第130回利付国債（20年）	1,862,000,000	2,095,494,800	
第131回利付国債（20年）	420,000,000	469,236,600	
第132回利付国債（20年）	187,000,000	209,385,770	
第133回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,617,215,200	
第134回利付国債（20年）	4,545,000,000	5,136,940,800	
第135回利付国債（20年）	50,000,000	56,080,500	
第136回利付国債（20年）	190,000,000	211,468,100	
第137回利付国債（20年）	8,382,000,000	9,417,093,180	
第138回利付国債（20年）	160,000,000	176,926,400	
第139回利付国債（20年）	310,000,000	345,538,400	
第140回利付国債（20年）	2,517,000,000	2,829,762,420	
第141回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,261,008,000	
第142回利付国債（20年）	9,350,000,000	10,614,120,000	
第143回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,943,319,000	
第144回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,683,172,000	
第145回利付国債（20年）	3,210,000,000	3,618,536,700	
第146回利付国債（20年）	3,170,000,000	3,576,013,600	
第147回利付国債（20年）	3,200,000,000	3,579,552,000	
第148回利付国債（20年）	2,940,000,000	3,259,225,200	
第149回利付国債（20年）	3,090,000,000	3,425,697,600	
第150回利付国債（20年）	3,250,000,000	3,567,980,000	
第151回利付国債（20年）	3,620,000,000	3,891,427,600	
第152回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,944,623,200	
第153回利付国債（20年）	3,380,000,000	3,669,632,200	
第154回利付国債（20年）	3,040,000,000	3,262,862,400	
第155回利付国債（20年）	3,330,000,000	3,492,171,000	
第156回利付国債（20年）	2,700,000,000	2,629,314,000	

第157回利付国債(20年)	3,360,000,000	3,179,400,000	
第158回利付国債(20年)	2,900,000,000	2,846,553,000	
第159回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,243,072,600	
第160回利付国債(20年)	3,480,000,000	3,493,224,000	
第161回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,728,066,800	
第162回利付国債(20年)	3,820,000,000	3,765,259,400	
第163回利付国債(20年)	2,840,000,000	2,791,265,600	
第164回利付国債(20年)	3,350,000,000	3,238,110,000	
第165回利付国債(20年)	2,700,000,000	2,601,369,000	
第166回利付国債(20年)	3,690,000,000	3,649,520,700	
第167回利付国債(20年)	2,660,000,000	2,545,779,600	
第168回利付国債(20年)	2,750,000,000	2,582,580,000	
第169回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,338,857,400	
第170回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,485,685,800	
第171回利付国債(20年)	2,450,000,000	2,239,300,000	
第172回利付国債(20年)	1,950,000,000	1,806,031,500	
第173回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,584,876,000	
第174回利付国債(20年)	4,050,000,000	3,726,526,500	
第175回利付国債(20年)	2,690,000,000	2,509,339,600	
第176回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,287,578,600	
第177回利付国債(20年)	3,010,000,000	2,741,628,400	
第178回利付国債(20年)	3,420,000,000	3,164,662,800	
第179回利付国債(20年)	2,730,000,000	2,519,871,900	
第180回利付国債(20年)	2,970,000,000	2,887,226,100	
第181回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,074,632,000	
第182回利付国債(20年)	2,880,000,000	2,938,579,200	
第183回利付国債(20年)	2,780,000,000	2,979,298,200	
第184回利付国債(20年)	780,000,000	792,253,800	
国債証券 合計	593,728,000,000	603,890,129,920	
地方債証券			
第1回東京都公募公債(20年)	20,000,000	20,032,600	
第4回東京都公募公債(20年)	200,000,000	205,960,000	
第5回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,803,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,928,000	
第7回東京都公募公債(30年)	80,000,000	97,936,800	
第10回東京都公募公債(30年)	100,000,000	119,976,000	
第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,194,000	

第20回東京都公募公債（20年）	80,000,000	88,822,400	
第21回東京都公募公債（20年）	80,000,000	89,562,400	
第28回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,600,000	
第33回東京都公募公債（20年）	100,000,000	92,251,000	
第733回東京都公募公債	700,000,000	704,501,000	
第738回東京都公募公債	100,000,000	100,619,000	
第747回東京都公募公債	500,000,000	504,820,000	
第750回東京都公募公債	200,000,000	201,892,000	
第751回東京都公募公債	500,000,000	503,765,000	
第757回東京都公募公債	150,000,000	149,674,500	
第758回東京都公募公債	150,000,000	149,674,500	
第782回東京都公募公債	100,000,000	99,874,000	
第809回東京都公募公債	100,000,000	97,857,000	
平成26年度第9回北海道公募公債	100,000,000	100,704,000	
平成26年度第13回北海道公募公債	100,000,000	100,666,000	
平成27年度第1回北海道公募公債	300,000,000	302,109,000	
平成27年度第5回北海道公募公債	100,000,000	101,071,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,473,000	
令和3年度第14回北海道公募公債（5年）	400,000,000	397,936,000	
第36回2号宮城県公募公債	342,000,000	335,060,820	
第2回神奈川県公募公債（20年）	680,000,000	700,406,800	
第2回神奈川県公募公債（30年）	180,000,000	225,554,400	
第3回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	521,455,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	123,776,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	548,665,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,288,000	
第234回神奈川県公募公債	100,000,000	99,995,000	
第243回神奈川県公募公債	100,000,000	98,288,000	
第256回神奈川県公募公債	350,000,000	341,701,500	
第7回大阪府公募公債（20年）	220,000,000	243,773,200	
第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	109,603,000	
第179回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,758,000	
第184回大阪府公募公債（5年）	120,000,000	119,590,800	
第186回大阪府公募公債（5年）	300,000,000	298,869,000	
第191回大阪府公募公債（5年）	160,000,000	159,174,400	
第385回大阪府公募公債	200,000,000	201,430,000	

第388回大阪府公募公債	200,000,000	201,388,000	
第391回大阪府公募公債	210,000,000	211,572,900	
第393回大阪府公募公債	110,000,000	110,795,300	
第400回大阪府公募公債	136,000,000	137,457,920	
第407回大阪府公募公債	200,000,000	199,970,000	
第410回大阪府公募公債	200,000,000	199,298,000	
第415回大阪府公募公債	100,000,000	100,024,000	
第417回大阪府公募公債	300,000,000	301,155,000	
第420回大阪府公募公債	100,000,000	100,019,000	
第426回大阪府公募公債	100,000,000	99,828,000	
第435回大阪府公募公債	130,000,000	129,550,200	
第439回大阪府公募公債	100,000,000	99,463,000	
第455回大阪府公募公債	148,000,000	145,451,440	
第460回大阪府公募公債	194,000,000	189,766,920	
第464回大阪府公募公債	800,000,000	777,144,000	
第465回大阪府公募公債	500,000,000	487,210,000	
第467回大阪府公募公債	200,000,000	195,232,000	
第471回大阪府公募公債	97,000,000	93,772,810	
平成26年度第2回京都府公募公債（15年）	200,000,000	209,078,000	
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	107,928,000	
第1回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,218,000	
第1回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	419,780,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	300,000,000	328,215,000	
第2回兵庫県公募公債（30年）	90,000,000	108,550,800	
第4回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,997,000	
第5回兵庫県公募公債（12年）	200,000,000	204,264,000	
第5回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	210,494,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,515,000	
第9回兵庫県公募公債（15年）	500,000,000	521,015,000	
第27回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	190,032,000	
平成28年度第29回兵庫県公募公債	100,000,000	100,346,000	
第6回静岡県公募公債（15年）	300,000,000	313,548,000	
第11回静岡県公募公債（20年）	550,000,000	606,760,000	
第14回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,992,000	
令和2年度第15回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,743,200	
令和2年度第13回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,743,200	

平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	200,000,000	219,370,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	700,000,000	782,628,000	
平成23年度第13回愛知県公募公債	200,000,000	209,836,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	105,017,000	
平成26年度第7回愛知県公募公債	600,000,000	604,224,000	
平成26年度第15回愛知県公募公債	200,000,000	201,412,000	
平成27年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	101,055,000	
平成30年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	99,698,000	
平成30年度第8回愛知県公募公債	200,000,000	199,988,000	
令和3年度第18回愛知県公募公債	100,000,000	97,581,000	
平成26年度第7回広島県公募公債	260,000,000	261,942,200	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,969,000	
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	94,812,000	
平成30年度第4回広島県公募公債	200,000,000	199,934,000	
令和3年度第7回広島県公募公債	100,000,000	97,331,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,091,000	
第14回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	217,600,000	
第16回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	105,170,000	
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	99,748,000	
令和2年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	98,487,000	
令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	110,000,000	109,759,100	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	86,352,700	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	95,308,800	
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	800,000,000	900,824,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,820,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	200,000,000	201,298,000	
平成26年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	100,729,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,004,000	
令和2年度第4回福岡県公募公債	200,000,000	196,214,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	88,230,400	
平成27年度第3回千葉県公募公債	200,000,000	201,922,000	
平成27年度第6回千葉県公募公債	500,000,000	505,085,000	
平成28年度第3回千葉県公募公債	400,000,000	399,356,000	
平成30年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	99,240,000	
令和元年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,624,000	

平成27年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,376,000	
令和4年度第1回長野県公募公債	300,000,000	292,956,000	
第2回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	112,157,000	
第7回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	93,887,000	
平成27年度第1回岐阜県公募公債	300,000,000	303,180,000	
令和2年度第2回岐阜県公募公債(5年)	100,000,000	99,860,000	
平成27年度第1回大分県公募公債	203,400,000	205,434,000	
第135回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,466,000	
第136回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,166,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,444,000	
第142回共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,040,000	
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,532,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,672,000	
第148回共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,310,000	
第150回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,084,000	
第151回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,938,000	
第152回共同発行市場公募地方債	600,000,000	606,402,000	
第153回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,034,000	
第158回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,938,000	
第185回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,820,000	
第193回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,885,000	
第198回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,314,000	
第232回共同発行市場公募地方債	450,000,000	440,923,500	
令和元年度第3回堺市公募公債	100,000,000	98,451,000	
平成27年度第1回佐賀県公募公債	500,000,000	505,095,000	
平成29年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	99,954,000	
平成30年度第1回福島県公募公債	100,000,000	99,994,000	
令和元年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	98,462,000	
令和2年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	97,911,000	
令和3年度第1回熊本県公募公債(5年)	200,000,000	199,388,000	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	111,713,000	
第15回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	112,552,000	
平成26年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	100,772,000	
第1回名古屋市長公募公債(30年)	100,000,000	120,091,000	
第9回名古屋市長公募公債(20年)	100,000,000	109,851,000	
第9回名古屋市長公募公債(30年)	90,000,000	105,314,400	

第28回名古屋市公募公債（5年）	500,000,000	499,085,000	
第488回名古屋市公募公債	200,000,000	201,566,000	
第491回名古屋市公募公債	400,000,000	404,344,000	
第511回名古屋市公募公債	100,000,000	98,155,000	
第1回京都市公募公債（15年）	100,000,000	102,540,000	
第3回京都市公募公債（20年）	100,000,000	105,239,000	
第5回京都市公募公債（20年）	50,000,000	54,007,500	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	110,000,000	118,305,000	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	219,812,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	110,657,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	104,417,000	
第7回横浜市公募公債（20年）	450,000,000	473,224,500	
平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	202,084,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	400,000,000	404,112,000	
平成27年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	303,039,000	
第27回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,639,000	
第33回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	94,168,000	
第35回横浜市公募公債（20年）	500,000,000	476,260,000	
第54回横浜市公募公債（5年）	300,000,000	299,580,000	
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）	80,000,000	95,638,400	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	111,606,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債	400,000,000	420,288,000	
令和元年度第2回札幌市公募公債（5年）	600,000,000	600,066,000	
令和2年度第7回札幌市公募公債	200,000,000	195,274,000	
令和3年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	99,721,000	
第7回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	110,698,000	
第12回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	112,260,000	
第62回川崎市公募公債（5年）	490,000,000	488,500,600	
第17回北九州市公募公債（20年）	100,000,000	108,376,000	
平成25年度第4回福岡市公募公債	50,000,000	50,154,000	
令和3年度第4回千葉市公募公債	100,000,000	96,864,000	
平成26年度第4回福井県公募公債	100,000,000	100,708,000	
令和2年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	97,911,000	
平成28年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	199,616,000	
平成30年度第1回山梨県公募公債	100,000,000	100,156,000	
令和2年度第1回山梨県公募公債	700,000,000	685,790,000	



	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	110,699,000	
地方債証券 合計		38,790,400,000	39,739,492,910	
特殊債券	第4回政府保証新関西国際空港債券	104,000,000	104,952,640	
	第6回神奈川県住宅供給公社債券	100,000,000	98,807,000	
	第26回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	100,714,000	
	第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	30,000,000	32,429,400	
	第52回政府保証日本政策投資銀行	500,000,000	499,795,000	
	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	130,691,000	
	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	149,333,800	
	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	321,954,000	
	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	38,747,400	
	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	253,634,000	
	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	216,296,000	
	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	137,761,800	
	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	326,949,000	
	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	218,358,000	
	第28回道路債券（財投機関債）	100,000,000	120,560,000	
	第33回道路債券（財投機関債）	300,000,000	366,081,000	
	第38回道路債券（財投機関債）	200,000,000	205,998,000	
	第42回道路債券（財投機関債）	200,000,000	207,902,000	
	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	167,091,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	110,180,000	
	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	120,386,000	
	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	118,819,000	
	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	112,578,000	
	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	111,196,000	
	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	103,653,000	
	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	111,281,000	

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	311,109,000	
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	110,682,000	
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	115,753,000	
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	105,441,000	
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	110,567,000	
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	112,931,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,736,000	
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	124,908,920	
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	107,906,000	
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	1,191,789,690	
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	100,725,000	
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	201,544,000	
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	656,188,000	
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	101,945,360	
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	101,135,000	
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	100,841,000	
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	201,698,000	
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	100,719,000	
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	200,502,000	
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	299,643,000	
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	99,675,000	
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	55,746,500	
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	100,000,000	122,789,000	
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	51,559,500	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	500,000,000	500,000,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投)	100,000,000	110,269,000	

機関債)			
第12回公営企業債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	310,902,000	
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	112,491,000	
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	90,643,200	
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	88,569,600	
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	150,000,000	159,769,500	
第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	108,557,000	
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	109,470,000	
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	329,295,000	
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	55,261,000	
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	99,880,000	
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	105,796,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,002,160	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,702,000	
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	241,749,600	
第67回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	170,000,000	171,230,800	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	304,766,320	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	403,548,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,826,000	
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	303,030,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	151,249,500	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,248,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	674,000,000	673,326,000	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	102,000,000	101,879,640	
F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	106,258,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	299,943,000	
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	325,000,000	324,155,000	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	131,000,000	130,941,050	
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	102,270,000	
第108回政府保証地方公共団体金融機構債券	223,000,000	222,279,710	
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,226,000	
F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	70,000,000	75,804,400	

F 1 5 1 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,892,000	
F 2 0 3 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	207,416,000	
F 2 3 4 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	109,376,000	
第 2 7 回首都高速道路	100,000,000	99,727,000	
第 2 4 回阪神高速道路	200,000,000	199,726,000	
第 1 0 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	89,484,800	
第 1 5 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	88,437,600	
第 5 回本州四国連絡橋債券（財投機関債）	200,000,000	206,854,000	
第 4 8 回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	399,996,000	
第 5 4 回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,572,000	
第 4 回中部国際空港（財投機関債）	200,000,000	200,444,000	
第 2 3 2 回政府保証預金保険機構債券	400,000,000	400,532,000	
第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,140,000	31,353,309	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	36,390,000	36,212,416	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	37,511,000	37,304,314	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	43,325,000	42,990,964	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,068,000	10,130,723	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	62,404,000	61,925,361	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,897,000	11,066,121	
第 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,854,000	21,013,116	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,700,000	20,803,594	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,876,000	20,939,366	
第 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,223,000	21,256,395	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,413,000	20,382,096	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,280,000	38,975,867	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,850,000	9,906,440	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,894,000	40,621,282	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,893,000	21,781,370	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,582,000	41,903,349	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,213,000	10,280,814	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,931,000	24,994,015	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,552,000	96,048,118	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,946,000	59,390,122	
第 4 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,486,000	17,152,858	

第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,192,000	36,689,771	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,970,000	37,422,468	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,262,000	38,705,529	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,120,000	40,650,374	
第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,816,000	21,136,358	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,108,000	43,676,101	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,200,000	45,853,522	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,886,000	25,836,396	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,068,000	26,044,649	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,382,000	55,529,024	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,138,000	56,097,254	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,668,000	56,492,271	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,530,000	31,513,981	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,370,000	31,224,611	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,272,000	103,173,871	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,475,000	32,561,831	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,590,000	36,959,503	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,189,000	31,175,274	
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	31,498,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,418,000	32,269,427	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,192,000	36,111,215	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,787,000	38,705,601	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,004,000	151,412,532	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,882,000	78,672,581	
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	110,952,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,148,000	41,936,395	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,636,000	128,543,138	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,807,000	45,130,954	
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	209,856,000	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,266,000	56,801,652	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,860,000	54,163,231	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,051,000	55,816,759	
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	222,934,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機	100,000,000	104,819,000	

関債)			
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,441,000	59,007,877	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,236,000	120,954,966	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	267,460,000	261,731,006	
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	338,560,000	328,819,628	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	206,058,000	199,385,841	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,422,000	139,765,829	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	495,635,000	486,941,562	
第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	130,000,000	153,279,100	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,432,000	214,760,292	
第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	110,428,000	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,252,000	71,548,158	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,295,000	73,370,459	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,080,000	72,325,044	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,610,000	148,283,676	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,926,000	147,349,053	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,573,000	73,626,239	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,151,000	73,222,625	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	228,831,000	223,231,505	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,029,000	74,937,662	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,820,000	75,936,756	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,404,000	152,913,062	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,284,000	152,162,791	
第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	104,634,000	
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,514,000	157,332,963	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,069,000	236,936,849	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,635,000	242,201,134	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,880,000	163,692,787	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,391,000	82,257,150	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,654,000	164,421,715	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,591,000	85,358,314	
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	102,045,000	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,794,000	171,956,917	
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	100,962,000	

関債)			
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,924,000	86,488,903	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,487,000	262,699,266	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,806,000	176,981,283	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,118,000	176,817,721	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,402,000	178,153,711	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,030,000	88,889,234	
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	186,417,000	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,651,000	90,763,683	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,366,000	180,836,955	
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,742,000	182,400,882	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,681,000	91,678,665	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,710,000	184,183,903	
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,451,000	92,471,019	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,266,000	93,192,226	
第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,392,000	187,114,495	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,060,000	188,145,051	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,906,000	188,468,254	
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,064,000	96,747,981	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,134,000	199,085,626	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,341,000	100,899,660	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,856,000	100,203,498	
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,108,000	
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	99,689,000	
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	100,206,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券(財投機関債)	50,000,000	52,039,000	
い第832号商工債券	100,000,000	99,909,000	
い第843号商工債券	200,000,000	199,794,000	
い第848号商工債券	100,000,000	99,743,000	
い第850号商工債券	300,000,000	299,055,000	
い第852号商工債券	100,000,000	99,622,000	
い第854号商工債券	500,000,000	497,760,000	
い第857号商工債券	100,000,000	99,500,000	
い第872号商工債券	200,000,000	200,880,000	

	第376回信金中金債	100,000,000	99,770,000	
	第11号商工債券(10年)	300,000,000	302,232,000	
	第257号商工債券(3年)	200,000,000	199,876,000	
	第2回信金中金債(10年)	100,000,000	100,959,000	
	第7回国際協力機構債券(財投機関債)	70,000,000	78,141,000	
	第83回東日本高速道路	400,000,000	398,268,000	
	第29回西日本高速道路	200,000,000	200,794,000	
	第56回西日本高速道路	900,000,000	898,407,000	
	第61回西日本高速道路	700,000,000	696,759,000	
	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	103,286,000	
特殊債券 合計		33,156,129,000	33,842,491,649	
社債券	第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,847,000	
	第26回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,024,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,308,000	
	第35回フランス相互信用連合銀行	500,000,000	492,755,000	
	第38回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	301,110,000	
	第6回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	200,776,000	
	第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	300,000,000	299,844,000	
	第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	97,815,000	
	第1回サントナデル銀行(2019)	500,000,000	496,510,000	
	第12回新関西国際空港	100,000,000	103,749,000	
	第27回新関西国際空港	100,000,000	99,631,000	
	第32回成田国際空港	100,000,000	98,826,000	
	第17回ナショナル・オーストラリア銀行	300,000,000	300,183,000	
	第1回国際石油開発帝石	100,000,000	99,469,000	
	第48回鹿島建設(サステナビリティ)	100,000,000	100,676,000	
	第10回明治ホールディングス(サステナビリティ)	200,000,000	199,044,000	
	第16回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,527,000	
	第19回アサヒグループホールディングス	400,000,000	400,524,000	
	第9回サントリーホールディングス	200,000,000	199,692,000	
	第5回サントリー食品インターナショナル	200,000,000	199,760,000	
	第22回味の素	100,000,000	100,167,000	
	第3回 キューピー	100,000,000	99,951,000	
	第13回日本たばこ産業	200,000,000	198,696,000	
	第6回ヒューリック	400,000,000	397,528,000	



第11回ヒューリック	300,000,000	300,147,000	
第4回トヨタ紡織	200,000,000	200,004,000	
第27回東急不動産ホールディングス(グリーン)	300,000,000	300,642,000	
第9回クラレ	100,000,000	99,811,000	
第16回旭化成	200,000,000	199,544,000	
第42回王子ホールディングス	300,000,000	298,608,000	
第11回イビデン	200,000,000	199,632,000	
第56回三井化学	100,000,000	100,033,000	
第4回野村総合研究所	100,000,000	99,209,000	
第6回花王	200,000,000	199,586,000	
第1回アステラス製薬	400,000,000	400,376,000	
第19回オリエントランド	300,000,000	299,574,000	
第12回ヤフー	500,000,000	495,145,000	
第19回Zホールディングス	400,000,000	395,876,000	
第22回Zホールディングス	200,000,000	199,348,000	
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	100,060,000	
第11回ブリヂストン	500,000,000	498,960,000	
第12回日本電気硝子	100,000,000	99,007,000	
第4回新日本製鐵	200,000,000	199,934,000	
第36回ジェイエフイーホールディングス	400,000,000	398,904,000	
第14回LIXIL	200,000,000	199,808,000	
第1回日本郵政(グリーン)	100,000,000	99,585,000	
第30回ダイキン工業	200,000,000	198,298,000	
第55回日本精工	100,000,000	100,145,000	
第19回日立製作所	100,000,000	99,372,000	
第17回パナソニック	500,000,000	501,770,000	
第18回パナソニック	100,000,000	99,699,000	
第22回パナソニック	100,000,000	98,730,000	
第18回デンソー	300,000,000	299,001,000	
第40回三菱重工業	300,000,000	298,725,000	
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	99,570,000	
第26回トヨタ自動車(サステナビリティ)	800,000,000	796,368,000	
第4回ヤマハ発動機	100,000,000	100,094,000	
第1回明治安田生命2018基金	200,000,000	199,988,000	
第1回明治安田生命2019基金	200,000,000	199,756,000	

第63回三井物産	400,000,000	431,704,000	
第51回住友商事	100,000,000	103,763,000	
第61回住友商事	100,000,000	100,596,000	
第1回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	100,306,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000,000	300,057,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	500,000,000	490,200,000	
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	224,226,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	206,100,000	
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	207,636,000	
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	110,227,000	
第88回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	107,793,000	
第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	97,674,000	
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	104,223,000	
第28回芙蓉総合リース	500,000,000	495,525,000	
第14回みずほリース	100,000,000	99,746,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,200,000,000	1,198,512,000	
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	298,746,000	
第20回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン)	600,000,000	598,788,000	
第52回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	199,178,000	
第53回日産フィナンシャルサービス	300,000,000	296,940,000	
第34回東京センチュリー	300,000,000	292,839,000	
第70回ホンダファイナンス	200,000,000	199,544,000	
第72回ホンダファイナンス	400,000,000	398,920,000	
第96回トヨタファイナンス	800,000,000	796,504,000	
第97回トヨタファイナンス	200,000,000	199,786,000	
第22回ポケットカード	100,000,000	99,530,000	
第31回リコーリース	100,000,000	100,027,000	
第41回リコーリース	500,000,000	496,475,000	
第79回アコム	300,000,000	299,499,000	
第80回アコム	200,000,000	198,116,000	
第81回アコム	100,000,000	98,433,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	300,000,000	300,501,000	
第1回三菱HCキャピタル	900,000,000	896,886,000	
第69回三菱UFJリース	500,000,000	497,145,000	
第3回野村ホールディングス	200,000,000	197,450,000	

第24回野村ホールディングス	100,000,000	103,631,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	103,550,000	
第137回三菱地所	300,000,000	299,382,000	
第143回三菱地所	100,000,000	100,708,000	
第111回住友不動産（グリーン）	100,000,000	99,920,000	
第12回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,652,000	
第13回森トラスト総合リート投資法人	200,000,000	199,882,000	
第76回東京急行電鉄	200,000,000	209,416,000	
第36回京王電鉄	200,000,000	198,952,000	
第34回東日本旅客鉄道	100,000,000	102,663,000	
第53回東日本旅客鉄道	300,000,000	327,555,000	
第100回東日本旅客鉄道	200,000,000	218,806,000	
第102回東日本旅客鉄道	100,000,000	100,599,000	
第163回東日本旅客鉄道	600,000,000	596,166,000	
第174回東日本旅客鉄道	700,000,000	697,935,000	
第73回西日本旅客鉄道	400,000,000	397,428,000	
第42回東海旅客鉄道	100,000,000	110,433,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	108,421,000	
第2回東京地下鉄	500,000,000	512,380,000	
第28回東京地下鉄	300,000,000	296,754,000	
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	197,706,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	198,792,000	
第64回名古屋鉄道	200,000,000	198,396,000	
第8回ニッコンホールディングス	100,000,000	99,973,000	
第1回横浜高速鉄道	300,000,000	301,422,000	
第9回九州旅客鉄道	200,000,000	199,298,000	
第31回KDDI（サステナビリティ）	200,000,000	199,846,000	
第9回ソフトバンク	300,000,000	295,614,000	
第14回ソフトバンク	100,000,000	98,769,000	
第16回ソフトバンク	300,000,000	283,383,000	
第548回東京電力	100,000,000	103,524,000	
第567回東京電力	100,000,000	101,076,000	
第508回関西電力	200,000,000	200,616,000	
第510回関西電力	500,000,000	501,545,000	
第511回関西電力	100,000,000	99,893,000	
第518回関西電力	200,000,000	198,956,000	

第524回関西電力	200,000,000	199,144,000	
第532回関西電力	100,000,000	99,939,000	
第543回関西電力	200,000,000	199,246,000	
第393回中国電力	100,000,000	99,719,000	
第400回中国電力	200,000,000	199,356,000	
第409回中国電力	200,000,000	198,538,000	
第307回北陸電力	100,000,000	102,349,000	
第322回北陸電力	100,000,000	100,081,000	
第485回東北電力	100,000,000	99,840,000	
第494回東北電力	200,000,000	200,120,000	
第529回東北電力	500,000,000	496,490,000	
第552回東北電力	400,000,000	405,192,000	
第449回九州電力	300,000,000	300,399,000	
第468回九州電力	100,000,000	99,173,000	
第471回九州電力	300,000,000	297,351,000	
第484回九州電力	400,000,000	391,152,000	
第493回九州電力	400,000,000	397,412,000	
第511回九州電力	600,000,000	602,784,000	
第29回沖縄電力	200,000,000	199,788,000	
第50回電源開発	200,000,000	200,222,000	
第57回電源開発	100,000,000	98,860,000	
第59回電源開発	300,000,000	297,159,000	
第64回電源開発	600,000,000	591,726,000	
第67回電源開発	200,000,000	194,266,000	
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,175,000	
第13回東京電力パワーグリッド	300,000,000	298,134,000	
第15回東京電力パワーグリッド	100,000,000	98,653,000	
第16回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,870,000	
第25回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,444,000	
第28回東京電力パワーグリッド	400,000,000	401,020,000	
第31回東京電力パワーグリッド	300,000,000	300,066,000	
第33回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,542,000	
第35回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,928,000	
第38回東京電力パワーグリッド	400,000,000	400,188,000	
第39回東京電力パワーグリッド	400,000,000	399,952,000	
第41回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,790,000	

第44回東京電力パワーグリッド	200,000,000	198,510,000	
第47回東京電力パワーグリッド	200,000,000	192,116,000	
第49回東京電力パワーグリッド	400,000,000	397,336,000	
第16回JERA	200,000,000	201,242,000	
第17回JERA	200,000,000	202,228,000	
第1回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	200,000,000	199,288,000	
第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	400,000,000	400,456,000	
第13回広島ガス	200,000,000	197,306,000	
第7回ファーストリテイリング	100,000,000	99,968,000	
社債券 合計	43,300,000,000	43,326,876,000	
合計	708,974,529,000	720,798,990,479	

## 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。

## TOPIXマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[2023年5月12日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	104,879,848,561
株式	967,137,737,220
派生商品評価勘定	742,376,200
未収入金	2,791,826,118
未収配当金	10,874,688,780
未収利息	2,311,143
その他未収収益	92,079,004
差入委託証拠金	612,150,000
流動資産合計	1,087,133,017,026
資産合計	1,087,133,017,026
負債の部	
流動負債	
前受金	629,359,700
未払解約金	1,484,026,107
未払利息	124,131
受入担保金	98,933,300,470
流動負債合計	101,046,810,408
負債合計	101,046,810,408

純資産の部

元本等

元本	392,461,590,302
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	593,624,616,316
元本等合計	986,086,206,618
純資産合計	986,086,206,618
負債純資産合計	1,087,133,017,026

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5月12日現在]
1. 期首	2022年5月13日
期首元本額	328,511,064,906円
期中追加設定元本額	202,408,906,604円
期中一部解約元本額	138,458,381,208円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	7,246,188,100円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	923,646,692円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,862,044,307円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,566,181,410円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,403,202,300円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	7,179,304,460円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	37,917,454,594円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	41,782,946,193円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	103,862,726円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	275,666,072円
ファンド・マネジャー(国内株式)	674,441,102円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,000,589,545円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,229,502,944円
eMAXIS バランス(波乗り型)	114,717,715円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,859,543,038円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	966,342,043円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	1,093,104,438円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	951,281,279円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	28,110,875,905円
国内株式セレクション(ラップ向け)	4,271,627,926円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	9,698,378,902円

つみたて日本株式 (TOPIX)	7,236,577,800 円
つみたて8資産均等バランス	4,620,309,699 円
つみたて4資産均等バランス	1,567,377,649 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,547,633 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,300,925 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,731,308 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	742,126,842 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	837,477,010 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	544,623,968 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	470,747,384 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,571,556,171 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	3,183,968,995 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	972,081,040 円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	2,612,808,296 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	457,765,334 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	157,797,710 円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	18,127,527,970 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	177,285,027 円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,906,180,104 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	164,535,090 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,455,062,857 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	811,913,677 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	16,236,655 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	6,838,326,121 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	61,617,351 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	14,611,403 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	40,335,081 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	849,544,700 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,032,344,170 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	330,388,628 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	853,364,933 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	474,797,228 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	16,659,048 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	111,464,015 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	653,943,255 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	140,077,233 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	158,181,711 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	586,379,680 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	475,715,899 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	919,433,841 円
三菱UFJ トピックスオープン	985,999,603 円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,961,718,497 円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	61,953,702 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)	5,249,526,236 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)	55,404 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	9,802,612 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,747,446,502 円

三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	93,485,108 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,566,769,261 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)	43,282,685,754 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	245,576,680 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	253,139 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	764,421 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	250,980,564 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	460,907,199 円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,771,786,040 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)	2,411,794,059 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)	761,924,515 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)	575,603,210 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	87,314,316 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)	2,756,036,112 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)	169,990,775 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)	3,386,429,073 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)	577,532,669 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)	11,482,656,276 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)	64,637,757 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)	211,455 円
日米コアバランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	162,080,972 円
日本株式インデックスファンドS	1,045,019,611 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	35,980,732 円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	111,824,554 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	35,434,968 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	35,501,352 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	35,160,631 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	35,822,253 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	35,950,680 円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	435,132,892 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



格機関投資家限定)	
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)	884,481,624 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)	39,470,553 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)	39,919,767 円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	4,952,823,609 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	3,180,953 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	8,569,381 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	2,258,275 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	6,547,886 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	573,279,525 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	98,727,668 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,488,016 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	37,976,437 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	2,815,005 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	29,092,363 円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,603,704,891 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)	386,304,931 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)	1,598,762,631 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)	1,498,921,325 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)	1,354,656,899 円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	56,627,245,739 円
合計	392,461,590,302 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	94,578,617,330 円
3. 受益権の総数	392,461,590,302 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 5 月 13 日 至 2023 年 5 月 12 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行っております。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

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>を有しております。</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5月12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5月12日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	60,035,299,813
合計	60,035,299,813

(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5月12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	15,404,100,300	—	16,146,900,000	742,799,700
合計		15,404,100,300	—	16,146,900,000	742,799,700

#### (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5月12日現在]
1口当たり純資産額	2,5126円
(1万口当たり純資産額)	(25,126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	17,100	3,665.00	62,671,500	
1332	ニッスイ	452,500	622.00	281,455,000	貸付有価証券 60,200株
1333	マルハニチロ	67,100	2,587.00	173,587,700	
1375	雪国まいたけ	38,500	988.00	38,038,000	貸付有価証券 3,700株
1376	カネコ種苗	13,900	1,622.00	22,545,800	
1377	サカタのタネ	51,500	4,010.00	206,515,000	
1379	ホクト	40,300	1,863.00	75,078,900	貸付有価証券 4,600株
1384	ホクリョウ	3,900	757.00	2,952,300	貸付有価証券 900株
1514	住石ホールディングス	51,000	336.00	17,136,000	貸付有価証券 23,200株
1515	日鉄鉱業	18,100	3,715.00	67,241,500	貸付有価証券 2,300株
1518	三井松島ホールディングス	20,500	3,135.00	64,267,500	貸付有価証券 3,000株
1605	I N P E X	1,673,400	1,460.00	2,443,164,000	貸付有価証券 105,800株
1662	石油資源開発	52,400	4,350.00	227,940,000	貸付有価証券 7,900株
1663	K&Oエナジーグループ	20,500	2,267.00	46,473,500	貸付有価証券 2,900株
1414	ショーボンドホールディングス	61,600	5,760.00	354,816,000	貸付有価証券 8,600株
1417	ミライト・ワン	149,600	1,707.00	255,367,200	貸付有価証券 100株
1419	タマホーム	28,400	3,900.00	110,760,000	貸付有価証券 3,500株

1420	サンヨーホームズ	3,300	718.00	2,369,400	貸付有価証券 900株
1429	日本アクア	11,600	885.00	10,266,000	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	938.00	6,659,800	貸付有価証券 2,300株
1433	バステラ	6,000	929.00	5,574,000	貸付有価証券 400株
1435	R o b o t H o m e	77,000	239.00	18,403,000	
1446	キャンディル	4,300	575.00	2,472,500	
1712	ダイセキ環境ソリューション	5,600	917.00	5,135,200	貸付有価証券 1,200株
1716	第一カッター興業	11,600	1,294.00	15,010,400	貸付有価証券 1,600株
1719	安藤・間	262,200	969.00	254,071,800	
1720	東急建設	128,800	744.00	95,827,200	貸付有価証券 17,600株
1721	コムシスホールディングス	153,100	2,720.00	416,432,000	貸付有価証券 29,200株
1726	ビーアールホールディングス	71,800	387.00	27,786,600	貸付有価証券 6,500株
1762	高松コンストラクショングループ	29,400	2,376.00	69,854,400	貸付有価証券 3,800株
1766	東建コーポレーション	13,000	7,820.00	101,660,000	貸付有価証券 1,800株
1768	ソネック	3,000	985.00	2,955,000	貸付有価証券 600株
1780	ヤマウラ	22,900	1,203.00	27,548,700	
1786	オリエンタル白石	162,600	333.00	54,145,800	
1801	大成建設	296,200	4,735.00	1,402,507,000	貸付有価証券 63,100株
1802	大林組	1,131,900	1,107.00	1,253,013,300	貸付有価証券 182,000株
1803	清水建設	951,600	844.00	803,150,400	貸付有価証券 175,300株
1805	飛島建設	35,000	1,156.00	40,460,000	貸付有価証券 4,000株
1808	長谷工コーポレーション	326,700	1,671.00	545,915,700	貸付有価証券 54,200株
1810	松井建設	29,500	725.00	21,387,500	貸付有価証券 5,500株
1811	銭高組	2,500	3,260.00	8,150,000	貸付有価証券 800株
1812	鹿島建設	701,800	1,836.00	1,288,504,800	貸付有価証券 154,700株
1813	不動テトラ	21,900	1,813.00	39,704,700	
1814	大末建設	7,100	1,281.00	9,095,100	貸付有価証券

					1,600株
1815	鉄建建設	22,700	2,027.00	46,012,900	貸付有価証券 3,000株
1820	西松建設	53,700	3,390.00	182,043,000	貸付有価証券 16,300株
1821	三井住友建設	255,200	383.00	97,741,600	貸付有価証券 33,700株
1822	大豊建設	13,100	3,980.00	52,138,000	貸付有価証券 3,100株
1826	佐田建設	14,500	476.00	6,902,000	貸付有価証券 3,000株
1827	ナカノフドー建設	16,100	407.00	6,552,700	貸付有価証券 3,800株
1833	奥村組	51,300	3,520.00	180,576,000	貸付有価証券 1,800株
1835	東鉄工業	43,600	2,768.00	120,684,800	貸付有価証券 6,000株
1847	イチケン	4,900	1,951.00	9,559,900	貸付有価証券 1,000株
1848	富士ピー・エス	8,700	445.00	3,871,500	
1852	浅沼組	25,300	3,150.00	79,695,000	貸付有価証券 300株
1860	戸田建設	389,400	826.00	321,644,400	貸付有価証券 64,100株
1861	熊谷組	53,000	2,928.00	155,184,000	
1866	北野建設	4,100	3,270.00	13,407,000	貸付有価証券 800株
1867	植木組	5,500	1,347.00	7,408,500	貸付有価証券 1,200株
1870	矢作建設工業	43,100	1,014.00	43,703,400	貸付有価証券 6,200株
1871	ピーエス三菱	40,100	688.00	27,588,800	貸付有価証券 2,700株
1873	日本ハウスホールディングス	62,800	393.00	24,680,400	貸付有価証券 13,700株
1879	新日本建設	44,400	1,079.00	47,907,600	貸付有価証券 5,900株
1882	東亜道路工業	12,600	4,525.00	57,015,000	
1884	日本道路	6,400	8,090.00	51,776,000	
1885	東亜建設工業	27,100	3,015.00	81,706,500	
1887	日本国土開発	94,900	626.00	59,407,400	
1888	若築建設	14,100	4,410.00	62,181,000	貸付有価証券 3,600株
1890	東洋建設	102,500	971.00	99,527,500	貸付有価証券 13,600株
1893	五洋建設	448,700	678.00	304,218,600	貸付有価証券 55,200株

1898	世紀東急工業	40,600	1,266.00	51,399,600	貸付有価証券 2,200株
1899	福田組	11,900	4,835.00	57,536,500	貸付有価証券 1,600株
1911	住友林業	242,800	3,015.00	732,042,000	貸付有価証券 58,000株
1914	日本基礎技術	14,900	552.00	8,224,800	貸付有価証券 5,700株
1921	巴コーポレーション	24,500	477.00	11,686,500	貸付有価証券 6,200株
1925	大和ハウス工業	884,500	3,449.00	3,050,640,500	貸付有価証券 169,800株
1926	ライト工業	58,600	1,991.00	116,672,600	貸付有価証券 4,200株
1928	積水ハウス	991,500	2,855.00	2,830,732,500	貸付有価証券 294,800株
1929	日特建設	30,200	1,004.00	30,320,800	貸付有価証券 2,100株
1930	北陸電気工事	21,700	876.00	19,009,200	貸付有価証券 2,800株
1934	ユアテック	69,700	874.00	60,917,800	貸付有価証券 7,900株
1938	日本リーテック	27,800	1,312.00	36,473,600	貸付有価証券 2,900株
1939	四電工	13,200	1,954.00	25,792,800	
1941	中電工	49,100	2,260.00	110,966,000	貸付有価証券 10,600株
1942	関電工	173,400	1,073.00	186,058,200	貸付有価証券 19,900株
1944	きんでん	222,800	1,882.00	419,309,600	貸付有価証券 33,000株
1945	東京エネシス	31,500	957.00	30,145,500	貸付有価証券 7,900株
1946	トーエネック	10,500	3,675.00	38,587,500	貸付有価証券 1,400株
1949	住友電設	30,100	2,925.00	88,042,500	貸付有価証券 3,800株
1950	日本電設工業	52,000	1,967.00	102,284,000	貸付有価証券 11,200株
1951	エクシオグループ	145,800	2,582.00	376,455,600	貸付有価証券 21,000株
1952	新日本空調	17,600	2,142.00	37,699,200	貸付有価証券 6,500株
1959	九電工	77,000	3,605.00	277,585,000	貸付有価証券 9,700株
1961	三機工業	70,200	1,517.00	106,493,400	貸付有価証券 4,800株
1963	日揮ホールディングス	313,100	1,629.00	510,039,900	貸付有価証券 51,100株

1964	中外炉工業	10,400	1,881.00	19,562,400	貸付有価証券 1,500株
1967	ヤマト	16,100	985.00	15,858,500	貸付有価証券 6,900株
1968	太平電業	19,600	4,175.00	81,830,000	貸付有価証券 3,300株
1969	高砂熱学工業	76,300	2,385.00	181,975,500	貸付有価証券 19,300株
1972	三晃金属工業	2,700	3,940.00	10,638,000	貸付有価証券 600株
1975	朝日工業社	13,100	2,526.00	33,090,600	貸付有価証券 1,800株
1976	明星工業	54,400	909.00	49,449,600	貸付有価証券 5,600株
1979	大氣社	36,500	3,835.00	139,977,500	貸付有価証券 8,900株
1980	ダイダン	20,800	2,511.00	52,228,800	貸付有価証券 2,900株
1982	日比谷総合設備	27,200	2,327.00	63,294,400	貸付有価証券 700株
3267	フィル・カンパニー	5,600	878.00	4,916,800	貸付有価証券 1,100株
5074	テスホールディングス	34,100	1,161.00	39,590,100	貸付有価証券 2,700株
5076	インフロニア・ホールディングス	331,700	1,249.00	414,293,300	貸付有価証券 33,900株
6330	東洋エンジニアリング	41,900	568.00	23,799,200	貸付有価証券 5,800株
6379	レイズネクスト	45,800	1,444.00	66,135,200	貸付有価証券 5,800株
2001	ニッポン	85,600	1,800.00	154,080,000	
2002	日清製粉グループ本社	293,800	1,739.00	510,918,200	貸付有価証券 74,100株
2003	日東富士製粉	5,700	4,645.00	26,476,500	
2004	昭和産業	27,700	2,632.00	72,906,400	
2009	鳥越製粉	15,600	637.00	9,937,200	貸付有価証券 4,000株
2053	中部飼料	44,000	1,086.00	47,784,000	貸付有価証券 5,400株
2060	フィード・ワン	46,400	752.00	34,892,800	貸付有価証券 1,100株
2107	東洋精糖	3,700	1,081.00	3,999,700	貸付有価証券 800株
2108	日本甜菜製糖	18,500	1,771.00	32,763,500	貸付有価証券 2,300株
2109	DM三井製糖ホールディングス	31,500	2,328.00	73,332,000	
2112	塩水港精糖	25,700	205.00	5,268,500	貸付有価証券 4,800株

2117	ウェルネオシュガー	16,400	1,761.00	28,880,400	貸付有価証券 2,100株
2201	森永製菓	58,100	4,310.00	250,411,000	
2204	中村屋	7,900	3,175.00	25,082,500	貸付有価証券 1,100株
2206	江崎グリコ	90,900	3,620.00	329,058,000	貸付有価証券 19,700株
2207	名糖産業	12,500	1,743.00	21,787,500	
2209	井村屋グループ	17,400	2,300.00	40,020,000	貸付有価証券 1,900株
2211	不二家	21,800	2,509.00	54,696,200	貸付有価証券 2,500株
2212	山崎製パン	212,700	1,950.00	414,765,000	貸付有価証券 59,300株
2215	第一屋製パン	3,700	399.00	1,476,300	貸付有価証券 800株
2217	モロゾフ	10,300	3,780.00	38,934,000	
2220	亀田製菓	20,200	4,320.00	87,264,000	貸付有価証券 4,500株
2222	寿スピリッツ	33,800	10,200.00	344,760,000	貸付有価証券 4,700株
2229	カルビー	145,500	2,818.00	410,019,000	貸付有価証券 20,300株
2264	森永乳業	57,700	5,180.00	298,886,000	貸付有価証券 11,100株
2266	六甲バター	23,300	1,428.00	33,272,400	貸付有価証券 3,900株
2267	ヤクルト本社	227,100	9,560.00	2,171,076,000	貸付有価証券 13,800株
2269	明治ホールディングス	393,900	3,285.00	1,293,961,500	貸付有価証券 64,500株
2270	雪印メグミルク	76,800	1,994.00	153,139,200	貸付有価証券 10,700株
2281	プリマハム	42,700	2,287.00	97,654,900	貸付有価証券 7,200株
2282	日本ハム	124,300	3,835.00	476,690,500	貸付有価証券 21,600株
2286	林兼産業	6,500	493.00	3,204,500	貸付有価証券 1,500株
2288	丸大食品	32,000	1,524.00	48,768,000	貸付有価証券 4,800株
2292	S F o o d s	35,000	3,155.00	110,425,000	貸付有価証券 5,500株
2294	柿安本店	12,400	2,267.00	28,110,800	貸付有価証券 2,200株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	242,700	738.00	179,112,600	貸付有価証券 28,600株
2501	サッポロホールディングス	104,600	3,960.00	414,216,000	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	734,200	5,355.00	3,931,641,000	貸付有価証券 73,300株
2503	キリンホールディングス	1,433,900	2,152.50	3,086,469,750	貸付有価証券 304,200株
2531	宝ホールディングス	216,900	1,052.00	228,178,800	貸付有価証券 53,500株
2533	オエノンホールディングス	95,000	312.00	29,640,000	貸付有価証券 11,700株
2540	養命酒製造	10,500	1,876.00	19,698,000	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	248,900	1,549.00	385,546,100	貸付有価証券 31,200株
2587	サントリー食品インターナショナル	223,700	5,230.00	1,169,951,000	貸付有価証券 45,800株
2590	ダイドーグループホールディングス	18,000	5,130.00	92,340,000	貸付有価証券 3,500株
2593	伊藤園	107,700	4,165.00	448,570,500	貸付有価証券 13,500株
2594	キーコーヒー	35,600	2,104.00	74,902,400	貸付有価証券 6,200株
2597	ユニカフェ	6,500	911.00	5,921,500	貸付有価証券 1,100株
2599	ジャパンフーズ	3,100	1,103.00	3,419,300	貸付有価証券 900株
2602	日清オイリオグループ	44,800	3,395.00	152,096,000	
2607	不二製油グループ本社	74,000	2,065.00	152,810,000	貸付有価証券 10,800株
2612	かどや製油	1,900	3,580.00	6,802,000	貸付有価証券 500株
2613	J-オイルミルズ	32,400	1,600.00	51,840,000	貸付有価証券 6,200株
2801	キッコーマン	210,600	7,840.00	1,651,104,000	貸付有価証券 1,800株
2802	味の素	767,200	4,851.00	3,721,687,200	貸付有価証券 52,100株
2804	ブルドックソース	16,800	2,051.00	34,456,800	
2809	キューピー	170,800	2,335.00	398,818,000	貸付有価証券 15,000株
2810	ハウス食品グループ本社	97,300	3,210.00	312,333,000	貸付有価証券 23,600株
2811	カゴメ	148,000	3,395.00	502,460,000	貸付有価証券 28,200株
2812	焼津水産化学工業	8,700	837.00	7,281,900	貸付有価証券 2,200株
2815	アリアケジャパン	27,700	5,290.00	146,533,000	
2818	ピエトロ	2,800	1,827.00	5,115,600	貸付有価証券 200株
2819	エバラ食品工業	8,500	3,085.00	26,222,500	
2820	やまみ	1,900	1,467.00	2,787,300	貸付有価証券

					200株
2871	ニチレイ	145,600	3,040.00	442,624,000	貸付有価証券 10,700株
2875	東洋水産	160,600	5,990.00	961,994,000	貸付有価証券 22,800株
2882	イトアンドホールディングス	13,500	2,265.00	30,577,500	
2883	大冷	2,400	1,905.00	4,572,000	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	20,100	915.00	18,391,500	貸付有価証券 2,400株
2897	日清食品ホールディングス	111,700	12,360.00	1,380,612,000	貸付有価証券 3,900株
2899	永谷園ホールディングス	15,600	2,171.00	33,867,600	貸付有価証券 2,200株
2904	一正蒲鉾	8,300	799.00	6,631,700	貸付有価証券 1,700株
2908	フジッコ	32,600	1,936.00	63,113,600	貸付有価証券 5,600株
2910	ロック・フィールド	35,600	1,508.00	53,684,800	貸付有価証券 4,800株
2914	日本たばこ産業	2,091,800	3,015.00	6,306,777,000	貸付有価証券 117,400株
2915	ケンコーマヨネーズ	21,900	1,264.00	27,681,600	貸付有価証券 2,500株
2918	わらべや日洋ホールディングス	23,400	2,318.00	54,241,200	貸付有価証券 4,700株
2922	なとり	20,000	1,953.00	39,060,000	貸付有価証券 2,400株
2924	イフジ産業	3,700	1,075.00	3,977,500	
2929	ファーマフーズ	45,600	1,740.00	79,344,000	貸付有価証券 6,500株
2931	ユーグレナ	205,400	895.00	183,833,000	貸付有価証券 28,400株
2933	紀文食品	24,800	1,102.00	27,329,600	貸付有価証券 2,900株
2935	ピククルスホールディングス	18,600	1,196.00	22,245,600	
4404	ミヨシ油脂	6,900	1,002.00	6,913,800	貸付有価証券 1,700株
4526	理研ビタミン	27,500	2,031.00	55,852,500	
3001	片倉工業	29,700	1,786.00	53,044,200	貸付有価証券 4,000株
3002	グンゼ	23,000	4,695.00	107,985,000	貸付有価証券 3,200株
3101	東洋紡	139,700	1,020.00	142,494,000	貸付有価証券 17,200株
3103	ユニチカ	97,600	211.00	20,593,600	貸付有価証券 12,700株
3104	富士紡ホールディングス	12,700	3,130.00	39,751,000	貸付有価証券 2,100株

3106	倉敷紡績	24,100	2,407.00	58,008,700	
3109	シキボウ	11,000	1,014.00	11,154,000	貸付有価証券 4,300株
3201	日本毛織	85,200	1,034.00	88,096,800	貸付有価証券 14,300株
3202	ダイトウボウ	34,200	90.00	3,078,000	貸付有価証券 7,000株
3204	トーア紡コーポレーション	7,700	365.00	2,810,500	貸付有価証券 1,600株
3205	ダイドーリミテッド	30,100	296.00	8,909,600	貸付有価証券 7,100株
3302	帝国繊維	36,400	1,722.00	62,680,800	貸付有価証券 4,900株
3401	帝人	310,600	1,438.00	446,642,800	貸付有価証券 42,500株
3402	東レ	2,165,800	741.40	1,605,724,120	貸付有価証券 423,500株
3501	住江織物	3,600	2,357.00	8,485,200	
3512	日本フェルト	11,900	422.00	5,021,800	貸付有価証券 2,500株
3513	イチカワ	2,500	1,369.00	3,422,500	
3524	日東製網	2,300	1,421.00	3,268,300	貸付有価証券 700株
3529	アツギ	14,600	427.00	6,234,200	貸付有価証券 5,200株
3551	ダイニック	6,500	740.00	4,810,000	貸付有価証券 1,600株
3569	セーレン	62,400	2,286.00	142,646,400	貸付有価証券 8,600株
3571	ソトー	7,700	812.00	6,252,400	貸付有価証券 1,700株
3577	東海染工	2,400	1,191.00	2,858,400	
3580	小松マテーレ	46,900	685.00	32,126,500	貸付有価証券 7,100株
3591	ワコールホールディングス	62,300	2,720.00	169,456,000	貸付有価証券 4,800株
3593	ホギメディカル	43,400	3,400.00	147,560,000	貸付有価証券 7,200株
3607	クラウディアホールディングス	4,500	578.00	2,601,000	貸付有価証券 1,100株
3608	T S Iホールディングス	108,800	696.00	75,724,800	貸付有価証券 14,600株
3611	マツオカコーポレーション	6,100	1,205.00	7,350,500	貸付有価証券 1,200株
3612	ワールド	41,500	1,595.00	66,192,500	貸付有価証券 5,900株
8011	三陽商会	9,300	1,676.00	15,586,800	貸付有価証券 2,300株

8013	ナイガイ	7,100	270.00	1,917,000	貸付有価証券 2,800株
8016	オンワードホールディングス	209,600	388.00	81,324,800	貸付有価証券 26,100株
8029	ルックホールディングス	5,700	2,369.00	13,503,300	貸付有価証券 1,400株
8107	キムラタン	120,700	22.00	2,655,400	貸付有価証券 33,000株
8111	ゴールドウイン	57,300	12,220.00	700,206,000	貸付有価証券 9,900株
8114	デサント	55,700	4,410.00	245,637,000	貸付有価証券 14,800株
8118	キング	9,900	600.00	5,940,000	貸付有価証券 2,100株
8127	ヤマトインターナショナル	15,600	282.00	4,399,200	貸付有価証券 3,500株
3708	特種東海製紙	14,400	3,035.00	43,704,000	貸付有価証券 2,800株
3861	王子ホールディングス	1,346,600	534.00	719,084,400	貸付有価証券 10,600株
3863	日本製紙	168,400	1,119.00	188,439,600	貸付有価証券 35,200株
3864	三菱製紙	26,900	495.00	13,315,500	貸付有価証券 5,000株
3865	北越コーポレーション	204,300	918.00	187,547,400	貸付有価証券 28,800株
3877	中越パルプ工業	8,000	1,089.00	8,712,000	貸付有価証券 1,900株
3878	巴川製紙所	6,200	666.00	4,129,200	貸付有価証券 1,300株
3880	大王製紙	142,800	1,045.00	149,226,000	
3896	阿波製紙	4,700	552.00	2,594,400	貸付有価証券 1,500株
3941	レンゴー	294,400	906.00	266,726,400	
3946	トーモク	18,700	1,883.00	35,212,100	
3950	ザ・パック	24,000	3,190.00	76,560,000	貸付有価証券 3,300株
2930	北の達人コーポレーション	136,200	286.00	38,953,200	貸付有価証券 20,400株
3405	クラレ	513,900	1,263.00	649,055,700	貸付有価証券 99,500株
3407	旭化成	2,018,700	963.10	1,944,209,970	貸付有価証券 413,100株
3553	共和レザー	11,400	539.00	6,144,600	貸付有価証券 2,400株
4004	レゾナック・ホールディングス	312,400	2,175.00	679,470,000	貸付有価証券 30,900株
4005	住友化学	2,398,000	448.00	1,074,304,000	

4008	住友精化	13,500	4,385.00	59,197,500	
4021	日産化学	153,500	6,070.00	931,745,000	貸付有価証券 41,500株
4022	ラサ工業	12,500	2,197.00	27,462,500	貸付有価証券 1,500株
4023	クレハ	27,600	8,690.00	239,844,000	貸付有価証券 100株
4025	多木化学	12,600	4,390.00	55,314,000	貸付有価証券 1,300株
4027	テイカ	21,700	1,239.00	26,886,300	貸付有価証券 3,200株
4028	石原産業	58,500	1,292.00	75,582,000	貸付有価証券 7,800株
4031	片倉コープアグリ	4,700	1,695.00	7,966,500	貸付有価証券 1,100株
4041	日本曹達	34,700	4,565.00	158,405,500	貸付有価証券 600株
4042	東ソー	431,500	1,705.00	735,707,500	
4043	トクヤマ	104,400	2,145.00	223,938,000	
4044	セントラル硝子	51,900	2,875.00	149,212,500	貸付有価証券 8,900株
4045	東亜合成	162,100	1,227.00	198,896,700	貸付有価証券 42,900株
4046	大阪ソーダ	19,400	3,960.00	76,824,000	貸付有価証券 4,400株
4047	関東電化工業	62,500	1,021.00	63,812,500	貸付有価証券 200株
4061	デンカ	117,600	2,628.00	309,052,800	貸付有価証券 11,700株
4063	信越化学工業	2,687,000	3,970.00	10,667,390,000	
4064	日本カーバイド工業	7,500	1,335.00	10,012,500	貸付有価証券 1,500株
4078	堺化学工業	24,600	1,866.00	45,903,600	貸付有価証券 2,800株
4082	第一稀元素化学工業	29,400	991.00	29,135,400	貸付有価証券 6,600株
4088	エア・ウォーター	305,000	1,826.00	556,930,000	
4091	日本酸素ホールディングス	313,600	2,754.00	863,654,400	貸付有価証券 41,400株
4092	日本化学工業	10,800	1,818.00	19,634,400	貸付有価証券 800株
4093	東邦アセチレン	4,200	1,384.00	5,812,800	貸付有価証券 600株
4095	日本パーカライジング	160,000	1,053.00	168,480,000	貸付有価証券 21,900株
4097	高圧ガス工業	47,000	762.00	35,814,000	貸付有価証券 6,900株
4098	チタン工業	2,400	1,428.00	3,427,200	貸付有価証券

					500 株
4099	四国化成ホールディングス	38,400	1,428.00	54,835,200	貸付有価証券 6,700 株
4100	戸田工業	7,400	2,432.00	17,996,800	貸付有価証券 1,000 株
4109	ステラ ケミファ	19,100	2,762.00	52,754,200	貸付有価証券 2,400 株
4112	保土谷化学工業	9,100	3,200.00	29,120,000	
4114	日本触媒	49,200	5,220.00	256,824,000	
4116	大日精化工業	22,500	1,889.00	42,502,500	貸付有価証券 5,900 株
4118	カネカ	73,900	3,680.00	271,952,000	貸付有価証券 8,300 株
4182	三菱瓦斯化学	241,400	1,970.00	475,558,000	
4183	三井化学	266,500	3,450.00	919,425,000	貸付有価証券 24,100 株
4185	J S R	301,800	3,010.00	908,418,000	貸付有価証券 40,500 株
4186	東京応化工業	56,600	7,120.00	402,992,000	貸付有価証券 7,400 株
4187	大阪有機化学工業	24,300	2,077.00	50,471,100	
4188	三菱ケミカルグループ	2,181,400	796.20	1,736,830,680	貸付有価証券 318,800 株
4189	KHネオケム	53,800	2,302.00	123,847,600	貸付有価証券 10,600 株
4202	ダイセル	475,300	1,138.00	540,891,400	
4203	住友ベークライト	47,900	5,060.00	242,374,000	貸付有価証券 9,500 株
4204	積水化学工業	661,100	1,918.00	1,267,989,800	
4205	日本ゼオン	193,900	1,468.00	284,645,200	貸付有価証券 39,100 株
4206	アイカ工業	81,600	3,010.00	245,616,000	
4208	U B E	166,600	2,141.00	356,690,600	貸付有価証券 4,600 株
4212	積水樹脂	47,000	2,139.00	100,533,000	貸付有価証券 11,200 株
4215	タキロンシーアイ	70,600	527.00	37,206,200	貸付有価証券 16,300 株
4216	旭有機材	21,500	3,215.00	69,122,500	
4218	ニチバン	20,000	1,932.00	38,640,000	貸付有価証券 3,200 株
4220	リケンテクノス	69,600	603.00	41,968,800	貸付有価証券 15,900 株
4221	大倉工業	15,000	2,113.00	31,695,000	貸付有価証券 2,000 株
4228	積水化成成品工業	45,400	432.00	19,612,800	貸付有価証券

					5,800株
4229	群栄化学工業	7,600	2,680.00	20,368,000	貸付有価証券 1,000株
4231	タイガースポリマー	10,100	520.00	5,252,000	貸付有価証券 2,200株
4238	ミライアル	6,700	1,486.00	9,956,200	貸付有価証券 1,500株
4245	ダイキアクシス	7,300	740.00	5,402,000	貸付有価証券 1,500株
4246	ダイキョーニシカワ	71,300	718.00	51,193,400	貸付有価証券 9,100株
4248	竹本容器	6,700	797.00	5,339,900	貸付有価証券 1,600株
4249	森六ホールディングス	16,400	1,948.00	31,947,200	貸付有価証券 2,300株
4251	恵和	20,900	1,355.00	28,319,500	貸付有価証券 2,400株
4272	日本化薬	246,900	1,248.00	308,131,200	貸付有価証券 7,200株
4275	カーリットホールディングス	29,000	695.00	20,155,000	貸付有価証券 4,600株
4362	日本精化	18,400	2,537.00	46,680,800	貸付有価証券 3,500株
4368	扶桑化学工業	30,000	3,595.00	107,850,000	貸付有価証券 4,400株
4369	トリケミカル研究所	43,100	2,230.00	96,113,000	貸付有価証券 4,700株
4401	ADEKA	112,700	2,308.00	260,111,600	
4403	日油	100,000	6,240.00	624,000,000	貸付有価証券 16,300株
4406	新日本理化	29,800	228.00	6,794,400	貸付有価証券 7,200株
4410	ハリマ化成グループ	13,900	861.00	11,967,900	貸付有価証券 3,600株
4452	花王	787,200	5,180.00	4,077,696,000	貸付有価証券 158,400株
4461	第一工業製薬	11,600	1,915.00	22,214,000	貸付有価証券 1,600株
4462	石原ケミカル	14,800	1,525.00	22,570,000	貸付有価証券 2,200株
4463	日華化学	8,000	853.00	6,824,000	貸付有価証券 1,500株
4465	ニイタカ	3,900	2,217.00	8,646,300	
4471	三洋化成工業	19,900	4,225.00	84,077,500	貸付有価証券 1,300株
4531	有機合成薬品工業	14,700	296.00	4,351,200	貸付有価証券 4,600株
4611	大日本塗料	39,400	913.00	35,972,200	貸付有価証券 4,900株

4612	日本ペイントホールディングス	1,430,400	1,258.00	1,799,443,200	貸付有価証券 29,900株
4613	関西ペイント	296,100	2,129.00	630,396,900	貸付有価証券 48,700株
4615	神東塗料	16,500	137.00	2,260,500	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	53,100	1,109.00	58,887,900	
4619	日本特殊塗料	12,600	1,035.00	13,041,000	貸付有価証券 3,200株
4620	藤倉化成	43,400	426.00	18,488,400	貸付有価証券 5,900株
4626	太陽ホールディングス	49,200	2,611.00	128,461,200	貸付有価証券 6,200株
4631	D I C	126,300	2,526.00	319,033,800	貸付有価証券 25,200株
4633	サカタインクス	71,900	1,102.00	79,233,800	貸付有価証券 13,700株
4634	東洋インキS Cホールディングス	63,300	2,190.00	138,627,000	貸付有価証券 9,200株
4636	T & K TOKA	28,700	1,139.00	32,689,300	貸付有価証券 4,700株
4901	富士フイルムホールディングス	621,100	7,710.00	4,788,681,000	貸付有価証券 95,100株
4911	資生堂	675,800	6,560.00	4,433,248,000	貸付有価証券 85,800株
4912	ライオン	388,300	1,408.00	546,726,400	貸付有価証券 55,600株
4914	高砂香料工業	21,900	2,624.00	57,465,600	貸付有価証券 2,800株
4917	マンダム	69,900	1,587.00	110,931,300	
4919	ミルボン	48,000	5,640.00	270,720,000	貸付有価証券 5,700株
4921	ファンケル	141,600	2,323.00	328,936,800	貸付有価証券 18,000株
4922	コーセー	65,800	15,150.00	996,870,000	貸付有価証券 8,300株
4923	コタ	29,800	1,648.00	49,110,400	貸付有価証券 800株
4926	シーボン	2,800	1,609.00	4,505,200	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	165,900	2,036.00	337,772,400	貸付有価証券 18,900株
4928	ノエビアホールディングス	28,900	5,350.00	154,615,000	貸付有価証券 4,000株
4929	アジュバンホールディングス	4,800	926.00	4,444,800	貸付有価証券 1,400株
4931	新日本製薬	18,500	1,382.00	25,567,000	貸付有価証券 1,300株
4936	アクシージア	16,400	1,175.00	19,270,000	



4951	エステー	25,000	1,584.00	39,600,000	
4955	アグロ カネシヨウ	12,900	1,791.00	23,103,900	貸付有価証券 1,700株
4956	コニシ	54,000	2,207.00	119,178,000	貸付有価証券 11,200株
4958	長谷川香料	61,800	3,225.00	199,305,000	貸付有価証券 9,200株
4963	星光PMC	10,100	565.00	5,706,500	貸付有価証券 2,500株
4967	小林製薬	94,200	8,250.00	777,150,000	貸付有価証券 21,600株
4968	荒川化学工業	27,400	991.00	27,153,400	貸付有価証券 4,000株
4971	メック	26,600	2,616.00	69,585,600	貸付有価証券 4,800株
4973	日本高純度化学	8,100	2,482.00	20,104,200	
4974	タカラバイオ	87,200	1,646.00	143,531,200	貸付有価証券 11,600株
4975	J C U	36,200	3,295.00	119,279,000	
4977	新田ゼラチン	12,300	879.00	10,811,700	貸付有価証券 2,800株
4979	O A Tアグリオ	8,100	1,652.00	13,381,200	貸付有価証券 1,600株
4980	デクセリアルズ	93,500	2,649.00	247,681,500	貸付有価証券 11,400株
4985	アース製薬	29,300	5,180.00	151,774,000	貸付有価証券 3,300株
4992	北興化学工業	32,600	902.00	29,405,200	貸付有価証券 3,000株
4994	大成ラミック	10,200	3,015.00	30,753,000	貸付有価証券 1,400株
4996	クミアイ化学工業	128,600	906.00	116,511,600	
4997	日本農薬	59,400	657.00	39,025,800	貸付有価証券 7,900株
5142	アキレス	20,400	1,464.00	29,865,600	貸付有価証券 1,700株
5208	有沢製作所	52,600	1,258.00	66,170,800	貸付有価証券 9,500株
6988	日東電工	234,900	9,380.00	2,203,362,000	貸付有価証券 30,600株
7874	レック	46,100	859.00	39,599,900	貸付有価証券 4,700株
7888	三光合成	40,700	526.00	21,408,200	
7908	きもと	32,900	184.00	6,053,600	貸付有価証券 7,500株
7917	藤森工業	25,600	3,170.00	81,152,000	貸付有価証券 6,300株
7925	前澤化成工業	20,900	1,615.00	33,753,500	貸付有価証券

					2,800株
7931	未来工業	11,600	2,326.00	26,981,600	貸付有価証券 2,400株
7940	ウェーブロックホールディングス	7,500	603.00	4,522,500	貸付有価証券 1,500株
7942	J S P	22,700	1,613.00	36,615,100	貸付有価証券 2,600株
7947	エフピコ	61,200	3,140.00	192,168,000	貸付有価証券 9,800株
7958	天馬	27,500	2,427.00	66,742,500	貸付有価証券 3,000株
7970	信越ポリマー	59,800	1,351.00	80,789,800	
7971	東リ	49,000	307.00	15,043,000	貸付有価証券 11,000株
7988	ニフコ	116,800	3,835.00	447,928,000	貸付有価証券 16,300株
7995	バルカー	27,100	3,525.00	95,527,500	
8113	ユニ・チャーム	674,300	5,349.00	3,606,830,700	貸付有価証券 151,000株
9385	ショーエイコーポレーション	5,700	563.00	3,209,100	貸付有価証券 600株
4151	協和キリン	391,000	2,638.00	1,031,458,000	貸付有価証券 75,900株
4502	武田薬品工業	2,864,300	4,449.00	12,743,270,700	貸付有価証券 369,200株
4503	アステラス製薬	3,057,500	2,129.00	6,509,417,500	
4506	住友ファーマ	240,100	791.00	189,919,100	貸付有価証券 14,600株
4507	塩野義製薬	408,100	6,150.00	2,509,815,000	貸付有価証券 43,500株
4512	わかもと製薬	20,900	251.00	5,245,900	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	76,300	6,210.00	473,823,000	
4519	中外製薬	1,013,200	3,575.00	3,622,190,000	貸付有価証券 213,200株
4521	科研製薬	55,400	3,645.00	201,933,000	貸付有価証券 7,600株
4523	エーザイ	393,700	7,970.00	3,137,789,000	貸付有価証券 68,300株
4527	ロート製薬	313,500	2,831.00	887,518,500	貸付有価証券 32,500株
4528	小野薬品工業	624,400	2,507.50	1,565,683,000	
4530	久光製薬	71,900	3,755.00	269,984,500	貸付有価証券 13,100株
4534	持田製薬	37,200	3,600.00	133,920,000	貸付有価証券 6,200株
4536	参天製薬	589,700	1,221.00	720,023,700	貸付有価証券 82,400株

4538	扶桑薬品工業	10,300	2,029.00	20,898,700	貸付有価証券 1,600株
4539	日本ケミファ	2,300	1,807.00	4,156,100	貸付有価証券 1,100株
4540	ツムラ	101,900	2,717.00	276,862,300	
4547	キッセイ薬品工業	50,000	2,924.00	146,200,000	貸付有価証券 7,800株
4548	生化学工業	61,700	840.00	51,828,000	貸付有価証券 12,400株
4549	栄研化学	52,500	1,562.00	82,005,000	貸付有価証券 10,300株
4551	鳥居薬品	17,400	3,475.00	60,465,000	貸付有価証券 2,700株
4552	J C R ファーマ	109,600	1,193.00	130,752,800	貸付有価証券 19,200株
4553	東和薬品	49,700	1,898.00	94,330,600	貸付有価証券 5,700株
4554	富士製薬工業	23,900	1,185.00	28,321,500	貸付有価証券 3,200株
4559	ゼリア新薬工業	44,900	2,446.00	109,825,400	貸付有価証券 6,300株
4565	そーせいグループ	111,200	2,827.00	314,362,400	
4568	第一三共	2,819,700	4,600.00	12,970,620,000	
4569	杏林製薬	70,200	1,733.00	121,656,600	貸付有価証券 9,800株
4574	大幸薬品	58,700	377.00	22,129,900	貸付有価証券 10,200株
4577	ダイト	22,600	2,508.00	56,680,800	
4578	大塚ホールディングス	740,500	4,731.00	3,503,305,500	貸付有価証券 10,500株
4581	大正製薬ホールディングス	71,900	5,440.00	391,136,000	貸付有価証券 9,800株
4587	ペプチドリーム	156,900	1,783.00	279,752,700	貸付有価証券 22,400株
4886	あすか製薬ホールディングス	33,200	1,241.00	41,201,200	貸付有価証券 3,700株
4887	サワイグループホールディングス	74,000	3,700.00	273,800,000	貸付有価証券 9,100株
3315	日本コークス工業	291,900	91.00	26,562,900	貸付有価証券 37,400株
5011	ニチレキ	38,200	1,753.00	66,964,600	貸付有価証券 2,500株
5013	ユシロ化学工業	16,800	903.00	15,170,400	貸付有価証券 2,500株
5015	ビービー・カストロール	7,700	907.00	6,983,900	貸付有価証券 1,600株
5017	富士石油	66,000	259.00	17,094,000	
5018	MORESCO	7,100	1,146.00	8,136,600	貸付有価証券

					1,600株
5019	出光興産	359,500	2,790.00	1,003,005,000	貸付有価証券 49,900株
5020	E N E O Sホールディングス	5,490,100	490.20	2,691,247,020	貸付有価証券 688,800株
5021	コスモエネルギーホールディングス	128,000	4,145.00	530,560,000	貸付有価証券 14,600株
5101	横浜ゴム	184,200	2,954.00	544,126,800	貸付有価証券 42,200株
5105	TOYO TIRE	186,000	1,652.00	307,272,000	貸付有価証券 37,900株
5108	ブリヂストン	1,033,600	5,538.00	5,724,076,800	貸付有価証券 61,900株
5110	住友ゴム工業	317,400	1,268.00	402,463,200	貸付有価証券 39,800株
5121	藤倉コンポジット	17,200	878.00	15,101,600	貸付有価証券 3,800株
5122	オカモト	18,000	4,140.00	74,520,000	貸付有価証券 2,700株
5185	フコク	17,000	1,085.00	18,445,000	貸付有価証券 1,900株
5186	ニッタ	32,900	3,120.00	102,648,000	貸付有価証券 5,000株
5191	住友理工	62,800	787.00	49,423,600	貸付有価証券 600株
5192	三ツ星ベルト	47,200	3,925.00	185,260,000	貸付有価証券 5,800株
5195	バンドー化学	51,300	1,128.00	57,866,400	貸付有価証券 7,800株
3110	日東紡績	36,400	1,871.00	68,104,400	貸付有価証券 6,600株
5201	A G C	329,400	5,110.00	1,683,234,000	
5202	日本板硝子	165,000	641.00	105,765,000	貸付有価証券 32,900株
5204	石塚硝子	3,400	1,559.00	5,300,600	貸付有価証券 1,100株
5210	日本山村硝子	7,400	716.00	5,298,400	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	132,100	2,506.00	331,042,600	貸付有価証券 28,000株
5218	オハラ	15,400	1,159.00	17,848,600	貸付有価証券 2,700株
5232	住友大阪セメント	45,600	3,510.00	160,056,000	貸付有価証券 12,200株
5233	太平洋セメント	206,100	2,421.00	498,968,100	貸付有価証券 28,000株
5262	日本ヒューム	28,300	740.00	20,942,000	貸付有価証券 1,600株
5269	日本コンクリート工業	62,800	270.00	16,956,000	貸付有価証券

					17,100株
5273	三谷セキサン	13,600	5,140.00	69,904,000	貸付有価証券 2,100株
5288	アジアパイルホールディングス	50,600	626.00	31,675,600	貸付有価証券 6,300株
5301	東海カーボン	271,500	1,272.00	345,348,000	貸付有価証券 38,500株
5302	日本カーボン	18,600	4,335.00	80,631,000	貸付有価証券 3,700株
5310	東洋炭素	20,300	4,520.00	91,756,000	貸付有価証券 2,600株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	16,100	4,790.00	77,119,000	貸付有価証券 2,800株
5332	TOTO	213,600	4,605.00	983,628,000	貸付有価証券 46,800株
5333	日本碍子	376,300	1,707.00	642,344,100	貸付有価証券 30,200株
5334	日本特殊陶業	246,400	2,550.00	628,320,000	貸付有価証券 34,600株
5337	ダントーホールディングス	14,000	643.00	9,002,000	貸付有価証券 3,300株
5344	MARUWA	11,900	17,590.00	209,321,000	
5351	品川リフラクトリーズ	9,100	4,970.00	45,227,000	
5352	黒崎播磨	6,600	6,240.00	41,184,000	貸付有価証券 900株
5357	ヨータイ	21,600	1,421.00	30,693,600	貸付有価証券 3,500株
5363	東京窯業	21,200	353.00	7,483,600	貸付有価証券 5,600株
5367	ニッカトー	8,900	603.00	5,366,700	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	25,800	8,040.00	207,432,000	貸付有価証券 4,000株
5388	クニミネ工業	6,700	937.00	6,277,900	貸付有価証券 1,800株
5391	エーアンドエーマテリアル	3,600	1,022.00	3,679,200	貸付有価証券 800株
5393	ニチアス	81,800	2,788.00	228,058,400	貸付有価証券 2,400株
7943	ニチハ	40,500	2,966.00	120,123,000	貸付有価証券 6,200株
5401	日本製鉄	1,490,900	2,859.00	4,262,483,100	貸付有価証券 281,500株
5406	神戸製鋼所	669,600	1,142.00	764,683,200	貸付有価証券 80,100株
5408	中山製鋼所	68,500	814.00	55,759,000	貸付有価証券 6,100株
5410	合同製鐵	16,600	3,065.00	50,879,000	貸付有価証券 2,400株

5411	J F Eホールディングス	889,800	1,799.00	1,600,750,200	
5423	東京製鐵	93,600	1,281.00	119,901,600	
5440	共英製鋼	37,900	1,786.00	67,689,400	貸付有価証券 6,800株
5444	大和工業	54,900	5,430.00	298,107,000	貸付有価証券 11,300株
5445	東京鐵鋼	15,800	2,479.00	39,168,200	貸付有価証券 1,800株
5449	大阪製鐵	15,300	1,303.00	19,935,900	貸付有価証券 2,400株
5451	淀川製鋼所	37,800	2,895.00	109,431,000	貸付有価証券 5,900株
5461	中部鋼板	27,300	1,996.00	54,490,800	貸付有価証券 3,700株
5463	丸一鋼管	101,400	3,160.00	320,424,000	貸付有価証券 300株
5464	モリ工業	5,200	3,160.00	16,432,000	貸付有価証券 1,300株
5471	大同特殊鋼	41,900	5,140.00	215,366,000	
5476	日本高周波鋼業	7,800	350.00	2,730,000	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	24,300	4,180.00	101,574,000	貸付有価証券 1,600株
5481	山陽特殊製鋼	32,900	2,611.00	85,901,900	
5482	愛知製鋼	19,200	2,709.00	52,012,800	貸付有価証券 2,500株
5491	日本金属	5,300	940.00	4,982,000	貸付有価証券 1,000株
5541	大平洋金属	23,600	1,599.00	37,736,400	貸付有価証券 5,000株
5563	新日本電工	212,800	299.00	63,627,200	貸付有価証券 40,200株
5602	栗本鐵工所	15,800	2,058.00	32,516,400	貸付有価証券 2,200株
5603	虹技	2,700	1,182.00	3,191,400	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鐵管	2,200	1,056.00	2,323,200	貸付有価証券 500株
5632	三菱製鋼	20,900	1,162.00	24,285,800	
5658	日亜鋼業	24,100	317.00	7,639,700	貸付有価証券 6,400株
5659	日本精線	4,500	4,470.00	20,115,000	貸付有価証券 700株
5698	エンビプロ・ホールディングス	14,100	598.00	8,431,800	貸付有価証券 3,200株
6319	シンニッタン	25,700	247.00	6,347,900	貸付有価証券 6,800株
7305	新家工業	4,400	2,025.00	8,910,000	貸付有価証券

					1,000株
5702	大紀アルミニウム工業所	47,400	1,368.00	64,843,200	貸付有価証券 7,200株
5703	日本軽金属ホールディングス	89,800	1,404.00	126,079,200	貸付有価証券 2,100株
5706	三井金属鉱業	96,900	3,060.00	296,514,000	貸付有価証券 12,100株
5707	東邦亜鉛	19,700	1,816.00	35,775,200	貸付有価証券 4,000株
5711	三菱マテリアル	222,200	2,225.00	494,395,000	貸付有価証券 29,000株
5713	住友金属鉱山	386,100	4,326.00	1,670,268,600	貸付有価証券 56,200株
5714	DOWAホールディングス	74,800	4,330.00	323,884,000	貸付有価証券 17,100株
5715	古河機械金属	48,800	1,328.00	64,806,400	貸付有価証券 7,800株
5721	エス・サイエンス	94,300	26.00	2,451,800	貸付有価証券 19,300株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	48,900	2,737.00	133,839,300	貸付有価証券 7,200株
5727	東邦チタニウム	60,200	1,723.00	103,724,600	貸付有価証券 11,100株
5741	UACJ	46,700	2,644.00	123,474,800	貸付有価証券 9,800株
5757	CKサンエツ	8,000	4,290.00	34,320,000	貸付有価証券 900株
5801	古河電気工業	110,900	2,448.00	271,483,200	貸付有価証券 13,600株
5802	住友電気工業	1,149,800	1,745.50	2,006,975,900	
5803	フジクラ	357,100	920.00	328,532,000	貸付有価証券 88,000株
5805	SWCC	37,200	1,752.00	65,174,400	貸付有価証券 3,600株
5809	タツタ電線	67,700	715.00	48,405,500	貸付有価証券 8,700株
5819	カナレ電気	3,100	1,349.00	4,181,900	
5821	平河ヒューテック	19,100	1,372.00	26,205,200	貸付有価証券 1,600株
5851	リョービ	35,500	1,549.00	54,989,500	貸付有価証券 5,400株
5852	アーレスティ	22,600	583.00	13,175,800	貸付有価証券 5,700株
5857	アサヒホールディングス	134,700	1,993.00	268,457,100	貸付有価証券 23,200株
3421	稲葉製作所	17,300	1,492.00	25,811,600	貸付有価証券 2,500株
3431	宮地エンジニアリンググループ	9,200	3,985.00	36,662,000	

3433	トーカロ	91,500	1,320.00	120,780,000	貸付有価証券 12,100株
3434	アルファC o	7,500	1,093.00	8,197,500	貸付有価証券 1,600株
3436	SUMCO	633,900	1,851.00	1,173,348,900	貸付有価証券 52,400株
3443	川田テクノロジーズ	7,900	4,030.00	31,837,000	貸付有価証券 900株
3445	RS Technologies	22,200	2,958.00	65,667,600	貸付有価証券 2,600株
3446	ジェイテックコーポレーション	2,700	2,357.00	6,363,900	貸付有価証券 500株
3447	信和	13,100	727.00	9,523,700	貸付有価証券 1,900株
5901	東洋製罐グループホールディングス	220,300	2,000.00	440,600,000	貸付有価証券 27,900株
5902	ホッカンホールディングス	17,900	1,394.00	24,952,600	貸付有価証券 2,400株
5909	コロナ	18,600	903.00	16,795,800	貸付有価証券 2,400株
5911	横河ブリッジホールディングス	41,700	2,239.00	93,366,300	貸付有価証券 8,200株
5915	駒井ハルテック	3,300	1,818.00	5,999,400	貸付有価証券 800株
5923	高田機工	1,800	2,823.00	5,081,400	
5929	三和ホールディングス	306,700	1,523.00	467,104,100	
5930	文化シャッター	95,800	1,127.00	107,966,600	貸付有価証券 20,000株
5932	三協立山	38,100	685.00	26,098,500	
5933	アルインコ	25,400	991.00	25,171,400	貸付有価証券 3,200株
5936	東洋シャッター	4,700	556.00	2,613,200	貸付有価証券 1,000株
5938	L I X I L	485,100	2,000.00	970,200,000	貸付有価証券 100株
5942	日本ファイルコン	13,300	476.00	6,330,800	貸付有価証券 3,300株
5943	ノーリツ	49,000	1,844.00	90,356,000	貸付有価証券 8,700株
5946	長府製作所	33,500	2,357.00	78,959,500	貸付有価証券 4,500株
5947	リンナイ	181,100	3,270.00	592,197,000	
5951	ダイニチ工業	10,100	748.00	7,554,800	貸付有価証券 2,400株
5957	日東精工	48,300	609.00	29,414,700	貸付有価証券 6,100株
5958	三洋工業	2,600	1,911.00	4,968,600	



5959	岡部	53,500	788.00	42,158,000	
5970	ジーテクト	37,100	1,521.00	56,429,100	
5975	東プレ	58,700	1,449.00	85,056,300	貸付有価証券 8,200株
5976	高周波熱錬	51,300	883.00	45,297,900	貸付有価証券 12,800株
5981	東京製綱	19,600	1,141.00	22,363,600	貸付有価証券 6,800株
5985	サンコール	18,100	577.00	10,443,700	貸付有価証券 3,000株
5986	モリテック スチール	16,500	288.00	4,752,000	貸付有価証券 4,500株
5988	パイオラックス	45,900	1,945.00	89,275,500	貸付有価証券 6,500株
5989	エイチワン	34,300	678.00	23,255,400	貸付有価証券 4,300株
5991	日本発條	294,500	1,004.00	295,678,000	
5992	中央発條	24,700	707.00	17,462,900	貸付有価証券 2,800株
5998	アドバネクス	2,800	1,058.00	2,962,400	貸付有価証券 600株
7989	立川ブラインド工業	15,000	1,258.00	18,870,000	貸付有価証券 1,100株
8155	三益半導体工業	25,700	2,695.00	69,261,500	貸付有価証券 1,900株
1909	日本ドライケミカル	4,800	1,736.00	8,332,800	貸付有価証券 1,100株
5631	日本製鋼所	89,800	2,476.00	222,344,800	
6005	三浦工業	136,100	3,690.00	502,209,000	貸付有価証券 32,300株
6013	タクマ	100,200	1,409.00	141,181,800	
6101	ツガミ	72,400	1,332.00	96,436,800	貸付有価証券 6,000株
6103	オークマ	32,600	6,060.00	197,556,000	貸付有価証券 8,500株
6104	芝浦機械	32,600	3,150.00	102,690,000	貸付有価証券 4,900株
6113	アマダ	520,100	1,275.00	663,127,500	貸付有価証券 24,500株
6118	アイダエンジニアリング	67,000	882.00	59,094,000	貸付有価証券 11,800株
6121	TAKI SAWA	6,100	1,325.00	8,082,500	貸付有価証券 1,400株
6134	FUJ I	141,700	2,422.00	343,197,400	貸付有価証券 18,800株
6135	牧野フライス製作所	36,100	4,830.00	174,363,000	貸付有価証券 5,200株
6136	オーエスジー	155,600	1,933.00	300,774,800	貸付有価証券

					16,900株
6138	ダイジェット工業	2,200	880.00	1,936,000	貸付有価証券 500株
6140	旭ダイヤモンド工業	91,000	917.00	83,447,000	貸付有価証券 11,500株
6141	DMG森精機	197,600	2,156.00	426,025,600	貸付有価証券 42,600株
6143	ソディック	89,900	728.00	65,447,200	貸付有価証券 14,700株
6146	ディスコ	156,900	17,170.00	2,693,973,000	貸付有価証券 4,400株
6151	日東工器	15,800	2,033.00	32,121,400	貸付有価証券 2,400株
6157	日進工具	27,200	1,167.00	31,742,400	貸付有価証券 2,600株
6165	パンチ工業	18,200	551.00	10,028,200	貸付有価証券 3,900株
6167	富士ダイス	10,700	721.00	7,714,700	貸付有価証券 3,500株
6203	豊和工業	10,900	840.00	9,156,000	貸付有価証券 3,400株
6208	石川製作所	5,500	1,359.00	7,474,500	貸付有価証券 1,000株
6210	東洋機械金属	13,800	660.00	9,108,000	貸付有価証券 3,100株
6217	津田駒工業	3,600	486.00	1,749,600	貸付有価証券 800株
6218	エンシュウ	4,700	704.00	3,308,800	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	51,800	1,774.00	91,893,200	貸付有価証券 10,000株
6235	オプトラン	48,200	2,206.00	106,329,200	貸付有価証券 4,900株
6236	NCホールディングス	5,100	1,982.00	10,108,200	貸付有価証券 1,500株
6237	イワキポンプ	21,700	1,280.00	27,776,000	貸付有価証券 2,100株
6238	フリー	34,100	1,146.00	39,078,600	貸付有価証券 5,500株
6240	ヤマシンフィルタ	77,700	332.00	25,796,400	貸付有価証券 9,400株
6247	日阪製作所	31,600	949.00	29,988,400	貸付有価証券 5,400株
6250	やまびこ	53,200	1,341.00	71,341,200	貸付有価証券 8,500株
6254	野村マイクロ・サイエンス	11,000	4,305.00	47,355,000	貸付有価証券 1,000株
6258	平田機工	15,600	6,880.00	107,328,000	貸付有価証券 2,400株

6262	PEGASUS	36,000	613.00	22,068,000	貸付有価証券 4,400株
6264	マルマエ	14,200	1,622.00	23,032,400	貸付有価証券 2,000株
6266	タツモ	17,900	1,846.00	33,043,400	
6268	ナブテスコ	204,500	3,125.00	639,062,500	貸付有価証券 36,400株
6269	三井海洋開発	40,800	1,379.00	56,263,200	貸付有価証券 4,800株
6272	レオン自動機	34,300	1,285.00	44,075,500	貸付有価証券 4,300株
6273	SMC	105,700	70,210.00	7,421,197,000	
6277	ホソカワミクロン	22,900	2,956.00	67,692,400	貸付有価証券 3,200株
6278	ユニオンツール	14,300	3,290.00	47,047,000	貸付有価証券 3,400株
6282	オイレス工業	45,500	1,846.00	83,993,000	貸付有価証券 5,700株
6284	日精エー・エス・ビー機械	13,000	4,220.00	54,860,000	貸付有価証券 500株
6287	サトーホールディングス	46,400	2,322.00	107,740,800	貸付有価証券 6,200株
6289	技研製作所	30,600	2,131.00	65,208,600	貸付有価証券 3,800株
6291	日本エアータック	16,400	1,115.00	18,286,000	貸付有価証券 300株
6292	カワタ	6,300	941.00	5,928,300	貸付有価証券 1,300株
6293	日精樹脂工業	24,200	1,020.00	24,684,000	貸付有価証券 6,100株
6294	オカダアイヨン	6,700	1,780.00	11,926,000	貸付有価証券 1,400株
6298	ワイエイシイホールディングス	8,500	2,873.00	24,420,500	貸付有価証券 1,900株
6301	小松製作所	1,527,200	3,278.00	5,006,161,600	貸付有価証券 259,300株
6302	住友重機械工業	192,800	3,225.00	621,780,000	貸付有価証券 39,500株
6305	日立建機	129,800	3,245.00	421,201,000	貸付有価証券 29,200株
6306	日工	48,300	644.00	31,105,200	貸付有価証券 6,000株
6309	巴工業	14,000	2,463.00	34,482,000	貸付有価証券 2,300株
6310	井関農機	30,500	1,205.00	36,752,500	貸付有価証券 4,200株
6315	TOWA	33,200	2,070.00	68,724,000	
6316	丸山製作所	3,300	1,750.00	5,775,000	貸付有価証券 1,000株

6317	北川鉄工所	12,800	1,232.00	15,769,600	貸付有価証券 3,300株
6323	ローツェ	17,000	9,970.00	169,490,000	貸付有価証券 2,700株
6325	タカキタ	6,500	451.00	2,931,500	貸付有価証券 2,300株
6326	クボタ	1,724,800	2,045.00	3,527,216,000	貸付有価証券 224,600株
6328	荏原実業	15,600	2,983.00	46,534,800	貸付有価証券 2,100株
6331	三菱化工機	10,500	2,407.00	25,273,500	貸付有価証券 1,500株
6332	月島ホールディングス	44,000	1,130.00	49,720,000	貸付有価証券 13,200株
6333	帝国電機製作所	22,900	2,355.00	53,929,500	貸付有価証券 3,600株
6335	東京機械製作所	5,900	555.00	3,274,500	貸付有価証券 1,000株
6339	新東工業	65,900	1,003.00	66,097,700	貸付有価証券 14,500株
6340	澁谷工業	30,600	2,629.00	80,447,400	貸付有価証券 3,800株
6345	アイチ コーポレーション	45,400	846.00	38,408,400	貸付有価証券 7,200株
6349	小森コーポレーション	75,500	1,053.00	79,501,500	貸付有価証券 17,800株
6351	鶴見製作所	24,900	2,375.00	59,137,500	貸付有価証券 3,400株
6356	日本ギア工業	7,600	431.00	3,275,600	貸付有価証券 1,300株
6358	酒井重工業	3,500	4,405.00	15,417,500	貸付有価証券 700株
6361	荏原製作所	133,400	6,130.00	817,742,000	貸付有価証券 25,600株
6362	石井鐵工所	2,500	2,446.00	6,115,000	貸付有価証券 600株
6363	西島製作所	28,100	1,660.00	46,646,000	貸付有価証券 600株
6364	北越工業	32,800	1,309.00	42,935,200	貸付有価証券 4,600株
6367	ダイキン工業	389,100	25,555.00	9,943,450,500	貸付有価証券 82,300株
6368	オルガノ	44,800	3,215.00	144,032,000	貸付有価証券 8,500株
6369	トーヨーカネツ	12,400	2,698.00	33,455,200	
6370	栗田工業	182,300	5,470.00	997,181,000	貸付有価証券 16,100株
6371	椿本チエイン	46,200	3,405.00	157,311,000	貸付有価証券 6,300株

6373	大同工業	8,700	730.00	6,351,000	貸付有価証券 2,100株
6378	木村化工機	24,900	712.00	17,728,800	
6381	アネスト岩田	55,400	1,049.00	58,114,600	貸付有価証券 6,900株
6383	ダイフク	504,200	2,600.00	1,310,920,000	貸付有価証券 93,100株
6387	サムコ	8,700	5,210.00	45,327,000	貸付有価証券 1,200株
6390	加藤製作所	10,200	1,282.00	13,076,400	貸付有価証券 2,400株
6393	油研工業	3,300	1,979.00	6,530,700	貸付有価証券 800株
6395	タダノ	171,900	1,038.00	178,432,200	貸付有価証券 21,300株
6406	フジテック	114,300	3,620.00	413,766,000	貸付有価証券 16,100株
6407	CKD	90,100	2,099.00	189,119,900	貸付有価証券 17,800株
6412	平和	108,400	2,638.00	285,959,200	
6413	理想科学工業	29,000	2,332.00	67,628,000	貸付有価証券 3,900株
6417	SANKYO	64,000	5,620.00	359,680,000	
6418	日本金銭機械	35,800	1,295.00	46,361,000	貸付有価証券 6,000株
6419	マースグループホールディングス	19,200	2,941.00	56,467,200	貸付有価証券 2,800株
6420	フクシマガリレイ	24,000	5,340.00	128,160,000	貸付有価証券 2,800株
6428	オーイズミ	7,500	581.00	4,357,500	貸付有価証券 1,900株
6430	ダイコク電機	17,800	2,808.00	49,982,400	貸付有価証券 2,100株
6432	竹内製作所	59,100	3,675.00	217,192,500	貸付有価証券 9,100株
6436	アマノ	92,500	2,855.00	264,087,500	貸付有価証券 11,600株
6440	JUKI	50,500	597.00	30,148,500	貸付有価証券 11,400株
6444	サンデン	29,800	225.00	6,705,000	貸付有価証券 9,500株
6445	ジャノメ	33,000	618.00	20,394,000	貸付有価証券 6,600株
6454	マックス	40,200	2,261.00	90,892,200	貸付有価証券 8,700株
6457	グローリー	78,200	2,822.00	220,680,400	貸付有価証券 12,400株
6458	新晃工業	32,800	1,802.00	59,105,600	貸付有価証券 4,100株

6459	大和冷機工業	49,900	1,439.00	71,806,100	貸付有価証券 6,400株
6460	セガサミーホールディングス	262,000	2,756.00	722,072,000	
6461	日本ピストンリング	7,800	1,389.00	10,834,200	貸付有価証券 1,600株
6462	リケン	12,900	2,726.00	35,165,400	貸付有価証券 2,000株
6463	T P R	37,300	1,428.00	53,264,400	
6464	ツバキ・ナカシマ	80,300	972.00	78,051,600	貸付有価証券 11,400株
6465	ホシザキ	209,800	5,190.00	1,088,862,000	貸付有価証券 36,200株
6470	大豊工業	28,200	786.00	22,165,200	貸付有価証券 3,600株
6471	日本精工	598,800	776.00	464,668,800	貸付有価証券 83,700株
6472	N T N	642,600	301.00	193,422,600	貸付有価証券 18,800株
6473	ジェイテクト	290,000	1,155.00	334,950,000	貸付有価証券 66,100株
6474	不二越	24,100	3,825.00	92,182,500	
6480	日本トムソン	79,800	583.00	46,523,400	
6481	T H K	188,100	2,948.00	554,518,800	貸付有価証券 25,800株
6482	ユーシン精機	25,800	723.00	18,653,400	貸付有価証券 3,500株
6485	前澤給装工業	22,900	1,080.00	24,732,000	貸付有価証券 3,200株
6486	イーグル工業	36,000	1,505.00	54,180,000	貸付有価証券 2,500株
6489	前澤工業	12,900	779.00	10,049,100	貸付有価証券 3,000株
6490	日本ビラー工業	30,200	3,750.00	113,250,000	貸付有価証券 4,400株
6498	キッツ	120,000	936.00	112,320,000	貸付有価証券 28,400株
6586	マキタ	405,500	3,600.00	1,459,800,000	
7003	三井E&S	151,600	540.00	81,864,000	貸付有価証券 28,200株
7004	日立造船	267,000	827.00	220,809,000	貸付有価証券 15,500株
7011	三菱重工業	570,000	5,242.00	2,987,940,000	
7013	I H I	205,300	3,315.00	680,569,500	貸付有価証券 1,400株
7022	サノヤスホールディングス	24,300	135.00	3,280,500	貸付有価証券 5,400株
7718	スター精密	61,500	1,830.00	112,545,000	貸付有価証券

					6,900株
3105	日清紡ホールディングス	265,300	1,046.00	277,503,800	貸付有価証券 29,500株
4062	イビデン	187,000	6,130.00	1,146,310,000	貸付有価証券 40,500株
4902	コニカミノルタ	727,900	524.00	381,419,600	貸付有価証券 161,800株
6448	ブラザー工業	435,500	1,999.00	870,564,500	貸付有価証券 54,200株
6479	ミネベアミツミ	566,900	2,486.00	1,409,313,400	
6501	日立製作所	1,584,900	7,848.00	12,438,295,200	貸付有価証券 91,400株
6502	東芝	627,300	4,384.00	2,750,083,200	貸付有価証券 135,600株
6503	三菱電機	3,368,700	1,727.00	5,817,744,900	貸付有価証券 631,700株
6504	富士電機	198,200	5,770.00	1,143,614,000	貸付有価証券 15,700株
6505	東洋電機製造	7,100	1,046.00	7,426,600	貸付有価証券 2,000株
6506	安川電機	386,200	5,680.00	2,193,616,000	貸付有価証券 109,700株
6507	シンフォニアテクノロジー	35,900	1,600.00	57,440,000	貸付有価証券 8,200株
6508	明電舎	49,400	1,898.00	93,761,200	
6513	オリジン	4,900	1,275.00	6,247,500	貸付有価証券 1,200株
6516	山洋電気	14,100	7,000.00	98,700,000	貸付有価証券 2,200株
6517	デンヨー	24,800	1,938.00	48,062,400	貸付有価証券 3,800株
6523	PHCホールディングス	45,400	1,384.00	62,833,600	貸付有価証券 9,400株
6526	ソシオネクスト	44,700	11,440.00	511,368,000	貸付有価証券 4,400株
6588	東芝テック	48,700	3,650.00	177,755,000	
6590	芝浦メカトロニクス	6,300	13,520.00	85,176,000	貸付有価証券 1,200株
6592	マブチモーター	80,900	3,895.00	315,105,500	貸付有価証券 16,400株
6594	ニデック	793,000	6,956.00	5,516,108,000	貸付有価証券 106,600株
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	23,900	529.00	12,643,100	貸付有価証券 2,500株
6616	トレックス・セミコンダクター	15,300	2,242.00	34,302,600	貸付有価証券 3,400株
6617	東光高岳	19,600	2,104.00	41,238,400	貸付有価証券 2,500株

6619	ダブル・スコープ	106,600	1,151.00	122,696,600	貸付有価証券 7,600株
6622	ダイヘン	29,400	4,825.00	141,855,000	貸付有価証券 4,800株
6630	ヤーマン	56,300	1,160.00	65,308,000	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	296,900	513.00	152,309,700	
6638	ミマキエンジニアリング	30,900	665.00	20,548,500	貸付有価証券 4,000株
6640	IPEX	18,100	1,239.00	22,425,900	貸付有価証券 1,600株
6644	大崎電気工業	77,300	567.00	43,829,100	貸付有価証券 8,800株
6645	オムロン	298,700	8,110.00	2,422,457,000	貸付有価証券 58,300株
6651	日東工業	43,900	2,751.00	120,768,900	貸付有価証券 6,300株
6652	IDEC	48,100	3,380.00	162,578,000	貸付有価証券 9,000株
6653	正興電機製作所	7,500	1,012.00	7,590,000	貸付有価証券 1,400株
6654	不二電機工業	4,000	1,119.00	4,476,000	貸付有価証券 600株
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	107,000	2,440.00	261,080,000	貸付有価証券 26,000株
6675	サクサホールディングス	5,000	2,141.00	10,705,000	貸付有価証券 1,000株
6676	メルコホールディングス	8,200	3,390.00	27,798,000	貸付有価証券 1,200株
6678	テクノメディカ	7,900	1,774.00	14,014,600	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	11,000	933.00	10,263,000	貸付有価証券 700株
6701	日本電気	461,000	6,190.00	2,853,590,000	貸付有価証券 5,300株
6702	富士通	324,800	17,980.00	5,839,904,000	
6703	沖電気工業	147,400	759.00	111,876,600	貸付有価証券 12,200株
6704	岩崎通信機	8,700	825.00	7,177,500	貸付有価証券 2,000株
6706	電気興業	13,100	2,205.00	28,885,500	貸付有価証券 3,700株
6707	サンケン電気	30,300	11,050.00	334,815,000	貸付有価証券 5,000株
6715	ナカヨ	3,500	1,141.00	3,993,500	貸付有価証券 800株
6718	アイホン	19,800	2,198.00	43,520,400	貸付有価証券 2,200株
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,126,700	1,968.00	4,185,345,600	



6724	セイコーエプソン	418,200	2,055.00	859,401,000	貸付有価証券 98,100株
6727	ワコム	247,900	685.00	169,811,500	貸付有価証券 8,900株
6728	アルバック	77,400	5,480.00	424,152,000	貸付有価証券 13,000株
6730	アクセル	8,200	1,378.00	11,299,600	貸付有価証券 1,800株
6737	E I Z O	23,900	4,315.00	103,128,500	貸付有価証券 6,200株
6740	ジャパンディスプレイ	1,251,300	41.00	51,303,300	貸付有価証券 126,800株
6741	日本信号	74,200	1,063.00	78,874,600	貸付有価証券 11,300株
6742	京三製作所	68,300	425.00	29,027,500	
6744	能美防災	44,000	1,831.00	80,564,000	貸付有価証券 6,500株
6745	ホーチキ	24,300	1,616.00	39,268,800	貸付有価証券 3,200株
6748	星和電機	7,900	481.00	3,799,900	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	77,900	1,320.00	102,828,000	貸付有価証券 7,500株
6752	パナソニック ホールディングス	3,850,100	1,371.00	5,278,487,100	
6753	シャープ	392,500	904.00	354,820,000	貸付有価証券 50,900株
6754	アンリツ	229,600	1,216.00	279,193,600	貸付有価証券 16,500株
6755	富士通ゼネラル	92,400	3,395.00	313,698,000	貸付有価証券 14,800株
6758	ソニーグループ	2,282,800	12,780.00	29,174,184,000	貸付有価証券 74,100株
6762	T D K	516,100	4,850.00	2,503,085,000	貸付有価証券 10,300株
6763	帝国通信工業	14,700	1,544.00	22,696,800	貸付有価証券 2,600株
6768	タムラ製作所	139,800	725.00	101,355,000	貸付有価証券 14,900株
6770	アルプスアルパイン	291,100	1,230.00	358,053,000	貸付有価証券 68,100株
6771	池上通信機	6,300	591.00	3,723,300	貸付有価証券 1,400株
6779	日本電波工業	39,100	1,232.00	48,171,200	
6785	鈴木	17,400	1,026.00	17,852,400	貸付有価証券 2,400株
6787	メイコー	35,600	2,498.00	88,928,800	貸付有価証券 500株
6788	日本トリム	7,300	2,948.00	21,520,400	貸付有価証券 600株

6789	ローランド ディー. ジー.	17,800	3,455.00	61,499,000	貸付有価証券 3,400株
6794	フォスター電機	30,200	1,043.00	31,498,600	
6798	SMK	7,800	2,378.00	18,548,400	貸付有価証券 1,900株
6800	ヨコオ	25,900	2,020.00	52,318,000	貸付有価証券 2,900株
6803	ティアック	32,800	116.00	3,804,800	貸付有価証券 3,200株
6804	ホシデン	76,000	1,853.00	140,828,000	貸付有価証券 5,700株
6806	ヒロセ電機	53,900	18,660.00	1,005,774,000	貸付有価証券 2,200株
6807	日本航空電子工業	66,800	2,489.00	166,265,200	貸付有価証券 6,000株
6809	TOA	37,100	855.00	31,720,500	貸付有価証券 4,800株
6810	マクセル	66,000	1,457.00	96,162,000	
6814	古野電気	42,300	935.00	39,550,500	貸付有価証券 8,500株
6817	スミダコーポレーション	29,800	1,670.00	49,766,000	貸付有価証券 3,400株
6820	アイコム	12,500	2,915.00	36,437,500	貸付有価証券 1,500株
6823	リオン	13,400	1,894.00	25,379,600	貸付有価証券 1,900株
6841	横河電機	356,600	2,447.00	872,600,200	貸付有価証券 66,800株
6844	新電元工業	12,500	3,490.00	43,625,000	貸付有価証券 1,600株
6845	アズビル	225,400	3,920.00	883,568,000	貸付有価証券 30,600株
6848	東亜ディーケーケー	10,600	831.00	8,808,600	貸付有価証券 2,200株
6849	日本光電工業	149,100	3,835.00	571,798,500	貸付有価証券 18,500株
6850	チノー	13,400	2,119.00	28,394,600	貸付有価証券 1,500株
6853	共和電業	18,700	355.00	6,638,500	貸付有価証券 4,600株
6855	日本電子材料	21,300	1,413.00	30,096,900	
6856	堀場製作所	71,900	7,680.00	552,192,000	貸付有価証券 14,600株
6857	アドバンテスト	254,300	12,130.00	3,084,659,000	貸付有価証券 45,000株
6858	小野測器	7,300	462.00	3,372,600	貸付有価証券 1,800株
6859	エスベック	25,800	2,048.00	52,838,400	

6861	キーエンス	322,900	65,520.00	21,156,408,000	貸付有価証券 21,700株
6866	日置電機	16,900	9,380.00	158,522,000	貸付有価証券 2,300株
6869	シスメックス	278,400	8,869.00	2,469,129,600	貸付有価証券 29,500株
6871	日本マイクロニクス	53,100	1,286.00	68,286,600	
6875	メガチップス	26,500	3,315.00	87,847,500	
6877	OBARA GROUP	17,600	3,900.00	68,640,000	貸付有価証券 4,000株
6901	澤藤電機	2,600	1,156.00	3,005,600	貸付有価証券 500株
6904	原田工業	10,100	818.00	8,261,800	貸付有価証券 2,700株
6905	コーセル	38,800	1,130.00	43,844,000	
6908	イリソ電子工業	29,700	4,375.00	129,937,500	貸付有価証券 3,700株
6914	オプテックスグループ	59,200	1,902.00	112,598,400	貸付有価証券 7,300株
6915	千代田インテグレ	11,200	2,355.00	26,376,000	貸付有価証券 2,000株
6920	レーザーテック	147,900	18,370.00	2,716,923,000	
6923	スタンレー電気	229,700	2,984.00	685,424,800	貸付有価証券 38,300株
6924	岩崎電気	2,800	4,450.00	12,460,000	
6925	ウシオ電機	163,900	1,925.00	315,507,500	
6926	岡谷電機産業	15,300	303.00	4,635,900	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	730.00	13,359,000	貸付有価証券 4,100株
6928	エノモト	5,900	1,627.00	9,599,300	貸付有価証券 1,300株
6929	日本セラミック	32,900	2,746.00	90,343,400	貸付有価証券 6,500株
6932	遠藤照明	9,900	1,290.00	12,771,000	貸付有価証券 3,400株
6937	古河電池	23,800	1,103.00	26,251,400	貸付有価証券 3,200株
6938	双信電機	10,100	380.00	3,838,000	貸付有価証券 2,200株
6941	山一電機	28,200	1,821.00	51,352,200	貸付有価証券 4,600株
6947	図研	28,100	3,510.00	98,631,000	貸付有価証券 2,000株
6951	日本電子	80,800	4,165.00	336,532,000	
6952	カシオ計算機	240,400	1,252.00	300,980,800	貸付有価証券 78,200株

6954	ファナック	1,583,800	4,560.00	7,222,128,000	貸付有価証券 128,300株
6958	日本シイエムケイ	68,500	472.00	32,332,000	貸付有価証券 4,500株
6961	エンプラス	9,400	4,210.00	39,574,000	貸付有価証券 1,600株
6962	大真空	39,300	690.00	27,117,000	貸付有価証券 9,600株
6963	ローム	149,200	10,980.00	1,638,216,000	貸付有価証券 19,700株
6965	浜松ホトニクス	259,000	7,090.00	1,836,310,000	貸付有価証券 31,800株
6966	三井ハイテック	33,300	8,480.00	282,384,000	貸付有価証券 8,100株
6967	新光電気工業	114,200	4,240.00	484,208,000	貸付有価証券 9,600株
6971	京セラ	501,300	7,273.00	3,645,954,900	貸付有価証券 62,500株
6976	太陽誘電	157,100	4,035.00	633,898,500	貸付有価証券 28,800株
6981	村田製作所	978,700	7,817.00	7,650,497,900	貸付有価証券 130,500株
6986	双葉電子工業	61,400	526.00	32,296,400	貸付有価証券 7,000株
6989	北陸電気工業	8,000	1,202.00	9,616,000	貸付有価証券 1,800株
6996	ニチコン	65,900	1,338.00	88,174,200	貸付有価証券 21,100株
6997	日本ケミコン	31,900	1,957.00	62,428,300	貸付有価証券 3,300株
6999	K O A	48,900	1,659.00	81,125,100	貸付有価証券 10,000株
7244	市光工業	46,500	539.00	25,063,500	
7276	小糸製作所	388,100	2,695.00	1,045,929,500	貸付有価証券 53,000株
7280	ミツバ	60,500	735.00	44,467,500	貸付有価証券 13,200株
7735	S C R E E Nホールディングス	55,200	11,810.00	651,912,000	貸付有価証券 12,500株
7739	キャノン電子	35,700	1,874.00	66,901,800	貸付有価証券 4,600株
7751	キャノン	1,770,600	3,222.00	5,704,873,200	貸付有価証券 355,400株
7752	リコー	809,100	1,033.00	835,800,300	貸付有価証券 18,100株
7965	象印マホービン	96,400	1,800.00	173,520,000	貸付有価証券 19,000株
7999	M U T O Hホールディングス	2,700	1,728.00	4,665,600	貸付有価証券 600株

8035	東京エレクトロン	683,000	16,395.00	11,197,785,000	貸付有価証券 7,000株
9880	イノテック	21,500	1,362.00	29,283,000	貸付有価証券 3,900株
3116	トヨタ紡織	135,900	2,141.00	290,961,900	
3526	芦森工業	4,100	1,543.00	6,326,300	貸付有価証券 900株
5949	ユニプレス	57,900	1,044.00	60,447,600	貸付有価証券 12,200株
6201	豊田自動織機	235,900	7,980.00	1,882,482,000	貸付有価証券 49,400株
6455	モリタホールディングス	56,600	1,577.00	89,258,200	貸付有価証券 7,800株
6584	三櫻工業	49,300	681.00	33,573,300	貸付有価証券 5,600株
6902	デンソー	665,600	8,272.00	5,505,843,200	貸付有価証券 33,700株
6995	東海理化電機製作所	91,000	1,903.00	173,173,000	貸付有価証券 6,000株
7012	川崎重工業	243,200	2,753.00	669,529,600	貸付有価証券 3,000株
7014	名村造船所	55,400	439.00	24,320,600	貸付有価証券 14,200株
7102	日本車輛製造	12,400	2,045.00	25,358,000	貸付有価証券 1,600株
7105	三菱ロジスネクスト	51,500	1,133.00	58,349,500	貸付有価証券 5,900株
7122	近畿車輛	3,200	1,504.00	4,812,800	貸付有価証券 800株
7201	日産自動車	4,584,300	532.50	2,441,139,750	貸付有価証券 176,800株
7202	いすゞ自動車	938,200	1,649.00	1,547,091,800	
7203	トヨタ自動車	17,720,200	1,942.00	34,412,628,400	貸付有価証券 1,050,000株
7205	日野自動車	416,000	542.00	225,472,000	貸付有価証券 70,100株
7211	三菱自動車工業	1,258,900	465.00	585,388,500	貸付有価証券 210,200株
7212	エフテック	13,700	786.00	10,768,200	貸付有価証券 3,100株
7213	レシップホールディングス	8,500	524.00	4,454,000	貸付有価証券 1,600株
7214	GMB	3,900	1,742.00	6,793,800	貸付有価証券 1,100株
7215	ファルテック	3,700	649.00	2,401,300	貸付有価証券 700株
7220	武蔵精密工業	78,800	1,814.00	142,943,200	貸付有価証券 9,900株
7222	日産車体	56,900	907.00	51,608,300	貸付有価証券

					12,500株
7224	新明和工業	101,400	1,272.00	128,980,800	貸付有価証券 200株
7226	極東開発工業	53,300	1,764.00	94,021,200	貸付有価証券 10,300株
7231	トピー工業	26,200	1,976.00	51,771,200	貸付有価証券 3,600株
7236	ティラド	8,100	2,466.00	19,974,600	
7238	曙ブレーキ工業	196,900	148.00	29,141,200	貸付有価証券 26,100株
7239	タチエス	51,000	1,257.00	64,107,000	貸付有価証券 7,700株
7240	N O K	125,400	1,798.00	225,469,200	貸付有価証券 37,000株
7241	フタバ産業	86,500	452.00	39,098,000	貸付有価証券 12,300株
7242	K Y B	31,100	4,575.00	142,282,500	貸付有価証券 4,900株
7245	大同メタル工業	63,100	501.00	31,613,100	貸付有価証券 8,400株
7246	プレス工業	144,200	543.00	78,300,600	貸付有価証券 22,000株
7247	ミクニ	24,900	354.00	8,814,600	貸付有価証券 5,600株
7250	太平洋工業	74,000	1,226.00	90,724,000	貸付有価証券 14,900株
7256	河西工業	26,300	222.00	5,838,600	貸付有価証券 7,900株
7259	アイシン	248,900	3,905.00	971,954,500	貸付有価証券 36,500株
7261	マツダ	1,067,500	1,228.00	1,310,890,000	貸付有価証券 174,500株
7266	今仙電機製作所	14,100	729.00	10,278,900	貸付有価証券 4,100株
7267	本田技研工業	2,623,300	3,741.00	9,813,765,300	
7269	スズキ	592,700	4,845.00	2,871,631,500	貸付有価証券 126,800株
7270	S U B A R U	1,021,100	2,252.00	2,299,517,200	貸付有価証券 156,800株
7271	安永	8,600	1,007.00	8,660,200	貸付有価証券 2,100株
7272	ヤマハ発動機	507,200	3,465.00	1,757,448,000	貸付有価証券 96,300株
7277	T B K	21,600	299.00	6,458,400	貸付有価証券 6,300株
7278	エクセディ	52,800	2,095.00	110,616,000	貸付有価証券 6,000株
7282	豊田合成	94,200	2,352.00	221,558,400	貸付有価証券 14,300株

7283	愛三工業	53,300	971.00	51,754,300	貸付有価証券 5,700株
7284	盟和産業	3,100	970.00	3,007,000	貸付有価証券 700株
7291	日本プラス	15,500	435.00	6,742,500	貸付有価証券 3,500株
7294	ヨロズ	30,200	854.00	25,790,800	貸付有価証券 4,100株
7296	エフ・シー・シー	57,200	1,684.00	96,324,800	
7309	シマノ	132,000	21,540.00	2,843,280,000	貸付有価証券 16,600株
7313	テイ・エス テック	147,700	1,900.00	280,630,000	貸付有価証券 20,600株
7408	ジャムコ	12,500	1,404.00	17,550,000	貸付有価証券 2,200株
4543	テルモ	992,500	4,199.00	4,167,507,500	貸付有価証券 139,200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 1,800株
6376	日機装	75,100	949.00	71,269,900	貸付有価証券 17,800株
7600	日本エム・ディ・エム	19,200	926.00	17,779,200	
7701	島津製作所	393,000	4,275.00	1,680,075,000	貸付有価証券 1,800株
7702	JMS	29,800	533.00	15,883,400	貸付有価証券 3,800株
7709	クボテック	4,600	210.00	966,000	貸付有価証券 1,100株
7715	長野計器	23,500	1,318.00	30,973,000	貸付有価証券 3,200株
7717	ブイ・テクノロジー	15,800	3,095.00	48,901,000	貸付有価証券 2,500株
7721	東京計器	24,700	1,230.00	30,381,000	貸付有価証券 2,900株
7723	愛知時計電機	12,600	1,536.00	19,353,600	
7725	インターアクション	15,300	1,337.00	20,456,100	貸付有価証券 2,400株
7727	オーバル	19,200	434.00	8,332,800	貸付有価証券 4,000株
7729	東京精密	70,800	5,240.00	370,992,000	貸付有価証券 8,000株
7730	マニー	129,100	1,710.00	220,761,000	貸付有価証券 17,600株
7731	ニコン	466,600	1,481.00	691,034,600	貸付有価証券 107,100株
7732	トプコン	169,900	1,980.00	336,402,000	貸付有価証券 29,400株
7733	オリンパス	1,986,500	2,438.00	4,843,087,000	貸付有価証券 317,000株

7734	理研計器	20,000	4,665.00	93,300,000	貸付有価証券 3,900株
7740	タムロン	24,100	3,475.00	83,747,500	貸付有価証券 4,800株
7741	HOYA	689,300	15,300.00	10,546,290,000	
7743	シード	10,000	591.00	5,910,000	貸付有価証券 1,900株
7744	ノーリツ鋼機	30,600	2,295.00	70,227,000	貸付有価証券 4,100株
7745	A&Dホロンホールディングス	47,000	1,274.00	59,878,000	
7747	朝日インテック	360,600	2,544.00	917,366,400	貸付有価証券 45,900株
7762	シチズン時計	354,800	770.00	273,196,000	貸付有価証券 51,600株
7769	リズム	6,700	2,068.00	13,855,600	貸付有価証券 1,900株
7775	大研医器	17,000	499.00	8,483,000	貸付有価証券 3,100株
7780	メニコン	110,800	2,925.00	324,090,000	貸付有価証券 5,200株
7782	シンシア	1,800	598.00	1,076,400	
7979	松風	14,600	2,113.00	30,849,800	貸付有価証券 800株
8050	セイコーグループ	50,000	2,658.00	132,900,000	貸付有価証券 6,300株
8086	ニプロ	269,000	1,003.00	269,807,000	
7795	KYORITSU	29,400	147.00	4,321,800	貸付有価証券 7,400株
7811	中本ボックス	6,000	1,582.00	9,492,000	貸付有価証券 1,100株
7816	スノーピーク	55,200	2,133.00	117,741,600	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	74,500	2,491.00	185,579,500	貸付有価証券 14,800株
7818	トランザクション	21,300	1,776.00	37,828,800	貸付有価証券 3,700株
7819	粧美堂	5,300	383.00	2,029,900	貸付有価証券 1,300株
7820	ニホンフラッシュ	30,200	1,086.00	32,797,200	貸付有価証券 4,200株
7821	前田工織	27,300	3,215.00	87,769,500	貸付有価証券 6,900株
7822	永大産業	23,400	224.00	5,241,600	貸付有価証券 5,800株
7823	アートネイチャー	33,200	780.00	25,896,000	貸付有価証券 4,700株
7832	バンダイナムコホールディングス	884,100	3,245.00	2,868,904,500	貸付有価証券 214,000株



7833	アイフィスジャパン	5,500	616.00	3,388,000	貸付有価証券 1,100株
7839	SHOEI	72,900	2,546.00	185,603,400	
7840	フランスベッドホールディングス	40,000	1,117.00	44,680,000	貸付有価証券 3,700株
7846	パイロットコーポレーション	50,500	4,505.00	227,502,500	貸付有価証券 7,700株
7856	萩原工業	21,600	1,280.00	27,648,000	貸付有価証券 3,300株
7864	フジシールインターナショナル	65,300	1,563.00	102,063,900	貸付有価証券 10,000株
7867	タカラトミー	149,000	1,621.00	241,529,000	貸付有価証券 19,800株
7868	広済堂ホールディングス	13,300	2,600.00	34,580,000	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	609.00	2,801,400	貸付有価証券 1,500株
7885	タカノ	7,300	758.00	5,533,400	貸付有価証券 1,700株
7893	プロネクサス	26,800	1,000.00	26,800,000	貸付有価証券 3,800株
7897	ホクシン	15,100	136.00	2,053,600	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	6,500	1,120.00	7,280,000	貸付有価証券 1,900株
7905	大建工業	19,600	2,203.00	43,178,800	
7911	凸版印刷	422,000	2,858.00	1,206,076,000	貸付有価証券 98,300株
7912	大日本印刷	352,700	3,965.00	1,398,455,500	貸付有価証券 86,600株
7914	共同印刷	9,100	2,812.00	25,589,200	貸付有価証券 1,400株
7915	NISSHA	61,400	1,633.00	100,266,200	貸付有価証券 13,100株
7916	光村印刷	1,700	1,216.00	2,067,200	貸付有価証券 400株
7921	TAKARA & COMPANY	20,600	2,434.00	50,140,400	貸付有価証券 700株
7936	アシックス	297,900	3,800.00	1,132,020,000	貸付有価証券 46,200株
7937	ツツミ	5,700	2,260.00	12,882,000	貸付有価証券 1,400株
7944	ローランド	23,800	4,220.00	100,436,000	貸付有価証券 4,700株
7949	小松ウオール工業	11,800	2,391.00	28,213,800	貸付有価証券 1,400株
7951	ヤマハ	203,400	5,310.00	1,080,054,000	貸付有価証券 41,000株
7952	河合楽器製作所	8,700	3,140.00	27,318,000	

7955	クリナップ	36,100	701.00	25,306,100	貸付有価証券 4,100株
7956	ビジョン	205,500	2,154.00	442,647,000	貸付有価証券 26,800株
7962	キングジム	28,500	930.00	26,505,000	貸付有価証券 5,100株
7966	リンテック	64,800	2,213.00	143,402,400	貸付有価証券 13,600株
7972	イトーキ	66,100	837.00	55,325,700	貸付有価証券 9,400株
7974	任天堂	2,037,500	5,758.00	11,731,925,000	貸付有価証券 352,400株
7976	三菱鉛筆	45,800	1,811.00	82,943,800	貸付有価証券 7,300株
7981	タカラスタンダード	59,400	1,736.00	103,118,400	貸付有価証券 9,100株
7984	コクヨ	155,400	2,027.00	314,995,800	貸付有価証券 21,200株
7987	ナカバヤシ	34,700	477.00	16,551,900	貸付有価証券 4,300株
7990	グローブライド	26,100	2,452.00	63,997,200	貸付有価証券 4,000株
7994	オカムラ	97,100	1,751.00	170,022,100	貸付有価証券 15,400株
8022	美津濃	32,100	3,410.00	109,461,000	
9501	東京電力ホールディングス	2,909,100	499.00	1,451,640,900	貸付有価証券 353,400株
9502	中部電力	1,189,200	1,620.00	1,926,504,000	貸付有価証券 193,200株
9503	関西電力	1,246,200	1,505.00	1,875,531,000	
9504	中国電力	513,900	730.00	375,147,000	貸付有価証券 61,200株
9505	北陸電力	304,600	668.00	203,472,800	貸付有価証券 60,000株
9506	東北電力	789,000	728.00	574,392,000	貸付有価証券 110,300株
9507	四国電力	275,500	842.00	231,971,000	
9508	九州電力	743,900	850.00	632,315,000	貸付有価証券 91,200株
9509	北海道電力	311,800	531.00	165,565,800	貸付有価証券 41,400株
9511	沖縄電力	75,600	1,127.00	85,201,200	貸付有価証券 8,900株
9513	電源開発	243,000	2,129.00	517,347,000	
9514	エフオン	20,900	667.00	13,940,300	貸付有価証券 2,800株
9517	イーレックス	57,300	1,771.00	101,478,300	貸付有価証券 6,400株

9519	レノバ	85,900	1,644.00	141,219,600	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	682,300	2,941.00	2,006,644,300	貸付有価証券 2,100株
9532	大阪瓦斯	653,700	2,241.00	1,464,941,700	貸付有価証券 85,900株
9533	東邦瓦斯	127,000	2,544.00	323,088,000	貸付有価証券 6,800株
9534	北海道瓦斯	19,300	2,067.00	39,893,100	
9535	広島ガス	68,100	374.00	25,469,400	貸付有価証券 9,100株
9536	西部ガスホールディングス	30,300	1,958.00	59,327,400	貸付有価証券 3,400株
9543	静岡ガス	73,600	1,160.00	85,376,000	貸付有価証券 19,100株
9551	メタウォーター	40,300	1,781.00	71,774,300	貸付有価証券 4,400株
2384	SBSホールディングス	28,800	3,260.00	93,888,000	貸付有価証券 3,800株
9001	東武鉄道	354,500	3,585.00	1,270,882,500	貸付有価証券 100株
9003	相鉄ホールディングス	106,600	2,743.00	292,403,800	貸付有価証券 14,200株
9005	東急	904,900	1,974.00	1,786,272,600	貸付有価証券 112,000株
9006	京浜急行電鉄	366,100	1,355.00	496,065,500	貸付有価証券 57,000株
9007	小田急電鉄	489,200	2,085.00	1,019,982,000	貸付有価証券 96,000株
9008	京王電鉄	170,700	5,230.00	892,761,000	貸付有価証券 23,100株
9009	京成電鉄	208,100	5,200.00	1,082,120,000	貸付有価証券 54,000株
9010	富士急行	39,700	5,630.00	223,511,000	貸付有価証券 10,500株
9020	東日本旅客鉄道	547,300	8,100.00	4,433,130,000	貸付有価証券 112,700株
9021	西日本旅客鉄道	412,300	6,131.00	2,527,811,300	貸付有価証券 55,600株
9022	東海旅客鉄道	248,600	17,000.00	4,226,200,000	貸付有価証券 52,600株
9024	西武ホールディングス	390,400	1,538.00	600,435,200	
9025	鴻池運輸	55,000	1,628.00	89,540,000	
9031	西日本鉄道	86,200	2,502.00	215,672,400	貸付有価証券 12,300株
9037	ハマキョウレックス	25,200	3,560.00	89,712,000	貸付有価証券 3,400株
9039	サカイ引越センター	15,300	4,820.00	73,746,000	貸付有価証券 1,300株

9041	近鉄グループホールディングス	322,100	4,745.00	1,528,364,500	貸付有価証券 41,900株
9042	阪急阪神ホールディングス	429,600	4,415.00	1,896,684,000	貸付有価証券 55,900株
9044	南海電気鉄道	154,000	3,290.00	506,660,000	
9045	京阪ホールディングス	177,600	3,755.00	666,888,000	貸付有価証券 18,700株
9046	神戸電鉄	8,800	3,225.00	28,380,000	貸付有価証券 100株
9048	名古屋鉄道	356,100	2,325.00	827,932,500	貸付有価証券 17,700株
9052	山陽電気鉄道	24,300	2,431.00	59,073,300	貸付有価証券 3,400株
9055	アルプス物流	25,700	1,235.00	31,739,500	
9064	ヤマトホールディングス	412,500	2,499.00	1,030,837,500	貸付有価証券 25,800株
9065	山九	82,000	4,975.00	407,950,000	貸付有価証券 1,400株
9067	丸運	9,700	246.00	2,386,200	貸付有価証券 2,400株
9068	丸全昭和運輸	19,900	3,720.00	74,028,000	貸付有価証券 1,200株
9069	センコーグループホールディングス	170,600	959.00	163,605,400	貸付有価証券 12,000株
9070	トナミホールディングス	7,100	4,605.00	32,695,500	貸付有価証券 1,000株
9072	ニッコンホールディングス	103,100	2,718.00	280,225,800	貸付有価証券 6,500株
9074	日本石油輸送	2,200	2,694.00	5,926,800	貸付有価証券 400株
9075	福山通運	24,500	3,685.00	90,282,500	貸付有価証券 2,000株
9076	セイノーホールディングス	200,500	1,514.00	303,557,000	貸付有価証券 52,600株
9078	エスライン	5,500	815.00	4,482,500	貸付有価証券 200株
9081	神奈川中央交通	9,100	3,265.00	29,711,500	貸付有価証券 1,100株
9090	AZ-COM丸和ホールディングス	77,800	2,055.00	159,879,000	貸付有価証券 8,800株
9099	C&Fロジホールディングス	31,000	1,310.00	40,610,000	貸付有価証券 4,200株
9142	九州旅客鉄道	227,800	3,175.00	723,265,000	貸付有価証券 37,300株
9143	SGホールディングス	618,300	2,116.00	1,308,322,800	貸付有価証券 87,600株
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	120,300	8,290.00	997,287,000	貸付有価証券 16,600株
9101	日本郵船	861,900	3,114.00	2,683,956,600	貸付有価証券

					105,300株
9104	商船三井	567,900	3,190.00	1,811,601,000	貸付有価証券 79,200株
9107	川崎汽船	242,100	3,335.00	807,403,500	貸付有価証券 14,700株
9110	N Sユナイテッド海運	17,400	3,580.00	62,292,000	貸付有価証券 2,300株
9115	明治海運	19,200	585.00	11,232,000	貸付有価証券 4,500株
9119	飯野海運	118,300	799.00	94,521,700	貸付有価証券 19,800株
9130	共栄タンカー	3,600	918.00	3,304,800	貸付有価証券 800株
9308	乾汽船	40,900	1,632.00	66,748,800	貸付有価証券 2,500株
9201	日本航空	791,300	2,665.00	2,108,814,500	貸付有価証券 76,800株
9202	A N Aホールディングス	876,700	3,043.00	2,667,798,100	貸付有価証券 155,100株
9232	パスコ	3,900	1,588.00	6,193,200	貸付有価証券 800株
9058	トランコム	9,300	6,780.00	63,054,000	貸付有価証券 1,400株
9066	日新	24,500	2,247.00	55,051,500	貸付有価証券 3,600株
9301	三菱倉庫	69,200	3,420.00	236,664,000	貸付有価証券 8,000株
9302	三井倉庫ホールディングス	30,100	3,615.00	108,811,500	貸付有価証券 4,800株
9303	住友倉庫	86,900	2,248.00	195,351,200	貸付有価証券 17,500株
9304	澁澤倉庫	12,900	2,360.00	30,444,000	貸付有価証券 2,300株
9306	東陽倉庫	28,800	284.00	8,179,200	貸付有価証券 7,600株
9310	日本トランスシティ	64,800	679.00	43,999,200	貸付有価証券 9,200株
9312	ケイヒン	3,500	1,684.00	5,894,000	貸付有価証券 1,300株
9319	中央倉庫	15,500	1,074.00	16,647,000	貸付有価証券 2,600株
9322	川西倉庫	3,700	1,015.00	3,755,500	貸付有価証券 800株
9324	安田倉庫	22,000	980.00	21,560,000	貸付有価証券 2,900株
9325	ファイズホールディングス	4,300	1,277.00	5,491,100	貸付有価証券 900株
9351	東洋埠頭	5,700	1,456.00	8,299,200	貸付有価証券 1,300株

9364	上組	154,500	3,050.00	471,225,000	貸付有価証券 24,100株
9366	サンリツ	5,200	741.00	3,853,200	貸付有価証券 1,000株
9368	キムラユニティー	10,600	1,154.00	12,232,400	貸付有価証券 2,200株
9369	キューソー流通システム	11,800	1,025.00	12,095,000	貸付有価証券 1,600株
9380	東海運	11,500	304.00	3,496,000	貸付有価証券 2,400株
9381	エーアイティー	20,200	1,630.00	32,926,000	貸付有価証券 3,000株
9384	内外トランスライン	11,600	2,545.00	29,522,000	貸付有価証券 1,900株
9386	日本コンセプト	10,000	1,650.00	16,500,000	
1973	NEC ネットズエスアイ	108,100	1,854.00	200,417,400	
2307	クロスキャット	18,500	1,196.00	22,126,000	貸付有価証券 2,200株
2317	システナ	544,100	305.00	165,950,500	貸付有価証券 35,600株
2326	デジタルアーツ	20,500	5,570.00	114,185,000	貸付有価証券 1,300株
2327	日鉄ソリューションズ	55,200	3,995.00	220,524,000	貸付有価証券 10,000株
2335	キューブシステム	19,200	1,188.00	22,809,600	貸付有価証券 2,300株
2359	コア	14,300	1,733.00	24,781,900	貸付有価証券 1,900株
2477	手間いらず	5,500	4,560.00	25,080,000	貸付有価証券 600株
3031	ラクーンホールディングス	26,800	713.00	19,108,400	貸付有価証券 2,100株
3040	ソリトンシステムズ	16,700	1,078.00	18,002,600	貸付有価証券 1,900株
3371	ソフトクリエイトホールディングス	26,600	1,758.00	46,762,800	貸付有価証券 3,800株
3626	T I S	354,000	3,935.00	1,392,990,000	貸付有価証券 43,500株
3627	J N Sホールディングス	9,700	407.00	3,947,900	貸付有価証券 1,800株
3632	グリーン	86,800	689.00	59,805,200	
3633	GMOペパボ	4,600	1,694.00	7,792,400	貸付有価証券 700株
3635	コーエーテクモホールディングス	202,800	2,437.00	494,223,600	貸付有価証券 23,000株
3636	三菱総合研究所	15,900	5,170.00	82,203,000	貸付有価証券 1,900株
3639	ボルテージ	5,700	315.00	1,795,500	貸付有価証券 800株

3640	電算	2,300	1,802.00	4,144,600	貸付有価証券 500株
3648	A G S	8,300	726.00	6,025,800	貸付有価証券 2,400株
3649	ファインデックス	25,700	625.00	16,062,500	貸付有価証券 3,700株
3655	ブレインパッド	24,200	699.00	16,915,800	貸付有価証券 2,500株
3656	K L a b	64,500	392.00	25,284,000	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	55,300	949.00	52,479,700	貸付有価証券 7,300株
3659	ネクソン	838,200	2,975.00	2,493,645,000	貸付有価証券 172,700株
3660	アイスタイル	94,100	526.00	49,496,600	貸付有価証券 13,500株
3661	エムアップホールディングス	39,600	1,226.00	48,549,600	貸付有価証券 5,200株
3662	エイチーム	19,100	697.00	13,312,700	貸付有価証券 3,000株
3665	エニグモ	41,200	410.00	16,892,000	貸付有価証券 3,700株
3666	テクノスジャパン	16,300	579.00	9,437,700	貸付有価証券 3,400株
3667	e n i s h	14,900	508.00	7,569,200	貸付有価証券 2,800株
3668	コロブラ	125,600	656.00	82,393,600	貸付有価証券 14,200株
3672	オルトプラス	15,100	212.00	3,201,200	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	189,000	430.00	81,270,000	貸付有価証券 30,300株
3675	クロス・マーケティンググループ	8,000	672.00	5,376,000	貸付有価証券 1,900株
3676	デジタルハーツホールディングス	20,200	1,363.00	27,532,600	貸付有価証券 3,300株
3677	システム情報	25,700	784.00	20,148,800	貸付有価証券 2,900株
3678	メディアドゥ	13,000	1,351.00	17,563,000	貸付有価証券 1,400株
3679	じげん	94,400	622.00	58,716,800	貸付有価証券 10,500株
3681	ブイキューブ	38,800	517.00	20,059,600	貸付有価証券 3,700株
3682	エンカレッジ・テクノロジ	4,600	525.00	2,415,000	貸付有価証券 700株
3683	サイバーリンクス	6,300	901.00	5,676,300	貸付有価証券 1,400株
3686	ディー・エル・イー	14,100	238.00	3,355,800	貸付有価証券 3,000株

3687	フィックスターズ	36,500	1,407.00	51,355,500	貸付有価証券 4,600株
3688	CARTA HOLDINGS	15,200	1,455.00	22,116,000	
3694	オプティム	26,600	937.00	24,924,200	貸付有価証券 3,000株
3696	セレス	13,000	1,113.00	14,469,000	
3697	SHIFT	21,500	24,890.00	535,135,000	貸付有価証券 1,700株
3738	ティーガイア	33,800	1,660.00	56,108,000	貸付有価証券 3,800株
3741	セック	3,100	3,085.00	9,563,500	貸付有価証券 600株
3762	テクマトリックス	59,100	1,857.00	109,748,700	貸付有価証券 6,200株
3763	プロシップ	14,100	1,373.00	19,359,300	貸付有価証券 1,200株
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	94,800	2,814.00	266,767,200	貸付有価証券 15,000株
3769	GMOペイメントゲートウェイ	64,700	11,100.00	718,170,000	貸付有価証券 11,900株
3770	ザッパラス	6,900	366.00	2,525,400	貸付有価証券 3,300株
3771	システムリサーチ	10,100	2,340.00	23,634,000	
3774	インターネットイニシアティブ	180,600	2,814.00	508,208,400	
3778	さくらインターネット	36,300	676.00	24,538,800	貸付有価証券 4,700株
3784	ヴィンクス	5,900	1,468.00	8,661,200	貸付有価証券 2,100株
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	9,900	3,835.00	37,966,500	貸付有価証券 1,200株
3817	SRAホールディングス	16,600	3,005.00	49,883,000	貸付有価証券 2,300株
3826	システムインテグレータ	6,700	429.00	2,874,300	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	34,800	592.00	20,601,600	貸付有価証券 3,100株
3835	eBASE	45,500	742.00	33,761,000	貸付有価証券 5,200株
3836	アバントグループ	40,900	1,370.00	56,033,000	貸付有価証券 3,700株
3837	アドソル日進	13,600	1,854.00	25,214,400	貸付有価証券 1,500株
3839	ODKソリューションズ	4,400	598.00	2,631,200	貸付有価証券 100株
3843	フリービット	17,000	1,536.00	26,112,000	貸付有価証券 3,000株
3844	コムチュア	42,800	2,107.00	90,179,600	貸付有価証券 1,800株



3852	サイバーコム	3,200	1,562.00	4,998,400	貸付有価証券 800株
3853	アステリア	25,300	631.00	15,964,300	貸付有価証券 3,600株
3854	アイル	15,100	2,764.00	41,736,400	貸付有価証券 2,200株
3901	マークライNZ	17,500	2,303.00	40,302,500	貸付有価証券 2,900株
3902	メディカル・データ・ビジョン	48,300	779.00	37,625,700	貸付有価証券 5,900株
3903	g u m i	47,500	729.00	34,627,500	貸付有価証券 5,500株
3909	ショーケース	4,600	308.00	1,416,800	貸付有価証券 1,000株
3912	モバイルファクトリー	4,100	903.00	3,702,300	貸付有価証券 1,000株
3915	テラスカイ	14,000	2,540.00	35,560,000	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	18,700	1,656.00	30,967,200	貸付有価証券 1,900株
3918	P C Iホールディングス	8,300	1,038.00	8,615,400	貸付有価証券 1,800株
3920	アイビーシー	3,100	600.00	1,860,000	貸付有価証券 800株
3921	ネオジャパン	10,800	932.00	10,065,600	貸付有価証券 800株
3922	P R T I M E S	8,100	1,465.00	11,866,500	貸付有価証券 800株
3923	ラクス	153,100	2,094.00	320,591,400	貸付有価証券 17,900株
3924	ランドコンピュータ	4,800	1,139.00	5,467,200	
3925	ダブルスタンダード	13,100	2,111.00	27,654,100	貸付有価証券 1,200株
3926	オープンドア	22,600	1,506.00	34,035,600	貸付有価証券 2,200株
3928	マイネット	6,400	335.00	2,144,000	貸付有価証券 1,400株
3932	アカツキ	15,400	2,157.00	33,217,800	貸付有価証券 2,300株
3934	ベネフィットジャパン	1,500	1,158.00	1,737,000	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	10,000	2,151.00	21,510,000	貸付有価証券 1,000株
3939	カナミックネットワーク	34,900	497.00	17,345,300	
3940	ノムラシステムコーポレーション	18,500	115.00	2,127,500	貸付有価証券 4,000株
3962	チェンジホールディングス	79,300	2,380.00	188,734,000	貸付有価証券 5,400株
3963	シンクロ・フード	10,700	477.00	5,103,900	貸付有価証券

					1,800株
3964	オークネット	16,000	1,764.00	28,224,000	貸付有価証券 4,000株
3965	キャピタル・アセット・プランニング	3,800	712.00	2,705,600	貸付有価証券 1,000株
3968	セグエグループ	5,500	997.00	5,483,500	貸付有価証券 600株
3969	エイトレッド	3,000	1,457.00	4,371,000	貸付有価証券 500株
3978	マクロミル	63,500	891.00	56,578,500	貸付有価証券 8,000株
3981	ビーグリー	3,300	1,255.00	4,141,500	貸付有価証券 800株
3983	オロ	9,700	2,480.00	24,056,000	貸付有価証券 1,100株
3984	ユーザーローカル	11,600	2,139.00	24,812,400	貸付有価証券 2,000株
3985	テモナ	3,800	278.00	1,056,400	貸付有価証券 700株
3992	ニーズウェル	6,100	1,313.00	8,009,300	貸付有価証券 500株
3994	マネーフォワード	78,100	5,550.00	433,455,000	貸付有価証券 9,900株
3996	サインポスト	6,800	563.00	3,828,400	貸付有価証券 700株
4053	Sun Asterisk	22,900	1,260.00	28,854,000	
4072	電算システムホールディングス	15,600	3,115.00	48,594,000	貸付有価証券 2,300株
4180	Appier Group	122,600	1,527.00	187,210,200	
4284	ソルクシーズ	16,100	386.00	6,214,600	貸付有価証券 3,800株
4295	フェイス	5,500	509.00	2,799,500	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	40,500	1,205.00	48,802,500	貸付有価証券 3,900株
4299	ハイマックス	10,100	1,438.00	14,523,800	貸付有価証券 1,200株
4307	野村総合研究所	644,800	3,475.00	2,240,680,000	貸付有価証券 97,400株
4312	サイバネットシステム	27,100	822.00	22,276,200	貸付有価証券 6,500株
4320	CEホールディングス	10,200	563.00	5,742,600	貸付有価証券 2,500株
4323	日本システム技術	7,500	2,029.00	15,217,500	貸付有価証券 2,200株
4326	インテージホールディングス	36,600	1,629.00	59,621,400	貸付有価証券 5,400株
4333	東邦システムサイエンス	5,500	1,126.00	6,193,000	貸付有価証券 1,200株

4344	ソースネクスト	164,500	226.00	37,177,000	貸付有価証券 24,400株
4348	インフォコム	41,700	2,222.00	92,657,400	貸付有価証券 4,800株
4373	シンプレクス・ホールディングス	55,300	2,408.00	133,162,400	貸付有価証券 4,700株
4382	HEROZ	10,900	1,257.00	13,701,300	貸付有価証券 1,100株
4384	ラクスル	77,600	1,325.00	102,820,000	貸付有価証券 5,700株
4385	メルカリ	194,900	2,689.00	524,086,100	貸付有価証券 27,600株
4390	I P S	10,500	2,538.00	26,649,000	貸付有価証券 1,500株
4392	F I G	22,900	287.00	6,572,300	貸付有価証券 4,700株
4396	システムサポート	12,500	1,870.00	23,375,000	貸付有価証券 800株
4420	イーソル	20,700	971.00	20,099,700	貸付有価証券 2,400株
4423	アルテリア・ネットワークス	30,200	1,585.00	47,867,000	貸付有価証券 4,800株
4430	東海ソフト	3,300	1,048.00	3,458,400	貸付有価証券 900株
4432	ウイングアーク1st	33,400	2,251.00	75,183,400	貸付有価証券 2,600株
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	8,600	1,589.00	13,665,400	貸付有価証券 1,300株
4434	サーバーワークス	6,500	1,951.00	12,681,500	貸付有価証券 500株
4439	東名	1,500	1,973.00	2,959,500	貸付有価証券 500株
4440	ヴィッツ	1,900	1,115.00	2,118,500	貸付有価証券 400株
4441	トビラシステムズ	4,900	969.00	4,748,100	貸付有価証券 900株
4443	S a n s a n	105,900	1,684.00	178,335,600	貸付有価証券 23,600株
4446	L i n k - U	3,800	979.00	3,720,200	貸付有価証券 800株
4449	ギフトィ	35,200	2,500.00	88,000,000	貸付有価証券 5,800株
4480	メドレー	43,500	3,750.00	163,125,000	
4481	ベース	11,000	5,960.00	65,560,000	貸付有価証券 600株
4483	J M D C	53,100	5,700.00	302,670,000	貸付有価証券 9,700株
4662	フォーカスシステムズ	23,600	1,032.00	24,355,200	貸付有価証券 2,700株

4674	クレスコ	25,000	1,928.00	48,200,000	貸付有価証券 2,600株
4676	フジ・メディア・ホールディングス	310,900	1,308.00	406,657,200	貸付有価証券 29,000株
4684	オービック	108,200	22,320.00	2,415,024,000	
4686	ジャストシステム	46,500	4,060.00	188,790,000	貸付有価証券 2,100株
4687	TDCソフト	27,300	1,459.00	39,830,700	貸付有価証券 3,800株
4689	Zホールディングス	4,606,100	354.30	1,631,941,230	貸付有価証券 581,600株
4704	トレンドマイクロ	186,900	6,390.00	1,194,291,000	貸付有価証券 35,000株
4709	IDホールディングス	21,800	1,140.00	24,852,000	貸付有価証券 300株
4716	日本オラクル	61,900	10,660.00	659,854,000	貸付有価証券 100株
4719	アルファシステムズ	10,200	4,310.00	43,962,000	貸付有価証券 2,400株
4722	フューチャー	80,500	1,697.00	136,608,500	貸付有価証券 15,400株
4725	CAC Holdings	19,800	1,699.00	33,640,200	貸付有価証券 4,300株
4726	SBテクノロジー	13,700	2,425.00	33,222,500	貸付有価証券 800株
4728	トーセ	5,200	739.00	3,842,800	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	63,700	5,220.00	332,514,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	173,800	3,530.00	613,514,000	貸付有価証券 26,100株
4743	アイティフォー	42,600	946.00	40,299,600	貸付有価証券 5,200株
4746	東計電算	4,500	6,160.00	27,720,000	貸付有価証券 600株
4762	エックスネット	3,300	1,004.00	3,313,200	貸付有価証券 400株
4768	大塚商会	183,400	5,150.00	944,510,000	貸付有価証券 34,200株
4776	サイボウズ	44,600	2,694.00	120,152,400	貸付有価証券 8,300株
4812	電通国際情報サービス	39,300	5,090.00	200,037,000	貸付有価証券 5,400株
4813	ACCESS	38,300	862.00	33,014,600	貸付有価証券 4,100株
4819	デジタルガレージ	57,500	4,655.00	267,662,500	貸付有価証券 11,300株
4820	EMシステムズ	54,000	816.00	44,064,000	貸付有価証券 9,400株
4825	ウェザーニューズ	10,000	6,870.00	68,700,000	

4826	C I J	53,700	558.00	29,964,600	貸付有価証券 14,000株
4828	ビジネスエンジニアリング	4,800	3,680.00	17,664,000	貸付有価証券 1,100株
4829	日本エンタープライズ	20,500	145.00	2,972,500	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	24,400	1,281.00	31,256,400	貸付有価証券 2,100株
4845	スカラ	29,900	765.00	22,873,500	貸付有価証券 3,100株
4847	インテリジェント ウェイブ	10,500	697.00	7,318,500	貸付有価証券 2,300株
5128	WOW WORLD GROUP	2,600	1,499.00	3,897,400	
6879	IMAGICA GROUP	27,000	621.00	16,767,000	貸付有価証券 3,600株
7518	ネットワンシステムズ	120,600	3,240.00	390,744,000	
7527	システムソフト	112,600	79.00	8,895,400	
7595	アルゴグラフィックス	29,700	3,985.00	118,354,500	貸付有価証券 2,000株
7844	マーベラス	52,600	679.00	35,715,400	貸付有価証券 6,700株
7860	エイベックス	55,000	1,550.00	85,250,000	
8056	B I P R O G Y	119,100	3,570.00	425,187,000	貸付有価証券 13,600株
8157	都築電気	17,000	1,668.00	28,356,000	貸付有価証券 1,400株
9401	T B Sホールディングス	165,700	2,119.00	351,118,300	貸付有価証券 38,000株
9404	日本テレビホールディングス	286,500	1,246.00	356,979,000	貸付有価証券 52,900株
9405	朝日放送グループホールディングス	30,300	665.00	20,149,500	貸付有価証券 4,300株
9409	テレビ朝日ホールディングス	78,600	1,587.00	124,738,200	貸付有価証券 15,800株
9412	スカパー J S A Tホールディングス	287,100	561.00	161,063,100	貸付有価証券 48,100株
9413	テレビ東京ホールディングス	23,300	2,567.00	59,811,100	貸付有価証券 700株
9414	日本BS放送	7,100	899.00	6,382,900	貸付有価証券 1,500株
9416	ビジョン	42,600	1,763.00	75,103,800	貸付有価証券 4,900株
9417	スマートバリュー	4,800	438.00	2,102,400	貸付有価証券 1,300株
9418	USEN-NEXT HOLDING S	36,300	2,991.00	108,573,300	貸付有価証券 1,600株
9419	ワイヤレスゲート	8,600	243.00	2,089,800	貸付有価証券 2,000株

9424	日本通信	298,700	291.00	86,921,700	貸付有価証券 33,800株
9428	クロップス	3,900	1,097.00	4,278,300	貸付有価証券 800株
9432	日本電信電話	4,147,300	4,108.00	17,037,108,400	貸付有価証券 205,900株
9433	KDDI	2,501,100	4,415.00	11,042,356,500	貸付有価証券 325,300株
9434	ソフトバンク	5,199,500	1,522.00	7,913,639,000	
9435	光通信	38,100	18,430.00	702,183,000	貸付有価証券 1,900株
9438	エムティーアイ	22,200	558.00	12,387,600	貸付有価証券 6,900株
9449	GMOインターネットグループ	119,600	2,676.00	320,049,600	貸付有価証券 18,200株
9450	ファイバーゲート	17,400	1,221.00	21,245,400	貸付有価証券 1,400株
9466	アイドママーケティングコミュニケー ション	4,500	290.00	1,305,000	貸付有価証券 1,300株
9468	KADOKAWA	171,100	3,090.00	528,699,000	貸付有価証券 23,400株
9470	学研ホールディングス	53,900	880.00	47,432,000	貸付有価証券 6,000株
9474	ゼンリン	55,300	939.00	51,926,700	貸付有価証券 8,600株
9475	昭文社ホールディングス	8,500	299.00	2,541,500	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	220.00	3,850,000	貸付有価証券 3,600株
9600	アイネット	19,600	1,495.00	29,302,000	貸付有価証券 2,200株
9601	松竹	18,500	12,400.00	229,400,000	貸付有価証券 2,900株
9602	東宝	202,600	5,440.00	1,102,144,000	貸付有価証券 27,400株
9605	東映	8,900	18,210.00	162,069,000	貸付有価証券 300株
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,015,500	1,911.00	1,940,620,500	貸付有価証券 57,600株
9629	ピー・シー・エー	18,600	1,152.00	21,427,200	貸付有価証券 2,400株
9658	ビジネスブレイン太田昭和	13,800	1,907.00	26,316,600	貸付有価証券 1,600株
9682	D T S	68,900	3,355.00	231,159,500	貸付有価証券 10,100株
9684	スクウェア・エニックス・ホールディ ングス	162,700	6,750.00	1,098,225,000	貸付有価証券 26,000株
9692	シーイーシー	45,400	1,430.00	64,922,000	貸付有価証券 4,700株

9697	カプコン	321,600	5,360.00	1,723,776,000	貸付有価証券 46,200株
9702	アイ・エス・ビー	16,500	1,520.00	25,080,000	貸付有価証券 1,600株
9717	ジャステック	19,900	1,240.00	24,676,000	貸付有価証券 2,700株
9719	S C S K	264,100	2,143.00	565,966,300	
9739	N S W	12,600	2,151.00	27,102,600	
9742	アイネス	22,700	1,428.00	32,415,600	貸付有価証券 7,500株
9746	T K C	51,600	3,670.00	189,372,000	貸付有価証券 7,200株
9749	富士ソフト	36,600	8,540.00	312,564,000	貸付有価証券 8,900株
9759	N S D	115,500	2,663.00	307,576,500	貸付有価証券 16,000株
9766	コナミグループ	138,500	7,030.00	973,655,000	貸付有価証券 9,600株
9790	福井コンピュータホールディングス	22,500	2,674.00	60,165,000	貸付有価証券 1,700株
9889	J B C Cホールディングス	23,600	2,217.00	52,321,200	貸付有価証券 3,000株
9928	ミロク情報サービス	29,400	1,570.00	46,158,000	貸付有価証券 3,800株
9984	ソフトバンクグループ	1,596,600	4,949.00	7,901,573,400	
2676	高千穂交易	7,500	2,348.00	17,610,000	貸付有価証券 2,600株
2689	オルバヘルスケアホールディングス	3,500	1,813.00	6,345,500	貸付有価証券 500株
2692	伊藤忠食品	7,700	5,270.00	40,579,000	貸付有価証券 1,100株
2715	エレマテック	30,600	1,827.00	55,906,200	貸付有価証券 4,100株
2733	あらた	26,100	4,490.00	117,189,000	貸付有価証券 3,500株
2737	トーマンデバイス	4,900	5,500.00	26,950,000	貸付有価証券 600株
2760	東京エレクトロン デバイス	12,600	8,040.00	101,304,000	貸付有価証券 1,800株
2767	円谷フィールズホールディングス	58,600	1,739.00	101,905,400	貸付有価証券 6,800株
2768	双日	362,500	2,819.00	1,021,887,500	
2784	アルフレッサ ホールディングス	342,700	2,028.00	694,995,600	貸付有価証券 48,500株
2874	横浜冷凍	93,000	1,122.00	104,346,000	貸付有価証券 12,200株
3004	神栄	3,100	1,032.00	3,199,200	貸付有価証券 600株

3023	ラサ商事	9,600	1,443.00	13,852,800	貸付有価証券 2,300株
3036	アルコニックス	44,900	1,381.00	62,006,900	貸付有価証券 4,600株
3038	神戸物産	264,100	4,000.00	1,056,400,000	貸付有価証券 38,000株
3054	ハイパー	3,900	455.00	1,774,500	貸付有価証券 600株
3076	あい ホールディングス	54,600	2,398.00	130,930,800	貸付有価証券 6,200株
3079	ディーブイエックス	7,200	1,014.00	7,300,800	貸付有価証券 1,600株
3107	ダイワボウホールディングス	139,500	2,651.00	369,814,500	貸付有価証券 18,500株
3132	マクニカホールディングス	80,800	4,390.00	354,712,000	
3139	ラクト・ジャパン	13,200	2,076.00	27,403,200	
3150	グリムス	14,300	2,151.00	30,759,300	貸付有価証券 1,400株
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	49,900	960.00	47,904,000	
3153	八洲電機	27,600	1,285.00	35,466,000	貸付有価証券 3,300株
3154	メディアスホールディングス	21,800	836.00	18,224,800	貸付有価証券 2,500株
3156	レスターホールディングス	32,700	2,174.00	71,089,800	
3157	ジュテックホールディングス	4,100	1,160.00	4,756,000	貸付有価証券 1,000株
3160	大光	8,900	623.00	5,544,700	貸付有価証券 800株
3166	OCHIホールディングス	4,700	1,244.00	5,846,800	貸付有価証券 1,300株
3167	TOKAIホールディングス	168,600	885.00	149,211,000	貸付有価証券 29,900株
3168	黒谷	5,700	604.00	3,442,800	貸付有価証券 1,000株
3173	C o m i n i x	3,700	782.00	2,893,400	貸付有価証券 1,000株
3176	三洋貿易	38,500	1,259.00	48,471,500	貸付有価証券 4,400株
3180	ビューティガレージ	5,400	3,870.00	20,898,000	貸付有価証券 200株
3183	ウイン・パートナーズ	24,800	1,005.00	24,924,000	貸付有価証券 3,200株
3321	ミタチ産業	5,300	1,342.00	7,112,600	貸付有価証券 100株
3360	シップヘルスケアホールディングス	122,700	2,467.00	302,700,900	貸付有価証券 12,900株
3388	明治電機工業	12,700	1,192.00	15,138,400	貸付有価証券 1,300株



3392	デリカフーズホールディングス	8,200	642.00	5,264,400	
3393	スターティアホールディングス	4,800	1,500.00	7,200,000	貸付有価証券 1,000株
3543	コメダホールディングス	83,600	2,644.00	221,038,400	貸付有価証券 9,500株
3559	ピーバンドットコム	2,900	511.00	1,481,900	貸付有価証券 800株
3565	アセンテック	11,400	569.00	6,486,600	貸付有価証券 600株
5009	富士興産	5,300	1,201.00	6,365,300	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	2,100	1,979.00	4,155,900	貸付有価証券 500株
7128	フルサト・マルカホールディングス	33,900	2,759.00	93,530,100	貸付有価証券 5,900株
7130	ヤマエグループホールディングス	19,300	2,300.00	44,390,000	
7414	小野建	33,500	1,540.00	51,590,000	貸付有価証券 3,900株
7417	南陽	4,000	2,205.00	8,820,000	貸付有価証券 1,000株
7420	佐鳥電機	13,100	1,658.00	21,719,800	
7427	エコートレーディング	4,400	763.00	3,357,200	貸付有価証券 1,000株
7433	伯東	19,500	4,530.00	88,335,000	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	26,200	1,047.00	27,431,400	貸付有価証券 3,400株
7442	中山福	11,100	348.00	3,862,800	貸付有価証券 2,500株
7447	ナガイレーベン	43,100	2,181.00	94,001,100	貸付有価証券 6,400株
7451	三菱食品	31,500	3,575.00	112,612,500	貸付有価証券 1,000株
7456	松田産業	26,000	2,312.00	60,112,000	
7458	第一興商	132,100	2,508.00	331,306,800	貸付有価証券 13,000株
7459	メディパルホールディングス	326,500	2,109.00	688,588,500	貸付有価証券 75,600株
7466	S P K	15,100	1,703.00	25,715,300	
7467	萩原電気ホールディングス	13,100	3,530.00	46,243,000	貸付有価証券 1,600株
7476	アズワン	48,600	5,900.00	286,740,000	貸付有価証券 600株
7480	スズデン	11,900	2,237.00	26,620,300	
7481	尾家産業	4,900	1,240.00	6,076,000	貸付有価証券 1,300株
7482	シモジマ	23,400	1,081.00	25,295,400	貸付有価証券

					2,700株
7483	ドウシシャ	36,100	2,089.00	75,412,900	貸付有価証券 4,100株
7487	小津産業	4,700	1,789.00	8,408,300	貸付有価証券 100株
7504	高速	17,700	2,178.00	38,550,600	貸付有価証券 2,600株
7510	たけびし	13,000	1,659.00	21,567,000	貸付有価証券 1,500株
7525	リックス	4,300	2,866.00	12,323,800	貸付有価証券 1,000株
7537	丸文	30,500	1,229.00	37,484,500	貸付有価証券 3,900株
7552	ハピネット	29,000	1,971.00	57,159,000	貸付有価証券 3,600株
7570	橋本総業ホールディングス	13,500	1,137.00	15,349,500	貸付有価証券 1,800株
7575	日本ライフライン	100,100	1,060.00	106,106,000	貸付有価証券 12,900株
7590	タカショー	29,700	730.00	21,681,000	貸付有価証券 900株
7599	I DOM	103,200	854.00	88,132,800	貸付有価証券 17,200株
7607	進和	20,900	2,125.00	44,412,500	貸付有価証券 2,600株
7608	エスケイジャパン	5,100	547.00	2,789,700	貸付有価証券 1,000株
7609	ダイトロン	13,500	2,667.00	36,004,500	貸付有価証券 1,900株
7613	シークス	48,700	1,447.00	70,468,900	貸付有価証券 8,900株
7619	田中商事	6,500	659.00	4,283,500	
7628	オーハシテクニカ	16,500	1,548.00	25,542,000	貸付有価証券 2,500株
7637	白銅	12,300	2,665.00	32,779,500	貸付有価証券 1,600株
7673	ダイコー通産	2,500	1,258.00	3,145,000	貸付有価証券 500株
8001	伊藤忠商事	2,103,900	4,723.00	9,936,719,700	
8002	丸紅	2,664,500	1,920.50	5,117,172,250	貸付有価証券 13,300株
8007	高島	3,000	3,175.00	9,525,000	貸付有価証券 700株
8012	長瀬産業	156,500	2,328.00	364,332,000	
8014	蝶理	18,300	2,614.00	47,836,200	貸付有価証券 2,800株
8015	豊田通商	299,100	5,950.00	1,779,645,000	貸付有価証券 69,400株

8018	三共生興	49,000	595.00	29,155,000	貸付有価証券 6,600株
8020	兼松	132,600	1,883.00	249,685,800	貸付有価証券 5,600株
8025	ツカモトコーポレーション	3,500	1,462.00	5,117,000	貸付有価証券 1,100株
8031	三井物産	2,423,200	4,221.00	10,228,327,200	
8032	日本紙パルプ商事	18,100	5,560.00	100,636,000	貸付有価証券 2,500株
8037	カメイ	36,300	1,512.00	54,885,600	貸付有価証券 5,700株
8038	東都水産	1,100	6,720.00	7,392,000	貸付有価証券 400株
8041	OUGホールディングス	3,100	2,475.00	7,672,500	貸付有価証券 800株
8043	スターゼン	25,900	2,355.00	60,994,500	貸付有価証券 1,200株
8051	山善	92,000	1,042.00	95,864,000	貸付有価証券 10,600株
8052	椿本興業	5,500	4,010.00	22,055,000	貸付有価証券 800株
8053	住友商事	2,114,600	2,570.50	5,435,579,300	
8057	内田洋行	13,800	5,390.00	74,382,000	貸付有価証券 1,900株
8058	三菱商事	2,111,900	5,347.00	11,292,329,300	
8059	第一実業	12,000	5,650.00	67,800,000	貸付有価証券 3,400株
8060	キャノンマーケティングジャパン	79,100	3,350.00	264,985,000	貸付有価証券 16,700株
8061	西華産業	13,400	2,144.00	28,729,600	貸付有価証券 100株
8065	佐藤商事	23,700	1,400.00	33,180,000	貸付有価証券 3,600株
8068	菱洋エレクトロ	29,100	2,581.00	75,107,100	貸付有価証券 2,800株
8070	東京産業	31,100	908.00	28,238,800	貸付有価証券 4,000株
8074	ユアサ商事	30,700	4,130.00	126,791,000	貸付有価証券 4,200株
8075	神鋼商事	8,600	5,360.00	46,096,000	貸付有価証券 1,100株
8077	トルク	11,200	211.00	2,363,200	貸付有価証券 2,600株
8078	阪和興業	61,300	4,240.00	259,912,000	貸付有価証券 8,100株
8079	正栄食品工業	22,700	4,010.00	91,027,000	貸付有価証券 4,000株
8081	カナデン	22,800	1,212.00	27,633,600	貸付有価証券 3,600株

8084	RYODEN	27,500	2,031.00	55,852,500	貸付有価証券 3,200株
8088	岩谷産業	77,700	6,590.00	512,043,000	貸付有価証券 11,600株
8089	ナイス	6,500	1,403.00	9,119,500	貸付有価証券 1,800株
8091	ニチモウ	2,500	3,180.00	7,950,000	貸付有価証券 700株
8093	極東貿易	20,400	1,521.00	31,028,400	貸付有価証券 4,000株
8095	アステナホールディングス	59,100	453.00	26,772,300	
8097	三愛オブリ	90,300	1,515.00	136,804,500	貸付有価証券 10,800株
8098	稲畑産業	68,900	2,917.00	200,981,300	
8101	G S I クレオス	19,800	1,881.00	37,243,800	貸付有価証券 2,200株
8103	明和産業	45,400	671.00	30,463,400	貸付有価証券 7,100株
8104	クワザワホールディングス	7,500	478.00	3,585,000	貸付有価証券 1,700株
8125	ワキタ	62,800	1,385.00	86,978,000	貸付有価証券 9,300株
8129	東邦ホールディングス	85,000	2,702.00	229,670,000	貸付有価証券 13,900株
8130	サンゲツ	85,700	2,482.00	212,707,400	貸付有価証券 11,000株
8131	ミツウロコグループホールディングス	43,500	1,384.00	60,204,000	貸付有価証券 6,400株
8132	シナネンホールディングス	11,000	3,755.00	41,305,000	貸付有価証券 2,500株
8133	伊藤忠エネクス	84,600	1,230.00	104,058,000	貸付有価証券 9,700株
8136	サンリオ	96,700	6,140.00	593,738,000	貸付有価証券 12,600株
8137	サンワテクノス	17,400	2,055.00	35,757,000	
8140	リョーサン	36,200	3,365.00	121,813,000	貸付有価証券 4,800株
8141	新光商事	45,900	1,232.00	56,548,800	貸付有価証券 6,900株
8142	トーヨー	14,600	2,348.00	34,280,800	貸付有価証券 1,900株
8150	三信電気	13,800	2,110.00	29,118,000	貸付有価証券 2,400株
8151	東陽テクニカ	34,600	1,395.00	48,267,000	
8153	モスフードサービス	50,200	3,175.00	159,385,000	貸付有価証券 5,700株
8154	加賀電子	27,700	4,950.00	137,115,000	貸付有価証券 4,400株

8158	ソーダニッカ	16,900	773.00	13,063,700	貸付有価証券 4,800株
8159	立花エレテック	24,900	2,114.00	52,638,600	貸付有価証券 400株
8275	フォーバル	13,400	1,155.00	15,477,000	貸付有価証券 2,600株
8283	PALTAC	53,700	4,930.00	264,741,000	貸付有価証券 7,500株
8285	三谷産業	59,600	316.00	18,833,600	貸付有価証券 6,600株
8835	太平洋興発	7,800	755.00	5,889,000	貸付有価証券 2,200株
9260	西本Wismettacホールディングス	8,700	3,950.00	34,365,000	貸付有価証券 800株
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,900	2,211.00	4,200,900	貸付有価証券 400株
9273	コア商事ホールディングス	19,100	728.00	13,904,800	
9274	KPPグループホールディングス	79,600	659.00	52,456,400	貸付有価証券 10,300株
9305	ヤマタネ	15,100	1,680.00	25,368,000	
9763	丸紅建材リース	1,800	2,119.00	3,814,200	貸付有価証券 400株
9810	日鉄物産	7,800	9,280.00	72,384,000	
9824	泉州電業	17,100	3,145.00	53,779,500	
9830	トラスコ中山	71,700	2,277.00	163,260,900	貸付有価証券 9,000株
9832	オートバックスセブン	118,800	1,564.00	185,803,200	
9837	モリト	24,400	1,079.00	26,327,600	貸付有価証券 1,300株
9869	加藤産業	42,200	3,840.00	162,048,000	貸付有価証券 6,800株
9872	北恵	4,700	762.00	3,581,400	貸付有価証券 800株
9882	イエローハット	60,200	1,896.00	114,139,200	貸付有価証券 8,200株
9896	JKホールディングス	26,200	1,083.00	28,374,600	貸付有価証券 4,000株
9902	日伝	20,200	2,130.00	43,026,000	貸付有価証券 4,000株
9930	北沢産業	11,100	450.00	4,995,000	貸付有価証券 3,700株
9932	杉本商事	15,100	2,027.00	30,607,700	貸付有価証券 2,400株
9934	因幡電機産業	88,500	3,100.00	274,350,000	
9960	東テク	11,400	4,055.00	46,227,000	貸付有価証券 1,400株
9962	ミスミグループ本社	515,300	3,415.00	1,759,749,500	貸付有価証券

					54,600株
9972	アルテック	11,600	259.00	3,004,400	貸付有価証券 4,600株
9982	タキヒヨー	5,700	1,029.00	5,865,300	貸付有価証券 1,600株
9986	蔵王産業	4,100	2,280.00	9,348,000	貸付有価証券 800株
9987	スズケン	100,000	3,945.00	394,500,000	貸付有価証券 9,700株
9991	ジェコス	20,400	869.00	17,727,600	貸付有価証券 3,000株
9995	グローセル	22,900	413.00	9,457,700	貸付有価証券 4,300株
2651	ローソン	84,700	6,310.00	534,457,000	貸付有価証券 13,100株
2659	サンエー	26,100	4,770.00	124,497,000	貸付有価証券 3,600株
2664	カワチ薬品	26,700	2,250.00	60,075,000	貸付有価証券 3,400株
2670	エービーシー・マート	49,800	7,970.00	396,906,000	貸付有価証券 6,800株
2674	ハードオフコーポレーション	9,300	1,467.00	13,643,100	貸付有価証券 1,700株
2678	アスクル	70,600	1,800.00	127,080,000	
2681	ゲオホールディングス	33,400	1,682.00	56,178,800	
2685	アダストリア	41,200	2,700.00	111,240,000	貸付有価証券 6,000株
2686	ジーフット	12,700	278.00	3,530,600	貸付有価証券 3,900株
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	3,100	483.00	1,497,300	貸付有価証券 600株
2695	くら寿司	40,000	3,215.00	128,600,000	貸付有価証券 4,600株
2698	キャンドウ	12,100	2,480.00	30,008,000	貸付有価証券 1,800株
2722	I Kホールディングス	6,700	406.00	2,720,200	貸付有価証券 1,300株
2726	バルグループホールディングス	33,500	3,325.00	111,387,500	貸付有価証券 4,400株
2730	エディオン	135,200	1,392.00	188,198,400	貸付有価証券 38,400株
2734	サーラコーポレーション	71,700	781.00	55,997,700	
2735	ワッツ	10,200	712.00	7,262,400	貸付有価証券 2,800株
2742	ハローズ	15,500	3,225.00	49,987,500	貸付有価証券 2,100株
2752	フジオフードグループ本社	37,900	1,442.00	54,651,800	貸付有価証券 5,200株

2753	あみやき亭	8,300	3,690.00	30,627,000	
2764	ひらまつ	44,800	305.00	13,664,000	貸付有価証券 8,600株
2791	大黒天物産	10,500	5,320.00	55,860,000	貸付有価証券 1,600株
2792	ハニーズホールディングス	26,900	1,614.00	43,416,600	
2796	ファーマライズホールディングス	4,500	640.00	2,880,000	
3028	アルペン	28,200	2,042.00	57,584,400	貸付有価証券 5,700株
3030	ハブ	6,900	822.00	5,671,800	貸付有価証券 1,300株
3034	クオールホールディングス	46,900	1,198.00	56,186,200	貸付有価証券 8,400株
3046	ジンズホールディングス	20,300	3,055.00	62,016,500	貸付有価証券 2,300株
3048	ビックカメラ	181,600	1,127.00	204,663,200	貸付有価証券 25,900株
3050	DCMホールディングス	208,400	1,363.00	284,049,200	貸付有価証券 24,400株
3053	ペッパーフードサービス	78,200	174.00	13,606,800	貸付有価証券 11,600株
3064	Monotaro	484,000	1,961.00	949,124,000	貸付有価証券 57,300株
3067	東京一番フーズ	4,800	499.00	2,395,200	貸付有価証券 1,100株
3073	DDホールディングス	11,100	1,238.00	13,741,800	貸付有価証券 1,700株
3082	きちりホールディングス	5,600	850.00	4,760,000	貸付有価証券 1,200株
3085	アークランドサービスホールディングス	28,000	3,045.00	85,260,000	貸付有価証券 4,000株
3086	J. フロント リテイリング	424,500	1,455.00	617,647,500	貸付有価証券 52,300株
3087	ドトール・日レスホールディングス	60,500	2,130.00	128,865,000	貸付有価証券 7,000株
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	207,000	7,380.00	1,527,660,000	貸付有価証券 25,800株
3091	ブロンコビリー	18,200	2,796.00	50,887,200	貸付有価証券 2,200株
3092	ZOZO	225,700	3,045.00	687,256,500	貸付有価証券 26,800株
3093	トレジャー・ファクトリー	12,400	1,688.00	20,931,200	貸付有価証券 2,600株
3097	物語コーポレーション	57,000	3,115.00	177,555,000	貸付有価証券 1,900株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	574,800	1,482.00	851,853,600	貸付有価証券 87,800株
3134	Hamee	11,800	981.00	11,575,800	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	1,384.00	2,906,400	貸付有価証券 400株
3141	ウエルシアホールディングス	177,100	2,979.00	527,580,900	貸付有価証券 25,800株
3148	クリエイイトSDホールディングス	56,400	3,450.00	194,580,000	貸付有価証券 6,400株
3159	丸善CHIホールディングス	24,700	364.00	8,990,800	貸付有価証券 5,100株
3169	ミサワ	4,300	618.00	2,657,400	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	2,800	1,362.00	3,813,600	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 800株
3178	チムニー	6,500	1,346.00	8,749,000	貸付有価証券 2,000株
3179	シュッピン	25,400	950.00	24,130,000	貸付有価証券 2,900株
3182	オイシックス・ラ・大地	45,900	2,799.00	128,474,100	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	77,900	2,310.00	179,949,000	貸付有価証券 1,800株
3191	ジョイフル本田	101,400	1,798.00	182,317,200	貸付有価証券 12,800株
3193	鳥貴族ホールディングス	12,600	2,393.00	30,151,800	貸付有価証券 1,400株
3196	ホットランド	26,100	1,635.00	42,673,500	貸付有価証券 2,200株
3197	すかいらくホールディングス	466,700	1,870.00	872,729,000	貸付有価証券 60,600株
3198	SFPホールディングス	18,700	2,041.00	38,166,700	貸付有価証券 2,600株
3199	綿半ホールディングス	26,400	1,415.00	37,356,000	貸付有価証券 3,200株
3221	ヨシックスホールディングス	4,100	2,375.00	9,737,500	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	111,200	1,177.00	130,882,400	貸付有価証券 12,700株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	15,400	874.00	13,459,600	
3328	B E E N O S	14,500	1,995.00	28,927,500	貸付有価証券 1,500株
3333	あさひ	28,500	1,312.00	37,392,000	貸付有価証券 3,200株
3341	日本調剤	23,200	1,129.00	26,192,800	貸付有価証券 1,600株
3349	コスモス薬品	33,800	14,380.00	486,044,000	貸付有価証券 3,800株
3361	トーエル	9,300	757.00	7,040,100	貸付有価証券 2,100株



3382	セブン&アイ・ホールディングス	1,176,700	6,307.00	7,421,446,900	貸付有価証券 307,100株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	256,800	1,010.00	259,368,000	貸付有価証券 23,400株
3391	ツルハホールディングス	71,700	9,060.00	649,602,000	
3395	サンマルクホールディングス	27,500	1,907.00	52,442,500	
3396	フェリシモ	4,700	1,015.00	4,770,500	貸付有価証券 1,000株
3397	トリドールホールディングス	84,900	3,000.00	254,700,000	貸付有価証券 12,000株
3415	TOKYO BASE	35,100	465.00	16,321,500	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	1,111.00	4,444,000	貸付有価証券 700株
3539	JMホールディングス	25,800	2,021.00	52,141,800	貸付有価証券 3,000株
3544	サツドラホールディングス	9,500	831.00	7,894,500	貸付有価証券 700株
3546	アレンザホールディングス	25,500	999.00	25,474,500	貸付有価証券 2,200株
3547	串カツ田中ホールディングス	9,100	1,704.00	15,506,400	貸付有価証券 700株
3548	バロックジャパンリミテッド	22,100	865.00	19,116,500	貸付有価証券 3,000株
3549	クスリのアオキホールディングス	30,400	6,610.00	200,944,000	貸付有価証券 6,400株
3561	力の源ホールディングス	11,200	1,520.00	17,024,000	貸付有価証券 1,900株
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	182,100	3,305.00	601,840,500	貸付有価証券 35,200株
4350	メディカルシステムネットワーク	29,600	396.00	11,721,600	
7127	一家ホールディングス	4,500	634.00	2,853,000	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	574.00	3,731,000	貸付有価証券 800株
7416	はるやまホールディングス	9,900	514.00	5,088,600	貸付有価証券 2,100株
7419	ノジマ	111,400	1,507.00	167,879,800	
7421	カップ・クリエイト	53,700	1,524.00	81,838,800	貸付有価証券 6,100株
7445	ライトオン	15,800	585.00	9,243,000	貸付有価証券 3,300株
7453	良品計画	372,700	1,444.00	538,178,800	貸付有価証券 89,200株
7455	バリミキホールディングス	26,100	335.00	8,743,500	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	32,500	965.00	31,362,500	貸付有価証券 9,200株

7475	アルビス	11,200	2,466.00	27,619,200	貸付有価証券 2,100株
7494	コナカ	22,800	359.00	8,185,200	貸付有価証券 7,900株
7506	ハウス オブ ローゼ	2,600	1,610.00	4,186,000	
7508	G-7ホールディングス	42,500	1,424.00	60,520,000	貸付有価証券 5,200株
7512	イオン北海道	50,500	829.00	41,864,500	貸付有価証券 5,200株
7513	コジマ	56,400	568.00	32,035,200	貸付有価証券 200株
7514	ヒマラヤ	6,600	957.00	6,316,200	貸付有価証券 2,100株
7516	コーナン商事	46,000	3,710.00	170,660,000	貸付有価証券 6,200株
7520	エコス	12,700	1,889.00	23,990,300	貸付有価証券 1,600株
7522	ワタミ	41,200	977.00	40,252,400	貸付有価証券 7,500株
7524	マルシェ	6,900	434.00	2,994,600	貸付有価証券 1,400株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	689,300	2,610.00	1,799,073,000	貸付有価証券 18,800株
7545	西松屋チェーン	75,600	1,700.00	128,520,000	貸付有価証券 9,600株
7550	ゼンショーホールディングス	186,900	4,465.00	834,508,500	貸付有価証券 2,500株
7554	幸楽苑ホールディングス	22,300	1,080.00	24,084,000	貸付有価証券 2,700株
7561	ハークスレイ	8,800	730.00	6,424,000	
7581	サイゼリヤ	50,500	3,415.00	172,457,500	貸付有価証券 7,200株
7593	V Tホールディングス	129,700	545.00	70,686,500	貸付有価証券 18,100株
7596	魚力	10,600	2,189.00	23,203,400	
7601	ポプラ	4,600	254.00	1,168,400	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	19,300	1,328.00	25,630,400	貸付有価証券 2,800株
7606	ユナイテッドアローズ	36,500	2,400.00	87,600,000	貸付有価証券 4,600株
7611	ハイデイ日高	50,600	2,360.00	119,416,000	貸付有価証券 6,300株
7615	YU-WA Creation Holdi	12,400	198.00	2,455,200	貸付有価証券 2,700株
7616	コロワイド	157,300	2,125.00	334,262,500	貸付有価証券 14,500株
7618	ピーシーデポコーポレーション	38,100	299.00	11,391,900	貸付有価証券 5,800株

7630	壺番屋	27,000	5,370.00	144,990,000	貸付有価証券 3,100株
7640	トップカルチャー	6,700	195.00	1,306,500	貸付有価証券 1,600株
7646	P L A N T	4,900	720.00	3,528,000	貸付有価証券 1,100株
7649	スギホールディングス	68,800	5,840.00	401,792,000	貸付有価証券 10,800株
7679	薬王堂ホールディングス	19,100	2,442.00	46,642,200	貸付有価証券 1,900株
7918	ヴィア・ホールディングス	27,800	91.00	2,529,800	貸付有価証券 5,300株
8005	スクロール	50,700	897.00	45,477,900	貸付有価証券 6,700株
8008	ヨンドシーホールディングス	29,400	1,797.00	52,831,800	貸付有価証券 4,400株
8160	木曾路	51,700	2,421.00	125,165,700	貸付有価証券 5,700株
8163	S R Sホールディングス	56,300	1,025.00	57,707,500	
8165	千趣会	62,800	421.00	26,438,800	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	50,700	1,602.00	81,221,400	貸付有価証券 5,900株
8168	ケーヨー	55,000	825.00	45,375,000	貸付有価証券 8,900株
8173	上新電機	30,400	1,957.00	59,492,800	貸付有価証券 5,100株
8174	日本瓦斯	182,900	2,059.00	376,591,100	貸付有価証券 20,700株
8179	ロイヤルホールディングス	66,200	2,855.00	189,001,000	貸付有価証券 1,800株
8181	東天紅	1,500	775.00	1,162,500	
8182	いなげや	33,200	1,503.00	49,899,600	貸付有価証券 5,400株
8185	チヨダ	32,600	870.00	28,362,000	貸付有価証券 8,200株
8194	ライフコーポレーション	29,800	3,030.00	90,294,000	貸付有価証券 3,300株
8200	リンガーハット	44,000	2,416.00	106,304,000	貸付有価証券 6,900株
8203	M r M a x H D	47,800	628.00	30,018,400	貸付有価証券 6,000株
8207	テンアライド	21,200	264.00	5,596,800	貸付有価証券 6,800株
8214	A O K Iホールディングス	63,500	874.00	55,499,000	貸付有価証券 12,500株
8217	オークワ	54,600	903.00	49,303,800	貸付有価証券

					6,800株
8218	コメリ	52,500	3,105.00	163,012,500	貸付有価証券 6,700株
8219	青山商事	73,000	968.00	70,664,000	貸付有価証券 9,000株
8227	しまむら	40,100	12,770.00	512,077,000	貸付有価証券 8,200株
8230	はせがわ	11,200	344.00	3,852,800	貸付有価証券 2,300株
8233	高島屋	257,400	1,999.00	514,542,600	貸付有価証券 43,400株
8237	松屋	57,900	1,190.00	68,901,000	貸付有価証券 8,800株
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	166,200	1,581.00	262,762,200	貸付有価証券 20,700株
8244	近鉄百貨店	14,600	2,547.00	37,186,200	貸付有価証券 1,700株
8252	丸井グループ	251,800	2,422.00	609,859,600	貸付有価証券 71,000株
8255	アクシアル リテイリング	23,300	3,415.00	79,569,500	貸付有価証券 5,300株
8260	井筒屋	9,900	331.00	3,276,900	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	1,157,500	2,805.00	3,246,787,500	貸付有価証券 226,200株
8273	イズミ	51,900	3,275.00	169,972,500	貸付有価証券 8,900株
8276	平和堂	57,100	2,100.00	119,910,000	貸付有価証券 8,900株
8278	フジ	52,400	1,776.00	93,062,400	貸付有価証券 8,600株
8279	ヤオコー	38,600	7,390.00	285,254,000	貸付有価証券 4,300株
8281	ゼビオホールディングス	46,300	1,250.00	57,875,000	貸付有価証券 3,100株
8282	ケーズホールディングス	241,400	1,299.00	313,578,600	貸付有価証券 42,200株
8289	O l y m p i cグループ	9,300	537.00	4,994,100	貸付有価証券 2,200株
8291	日産東京販売ホールディングス	31,100	356.00	11,071,600	貸付有価証券 6,400株
9262	シルバーライフ	6,500	1,274.00	8,281,000	貸付有価証券 600株
9267	Genky DrugStores	14,900	4,020.00	59,898,000	貸付有価証券 3,000株
9275	ナルミヤ・インターナショナル	4,300	956.00	4,110,800	
9278	ブックオフグループホールディングス	12,300	1,340.00	16,482,000	
9279	ギフトホールディングス	7,200	5,080.00	36,576,000	貸付有価証券 700株

9627	アインホールディングス	47,000	5,620.00	264,140,000	貸付有価証券 5,900株
9828	元気寿司	9,600	3,460.00	33,216,000	貸付有価証券 1,100株
9831	ヤマダホールディングス	1,400,000	436.00	610,400,000	貸付有価証券 141,400株
9842	アークランズ	49,900	1,642.00	81,935,800	貸付有価証券 6,800株
9843	ニトリホールディングス	138,100	19,035.00	2,628,733,500	貸付有価証券 33,600株
9850	グルメ杵屋	27,600	1,077.00	29,725,200	貸付有価証券 2,500株
9854	愛眼	15,500	168.00	2,604,000	貸付有価証券 3,500株
9856	ケーユーホールディングス	20,000	1,428.00	28,560,000	貸付有価証券 2,300株
9861	吉野家ホールディングス	133,600	2,519.00	336,538,400	貸付有価証券 14,400株
9887	松屋フーズホールディングス	16,100	4,355.00	70,115,500	貸付有価証券 3,400株
9900	サガミホールディングス	54,900	1,351.00	74,169,900	貸付有価証券 8,100株
9919	関西フードマーケット	30,800	1,633.00	50,296,400	貸付有価証券 3,600株
9936	王将フードサービス	22,500	6,280.00	141,300,000	貸付有価証券 3,400株
9946	ミニストップ	24,800	1,447.00	35,885,600	貸付有価証券 3,300株
9948	アークス	62,600	2,532.00	158,503,200	貸付有価証券 8,900株
9956	バローホールディングス	65,200	2,092.00	136,398,400	貸付有価証券 9,700株
9974	ベルク	17,000	6,160.00	104,720,000	貸付有価証券 2,200株
9979	大庄	11,300	1,179.00	13,322,700	貸付有価証券 2,900株
9983	ファーストリテイリング	153,600	31,640.00	4,859,904,000	貸付有価証券 12,900株
9989	サンドラッグ	129,600	3,880.00	502,848,000	貸付有価証券 27,600株
9990	サックスパー ホールディングス	32,400	960.00	31,104,000	貸付有価証券 5,300株
9993	ヤマザワ	4,400	1,300.00	5,720,000	貸付有価証券 1,000株
9994	やまや	4,300	2,761.00	11,872,300	貸付有価証券 900株
9997	バルーナ	82,100	756.00	62,067,600	貸付有価証券 9,400株
5830	いよぎんホールディングス	378,200	790.00	298,778,000	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	718,200	1,027.00	737,591,400	貸付有価証券 108,100株
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	267,600	896.00	239,769,600	貸付有価証券 37,600株
5838	楽天銀行	13,700	1,950.00	26,715,000	
7150	島根銀行	6,700	491.00	3,289,700	貸付有価証券 1,100株
7161	じもとホールディングス	14,000	402.00	5,628,000	貸付有価証券 3,800株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,577,100	340.00	536,214,000	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	40,700	2,977.00	121,163,900	貸付有価証券 5,900株
7180	九州フィナンシャルグループ	559,200	498.00	278,481,600	貸付有価証券 87,500株
7182	ゆうちょ銀行	890,600	1,061.00	944,926,600	貸付有価証券 174,400株
7184	富山第一銀行	105,600	613.00	64,732,800	貸付有価証券 15,100株
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,751,700	521.00	912,635,700	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	197,300	1,106.00	218,213,800	貸付有価証券 51,600株
7322	三十三フィナンシャルグループ	28,400	1,572.00	44,644,800	貸付有価証券 4,000株
7327	第四北越フィナンシャルグループ	49,900	3,030.00	151,197,000	貸付有価証券 7,600株
7337	ひろぎんホールディングス	414,700	688.00	285,313,600	貸付有価証券 64,400株
7350	おきなわフィナンシャルグループ	30,300	2,115.00	64,084,500	貸付有価証券 4,000株
7380	十六フィナンシャルグループ	41,200	3,050.00	125,660,000	貸付有価証券 5,500株
7381	北國フィナンシャルホールディングス	35,700	4,750.00	169,575,000	貸付有価証券 5,400株
7384	プロクレアホールディングス	38,900	2,144.00	83,401,600	貸付有価証券 4,600株
7389	あいちフィナンシャルグループ	44,500	2,151.00	95,719,500	貸付有価証券 11,800株
8303	SBI新生銀行	74,400	2,585.00	192,324,000	貸付有価証券 12,400株
8304	あおぞら銀行	199,900	2,465.00	492,753,500	貸付有価証券 35,700株
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,905,200	868.50	17,287,666,200	貸付有価証券 2,303,500株
8308	りそなホールディングス	4,017,200	666.50	2,677,463,800	貸付有価証券 604,300株
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	577,600	4,990.00	2,882,224,000	貸付有価証券 99,400株

8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,322,600	5,697.00	13,231,852,200	貸付有価証券 302,300株
8331	千葉銀行	885,800	885.00	783,933,000	貸付有価証券 4,800株
8334	群馬銀行	616,800	497.00	306,549,600	貸付有価証券 65,300株
8336	武蔵野銀行	40,800	2,218.00	90,494,400	貸付有価証券 3,500株
8337	千葉興業銀行	45,600	534.00	24,350,400	貸付有価証券 12,200株
8338	筑波銀行	139,500	205.00	28,597,500	貸付有価証券 18,200株
8341	七十七銀行	101,800	2,244.00	228,439,200	貸付有価証券 5,000株
8343	秋田銀行	21,300	1,716.00	36,550,800	貸付有価証券 2,800株
8344	山形銀行	35,300	1,061.00	37,453,300	貸付有価証券 4,900株
8345	岩手銀行	21,800	2,115.00	46,107,000	貸付有価証券 2,900株
8346	東邦銀行	251,400	225.00	56,565,000	貸付有価証券 39,100株
8349	東北銀行	9,500	983.00	9,338,500	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	253,700	2,551.00	647,188,700	貸付有価証券 36,900株
8358	スルガ銀行	280,100	522.00	146,212,200	貸付有価証券 44,700株
8359	八十二銀行	651,900	582.00	379,405,800	貸付有価証券 105,400株
8360	山梨中央銀行	32,600	1,105.00	36,023,000	貸付有価証券 5,100株
8361	大垣共立銀行	60,600	1,839.00	111,443,400	貸付有価証券 8,700株
8362	福井銀行	28,400	1,463.00	41,549,200	貸付有価証券 3,800株
8364	清水銀行	12,600	1,443.00	18,181,800	貸付有価証券 1,800株
8365	富山銀行	3,300	1,620.00	5,346,000	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	52,900	2,822.00	149,283,800	貸付有価証券 8,700株
8367	南都銀行	47,800	2,439.00	116,584,200	貸付有価証券 7,200株
8368	百五銀行	299,000	387.00	115,713,000	貸付有価証券 9,000株
8369	京都銀行	100,700	6,760.00	680,732,000	貸付有価証券 15,700株
8370	紀陽銀行	113,700	1,617.00	183,852,900	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	202,000	1,065.00	215,130,000	貸付有価証券 29,000株
8381	山陰合同銀行	198,900	778.00	154,744,200	貸付有価証券 24,700株
8383	鳥取銀行	6,700	1,178.00	7,892,600	貸付有価証券 1,400株
8386	百十四銀行	29,000	1,837.00	53,273,000	貸付有価証券 4,600株
8387	四国銀行	50,500	858.00	43,329,000	貸付有価証券 1,500株
8388	阿波銀行	44,600	2,038.00	90,894,800	貸付有価証券 7,100株
8392	大分銀行	19,100	2,051.00	39,174,100	貸付有価証券 2,500株
8393	宮崎銀行	20,700	2,330.00	48,231,000	
8395	佐賀銀行	18,600	1,655.00	30,783,000	貸付有価証券 2,600株
8399	琉球銀行	72,800	906.00	65,956,800	貸付有価証券 10,100株
8410	セブン銀行	1,138,600	273.00	310,837,800	貸付有価証券 76,700株
8411	みずほフィナンシャルグループ	4,596,600	2,009.50	9,236,867,700	貸付有価証券 339,100株
8416	高知銀行	6,700	680.00	4,556,000	貸付有価証券 1,600株
8418	山口フィナンシャルグループ	350,900	835.00	293,001,500	貸付有価証券 54,500株
8521	長野銀行	6,500	1,498.00	9,737,000	貸付有価証券 1,400株
8522	名古屋銀行	20,900	3,430.00	71,687,000	貸付有価証券 3,500株
8524	北洋銀行	481,600	283.00	136,292,800	貸付有価証券 65,900株
8537	大光銀行	6,300	1,099.00	6,923,700	貸付有価証券 1,500株
8541	愛媛銀行	42,800	830.00	35,524,000	
8542	トマト銀行	6,400	1,028.00	6,579,200	貸付有価証券 800株
8544	京葉銀行	145,500	560.00	81,480,000	貸付有価証券 18,600株
8550	栃木銀行	145,500	266.00	38,703,000	貸付有価証券 21,200株
8551	北日本銀行	11,100	2,021.00	22,433,100	貸付有価証券 1,400株
8558	東和銀行	58,300	542.00	31,598,600	貸付有価証券 7,700株
8562	福島銀行	22,400	224.00	5,017,600	貸付有価証券 6,100株
8563	大東銀行	9,300	647.00	6,017,100	貸付有価証券



					2,200株
8600	トモニホールディングス	256,900	367.00	94,282,300	貸付有価証券 33,800株
8713	フィデアホールディングス	32,800	1,315.00	43,132,000	貸付有価証券 100株
8714	池田泉州ホールディングス	407,000	234.00	95,238,000	貸付有価証券 50,000株
7148	F P G	107,500	1,089.00	117,067,500	貸付有価証券 4,500株
7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	26,000	1,119.00	29,094,000	貸付有価証券 1,700株
7347	マーキュリアホールディングス	11,400	704.00	8,025,600	貸付有価証券 2,300株
8473	S B Iホールディングス	460,200	2,612.00	1,202,042,400	貸付有価証券 66,600株
8518	日本アジア投資	16,700	255.00	4,258,500	貸付有価証券 5,400株
8595	ジャフコ グループ	106,100	1,720.00	182,492,000	貸付有価証券 17,100株
8601	大和証券グループ本社	2,272,700	625.00	1,420,437,500	貸付有価証券 350,400株
8604	野村ホールディングス	5,853,500	489.10	2,862,946,850	貸付有価証券 768,200株
8609	岡三証券グループ	279,000	423.00	118,017,000	貸付有価証券 45,100株
8613	丸三証券	105,700	414.00	43,759,800	貸付有価証券 22,500株
8614	東洋証券	105,400	324.00	34,149,600	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	345,900	354.00	122,448,600	貸付有価証券 50,200株
8617	光世証券	4,400	409.00	1,799,600	貸付有価証券 1,500株
8622	水戸証券	85,300	294.00	25,078,200	貸付有価証券 12,600株
8624	いちよし証券	58,600	588.00	34,456,800	貸付有価証券 8,200株
8628	松井証券	187,700	773.00	145,092,100	貸付有価証券 41,300株
8698	マネックスグループ	342,400	501.00	171,542,400	貸付有価証券 38,000株
8706	極東証券	39,600	615.00	24,354,000	貸付有価証券 5,900株
8707	岩井コスモホールディングス	36,200	1,315.00	47,603,000	貸付有価証券 4,100株
8708	アイザワ証券グループ	45,900	740.00	33,966,000	貸付有価証券 7,800株
8732	マネーパートナーズグループ	22,500	263.00	5,917,500	貸付有価証券 6,800株

8739	スパークス・グループ	35,400	1,341.00	47,471,400	貸付有価証券 3,600株
8742	小林洋行	7,500	241.00	1,807,500	貸付有価証券 1,300株
7181	かんぽ生命保険	385,900	2,232.00	861,328,800	
8630	S O M P Oホールディングス	545,500	5,708.00	3,113,714,000	貸付有価証券 19,900株
8715	アニコムホールディングス	107,900	533.00	57,510,700	貸付有価証券 19,200株
8725	MS&ADインシュアランスグループ ホール	646,800	4,524.00	2,926,123,200	貸付有価証券 114,100株
8750	第一生命ホールディングス	1,552,800	2,515.00	3,905,292,000	貸付有価証券 247,100株
8766	東京海上ホールディングス	3,141,600	2,734.00	8,589,134,400	
8795	T&Dホールディングス	853,000	1,736.00	1,480,808,000	貸付有価証券 26,100株
8798	アドバンスクリエイト	18,400	1,103.00	20,295,200	
7164	全国保証	83,100	4,950.00	411,345,000	貸付有価証券 5,000株
7183	あんしん保証	8,400	312.00	2,620,800	貸付有価証券 1,600株
7187	ジェイリース	7,100	2,131.00	15,130,100	貸付有価証券 1,200株
7191	イントラスト	8,900	950.00	8,455,000	貸付有価証券 1,500株
7192	日本モーゲージサービス	11,700	580.00	6,786,000	貸付有価証券 1,800株
7196	C a s a	7,500	862.00	6,465,000	貸付有価証券 1,600株
7198	アルヒ	39,200	996.00	39,043,200	
7199	プレミアグループ	53,500	1,594.00	85,279,000	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	105,200	523.00	55,019,600	貸付有価証券 13,900株
8253	クレディセゾン	201,400	1,908.00	384,271,200	貸付有価証券 16,300株
8424	芙蓉総合リース	29,200	9,720.00	283,824,000	貸付有価証券 4,800株
8425	みずほリース	47,300	3,885.00	183,760,500	貸付有価証券 6,800株
8439	東京センチュリー	59,400	4,700.00	279,180,000	貸付有価証券 16,600株
8511	日本証券金融	127,400	1,020.00	129,948,000	貸付有価証券 22,700株
8515	アイフル	526,400	355.00	186,872,000	貸付有価証券 66,600株
8566	リコーリース	30,200	3,945.00	119,139,000	貸付有価証券 4,500株

8570	イオンフィナンシャルサービス	182,500	1,223.00	223,197,500	貸付有価証券 26,800株
8572	アコム	566,200	327.00	185,147,400	
8584	ジャックス	33,900	4,585.00	155,431,500	貸付有価証券 4,800株
8585	オリエントコーポレーション	83,000	1,121.00	93,043,000	貸付有価証券 11,800株
8591	オリックス	2,086,300	2,301.00	4,800,576,300	
8593	三菱HCキャピタル	1,239,200	715.00	886,028,000	
8596	九州リースサービス	9,100	775.00	7,052,500	貸付有価証券 2,200株
8697	日本取引所グループ	893,100	2,204.00	1,968,392,400	貸付有価証券 172,000株
8771	イー・ギャランティ	51,600	2,058.00	106,192,800	貸付有価証券 2,700株
8772	アサックス	11,000	621.00	6,831,000	貸付有価証券 3,100株
8793	NECキャピタルソリューション	15,600	2,755.00	42,978,000	貸付有価証券 1,800株
1878	大東建託	116,400	13,260.00	1,543,464,000	貸付有価証券 16,700株
2337	いちご	365,900	247.00	90,377,300	貸付有価証券 55,500株
2353	日本駐車場開発	336,400	241.00	81,072,400	貸付有価証券 47,900株
2975	スター・マイカ・ホールディングス	28,700	646.00	18,540,200	
2980	SREホールディングス	15,600	3,800.00	59,280,000	貸付有価証券 1,000株
2982	ADワークスグループ	47,400	185.00	8,769,000	貸付有価証券 11,700株
3003	ヒューリック	741,400	1,179.00	874,110,600	貸付有価証券 140,800株
3228	三栄建築設計	15,400	1,493.00	22,992,200	貸付有価証券 1,700株
3231	野村不動産ホールディングス	198,700	3,360.00	667,632,000	貸付有価証券 39,800株
3232	三重交通グループホールディングス	68,000	566.00	38,488,000	貸付有価証券 8,900株
3244	サムティ	50,500	2,206.00	111,403,000	貸付有価証券 1,200株
3245	ディア・ライフ	54,200	724.00	39,240,800	
3246	コーセーアールイー	6,200	772.00	4,786,400	貸付有価証券 2,000株
3252	地主	24,300	1,958.00	47,579,400	貸付有価証券 2,700株
3254	プレサンスコーポレーション	50,100	2,030.00	101,703,000	
3271	THEグローバル社	11,300	234.00	2,644,200	貸付有価証券

					2,200株
3275	ハウスコム	3,700	1,055.00	3,903,500	貸付有価証券 600株
3276	JPMC	16,100	1,155.00	18,595,500	貸付有価証券 2,100株
3277	サンセイランディック	5,700	878.00	5,004,600	貸付有価証券 1,300株
3280	エストラスト	2,500	633.00	1,582,500	貸付有価証券 600株
3284	フージャースホールディングス	49,000	903.00	44,247,000	貸付有価証券 1,700株
3288	オープンハウスグループ	116,400	5,700.00	663,480,000	貸付有価証券 13,400株
3289	東急不動産ホールディングス	955,600	747.00	713,833,200	貸付有価証券 118,700株
3291	飯田グループホールディングス	278,400	2,471.00	687,926,400	貸付有価証券 36,400株
3294	イーグランド	3,000	1,476.00	4,428,000	貸付有価証券 700株
3299	ムゲンエステート	13,000	650.00	8,450,000	貸付有価証券 3,000株
3452	ビーロット	13,300	621.00	8,259,300	貸付有価証券 2,000株
3454	ファーストブラザーズ	3,900	909.00	3,545,100	
3457	And Doホールディングス	18,900	1,047.00	19,788,300	貸付有価証券 2,400株
3458	シーアールイー	17,600	1,287.00	22,651,200	貸付有価証券 1,100株
3464	プロパティエージェント	2,500	1,038.00	2,595,000	貸付有価証券 800株
3465	ケイアイスター不動産	15,300	4,230.00	64,719,000	貸付有価証券 1,700株
3467	アグレ都市デザイン	3,500	1,554.00	5,439,000	貸付有価証券 700株
3475	グッドコムアセット	29,500	783.00	23,098,500	
3480	ジェイ・エス・ビー	7,900	4,340.00	34,286,000	貸付有価証券 1,000株
3482	ロードスターキャピタル	18,100	1,383.00	25,032,300	貸付有価証券 1,800株
3484	テンポイノベーション	5,900	1,152.00	6,796,800	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	1,161.00	4,295,700	貸付有価証券 700株
3489	フェイスネットワーク	5,400	804.00	4,341,600	貸付有価証券 800株
4666	パーク24	247,700	2,121.00	525,371,700	貸付有価証券 39,600株
4809	バラカ	11,200	1,981.00	22,187,200	貸付有価証券 1,100株

6620	宮越ホールディングス	14,500	790.00	11,455,000	貸付有価証券 1,600株
8801	三井不動産	1,373,500	2,684.00	3,686,474,000	貸付有価証券 218,700株
8802	三菱地所	1,917,800	1,618.50	3,103,959,300	貸付有価証券 102,000株
8803	平和不動産	51,600	3,930.00	202,788,000	貸付有価証券 8,000株
8804	東京建物	302,900	1,717.00	520,079,300	貸付有価証券 62,800株
8818	京阪神ビルディング	53,500	1,208.00	64,628,000	貸付有価証券 7,100株
8830	住友不動産	574,500	3,372.00	1,937,214,000	貸付有価証券 40,900株
8841	テーオーシー	57,500	642.00	36,915,000	貸付有価証券 14,400株
8842	東京楽天地	5,200	4,275.00	22,230,000	貸付有価証券 700株
8848	レオパレス21	357,800	345.00	123,441,000	貸付有価証券 37,800株
8850	スターツコーポレーション	45,600	2,613.00	119,152,800	貸付有価証券 6,600株
8860	フジ住宅	44,500	703.00	31,283,500	貸付有価証券 5,100株
8864	空港施設	38,400	561.00	21,542,400	貸付有価証券 4,900株
8869	明和地所	9,900	875.00	8,662,500	貸付有価証券 2,400株
8871	ゴールドクレスト	30,200	1,738.00	52,487,600	貸付有価証券 3,400株
8877	エスリード	14,900	2,307.00	34,374,300	貸付有価証券 1,700株
8881	日神グループホールディングス	51,000	472.00	24,072,000	
8892	日本エスコン	71,400	867.00	61,903,800	貸付有価証券 11,000株
8897	MIRARTHホールディングス	160,600	388.00	62,312,800	貸付有価証券 5,200株
8904	AVANTIA	9,900	837.00	8,286,300	貸付有価証券 2,500株
8905	イオンモール	164,800	1,864.00	307,187,200	貸付有価証券 21,900株
8908	毎日コムネット	7,200	831.00	5,983,200	貸付有価証券 1,400株
8917	ファースト住建	7,900	1,105.00	8,729,500	貸付有価証券 2,700株
8918	ランド	1,912,900	8.00	15,303,200	貸付有価証券 234,800株
8919	カチタス	85,400	2,769.00	236,472,600	貸付有価証券 8,300株

8923	トーセイ	52,900	1,629.00	86,174,100	
8928	穴吹興産	4,600	2,375.00	10,925,000	貸付有価証券 1,400株
8934	サンフロンティア不動産	53,000	1,317.00	69,801,000	貸付有価証券 6,000株
8935	F Jネクストホールディングス	33,400	1,035.00	34,569,000	
8940	インテリックス	4,700	575.00	2,702,500	貸付有価証券 1,300株
8944	ランドビジネス	7,100	283.00	2,009,300	
8945	サンネクスタグループ	6,400	1,012.00	6,476,800	貸付有価証券 1,100株
8999	グランディハウス	14,400	557.00	8,020,800	貸付有価証券 3,400株
9706	日本空港ビルディング	112,400	6,810.00	765,444,000	貸付有価証券 15,800株
1717	明豊ファシリティワークス	9,300	793.00	7,374,900	貸付有価証券 1,900株
1954	日本工営	20,000	3,805.00	76,100,000	貸付有価証券 2,800株
2120	L I F U L L	113,400	239.00	27,102,600	貸付有価証券 14,800株
2121	M I X I	75,500	2,900.00	218,950,000	貸付有価証券 8,200株
2124	ジェイエイシーリクルートメント	30,000	2,533.00	75,990,000	貸付有価証券 4,100株
2127	日本M&Aセンターホールディングス	569,300	1,005.00	572,146,500	貸付有価証券 64,000株
2130	メンバーズ	9,700	1,446.00	14,026,200	貸付有価証券 2,300株
2139	中広	3,300	399.00	1,316,700	
2146	U Tグループ	48,700	2,675.00	130,272,500	貸付有価証券 7,900株
2148	アイティメディア	12,600	1,317.00	16,594,200	貸付有価証券 1,300株
2153	E・Jホールディングス	19,400	1,608.00	31,195,200	
2154	オープンアップグループ	99,400	1,995.00	198,303,000	貸付有価証券 6,200株
2157	コシダカホールディングス	99,300	1,126.00	111,811,800	貸付有価証券 10,400株
2163	アルトナー	4,900	1,441.00	7,060,900	貸付有価証券 1,000株
2168	パソナグループ	40,200	1,890.00	75,978,000	貸付有価証券 7,000株
2169	C D S	5,100	1,870.00	9,537,000	貸付有価証券 1,100株
2170	リンクアンドモチベーション	95,500	486.00	46,413,000	貸付有価証券 14,300株

2175	エス・エム・エス	126,200	3,035.00	383,017,000	
2180	サニーサイドアップグループ	7,100	752.00	5,339,200	貸付有価証券 1,400株
2181	パーソルホールディングス	371,400	2,793.00	1,037,320,200	
2183	リニカル	11,500	718.00	8,257,000	貸付有価証券 2,100株
2193	クックパッド	90,800	190.00	17,252,000	貸付有価証券 14,800株
2196	エスクリ	9,200	438.00	4,029,600	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	656.00	6,560,000	貸付有価証券 2,100株
2301	学情	15,000	1,623.00	24,345,000	貸付有価証券 1,500株
2305	スタジオアリス	16,600	2,183.00	36,237,800	貸付有価証券 3,700株
2309	シミックホールディングス	16,000	2,011.00	32,176,000	貸付有価証券 3,500株
2311	エプコ	4,300	740.00	3,182,000	貸付有価証券 700株
2325	N J S	7,300	2,323.00	16,957,900	貸付有価証券 900株
2331	総合警備保障	123,100	3,915.00	481,936,500	貸付有価証券 16,800株
2371	カカクコム	243,500	2,045.00	497,957,500	貸付有価証券 4,900株
2372	アイロムグループ	11,900	1,971.00	23,454,900	貸付有価証券 2,500株
2374	セントケア・ホールディング	21,100	784.00	16,542,400	貸付有価証券 2,700株
2376	サイネックス	3,500	575.00	2,012,500	貸付有価証券 800株
2378	ルネサンス	23,200	932.00	21,622,400	貸付有価証券 3,600株
2379	ディップ	58,100	3,415.00	198,411,500	貸付有価証券 8,000株
2389	デジタルホールディングス	25,900	1,083.00	28,049,700	貸付有価証券 3,500株
2395	新日本科学	35,200	2,250.00	79,200,000	貸付有価証券 6,700株
2410	キャリアデザインセンター	4,200	1,671.00	7,018,200	貸付有価証券 1,100株
2412	ベネフィット・ワン	153,700	1,723.00	264,825,100	貸付有価証券 14,800株
2413	エムスリー	655,500	3,046.00	1,996,653,000	貸付有価証券 15,200株
2418	ツカダ・グローバルホールディング	13,100	440.00	5,764,000	貸付有価証券 2,700株
2424	プラス	2,700	1,153.00	3,113,100	貸付有価証券

					500株
2427	アウトソーシング	197,600	1,441.00	284,741,600	貸付有価証券 24,200株
2428	ウェルネット	18,100	624.00	11,294,400	貸付有価証券 5,600株
2429	ワールドホールディングス	14,900	2,917.00	43,463,300	貸付有価証券 1,400株
2432	ディー・エヌ・エー	132,700	1,982.00	263,011,400	貸付有価証券 24,000株
2433	博報堂DYホールディングス	423,100	1,548.00	654,958,800	貸付有価証券 58,900株
2440	ぐるなび	61,000	374.00	22,814,000	貸付有価証券 9,600株
2445	タカミヤ	45,000	480.00	21,600,000	貸付有価証券 4,500株
2453	ジャパンベストレスクューシステム	16,500	811.00	13,381,500	貸付有価証券 2,900株
2461	ファンコミュニケーションズ	65,000	418.00	27,170,000	貸付有価証券 15,600株
2462	ライク	12,300	1,847.00	22,718,100	貸付有価証券 1,700株
2464	ビジネス・ブレークスルー	7,600	428.00	3,252,800	貸付有価証券 1,700株
2471	エスプール	95,300	614.00	58,514,200	
2475	WDBホールディングス	16,900	2,067.00	34,932,300	貸付有価証券 1,900株
2485	ティア	11,900	447.00	5,319,300	貸付有価証券 2,500株
2487	CDG	2,200	1,350.00	2,970,000	貸付有価証券 300株
2489	アドウェイズ	45,600	698.00	31,828,800	貸付有価証券 7,400株
2491	バリューコマース	25,000	1,385.00	34,625,000	貸付有価証券 2,400株
2492	インフォマート	344,400	294.00	101,253,600	貸付有価証券 62,400株
2749	J Pホールディングス	95,400	318.00	30,337,200	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	111.00	3,918,300	貸付有価証券 7,600株
4286	CLホールディングス	9,200	941.00	8,657,200	貸付有価証券 400株
4290	プレステージ・インターナショナル	139,600	605.00	84,458,000	貸付有価証券 15,800株
4301	アミューズ	18,000	1,864.00	33,552,000	
4310	ドリームインキュベータ	10,100	2,355.00	23,785,500	貸付有価証券 500株
4318	クイック	25,400	2,007.00	50,977,800	貸付有価証券 1,000株



4319	T A C	11,100	203.00	2,253,300	貸付有価証券 2,500株
4324	電通グループ	326,000	4,900.00	1,597,400,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	8,800	1,366.00	12,020,800	貸付有価証券 1,600株
4337	びあ	11,100	3,450.00	38,295,000	貸付有価証券 2,000株
4343	イオンファンタジー	14,300	3,490.00	49,907,000	貸付有価証券 1,600株
4345	シーティーエス	36,700	737.00	27,047,900	貸付有価証券 7,200株
4346	ネクシィーズグループ	6,300	661.00	4,164,300	貸付有価証券 1,500株
4544	H. U. グループホールディングス	97,100	2,779.00	269,840,900	貸付有価証券 11,900株
4641	アルプス技研	28,900	2,720.00	78,608,000	貸付有価証券 3,800株
4651	サニックス	53,100	289.00	15,345,900	貸付有価証券 7,400株
4658	日本空調サービス	35,600	740.00	26,344,000	貸付有価証券 4,400株
4661	オリエンタルランド	1,755,600	5,097.00	8,948,293,200	貸付有価証券 36,200株
4665	ダスキン	73,800	3,405.00	251,289,000	
4668	明光ネットワークジャパン	40,300	660.00	26,598,000	貸付有価証券 7,600株
4671	ファルコホールディングス	15,000	2,007.00	30,105,000	貸付有価証券 3,000株
4678	秀英予備校	4,500	410.00	1,845,000	
4679	田谷	3,700	511.00	1,890,700	貸付有価証券 200株
4680	ラウンドワン	277,400	618.00	171,433,200	貸付有価証券 35,700株
4681	リゾートトラスト	131,000	2,264.00	296,584,000	貸付有価証券 500株
4694	ビー・エム・エル	41,100	3,075.00	126,382,500	貸付有価証券 9,000株
4708	りらいあコミュニケーションズ	54,800	1,462.00	80,117,600	
4714	リソー教育	150,800	285.00	42,978,000	貸付有価証券 19,400株
4718	早稲田アカデミー	18,400	1,488.00	27,379,200	貸付有価証券 700株
4732	ユー・エス・エス	341,200	2,344.00	799,772,800	貸付有価証券 48,200株
4745	東京個別指導学院	39,300	542.00	21,300,600	貸付有価証券 1,500株
4751	サイバーエージェント	732,900	1,171.00	858,225,900	貸付有価証券 117,100株

4755	楽天グループ	1,537,400	707.00	1,086,941,800	貸付有価証券 303,600株
4763	クリーク・アンド・リバー社	19,400	2,096.00	40,662,400	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	54,100	498.00	26,941,800	
4767	テー・オー・ダブリュー	65,000	330.00	21,450,000	貸付有価証券 7,400株
4792	山田コンサルティンググループ	16,800	1,697.00	28,509,600	貸付有価証券 2,500株
4801	セントラルスポーツ	12,500	2,571.00	32,137,500	貸付有価証券 1,200株
4848	フルキャストホールディングス	31,700	2,464.00	78,108,800	貸付有価証券 6,000株
4849	エン・ジャパン	60,000	2,381.00	142,860,000	貸付有価証券 9,900株
5261	リゾルホールディングス	2,200	4,795.00	10,549,000	貸付有価証券 1,100株
6028	テクノプロ・ホールディングス	196,300	3,300.00	647,790,000	貸付有価証券 27,200株
6029	アトラグループ	4,600	185.00	851,000	貸付有価証券 1,000株
6032	インターワークス	5,900	372.00	2,194,800	貸付有価証券 800株
6035	アイ・オールジャパンホールディング ス	17,200	2,198.00	37,805,600	
6036	K e e P e r 技研	20,500	5,690.00	116,645,000	貸付有価証券 4,400株
6037	ファーストロジック	3,000	849.00	2,547,000	貸付有価証券 1,000株
6044	三機サービス	3,500	1,141.00	3,993,500	貸付有価証券 900株
6047	G u n o s y	26,300	577.00	15,175,100	貸付有価証券 4,800株
6048	デザインワン・ジャパン	6,100	180.00	1,098,000	貸付有価証券 800株
6050	イー・ガーディアン	12,600	2,237.00	28,186,200	貸付有価証券 2,200株
6054	リブセンス	9,400	282.00	2,650,800	貸付有価証券 3,700株
6055	ジャパンマテリアル	101,500	2,071.00	210,206,500	貸付有価証券 8,300株
6058	ベクトル	52,100	1,304.00	67,938,400	貸付有価証券 5,300株
6059	ウチヤマホールディングス	10,100	289.00	2,918,900	貸付有価証券 2,100株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	27,600	1,101.00	30,387,600	貸付有価証券 3,300株
6070	キャリアリンク	12,200	2,331.00	28,438,200	

6071	I B J	20,300	658.00	13,357,400	
6073	アサンテ	16,400	1,651.00	27,076,400	貸付有価証券 1,700株
6078	バリューHR	29,000	1,523.00	44,167,000	貸付有価証券 3,200株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	26,800	3,215.00	86,162,000	貸付有価証券 3,000株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	11,800	1,099.00	12,968,200	貸付有価証券 1,600株
6083	E R Iホールディングス	5,700	1,412.00	8,048,400	
6087	アビスト	3,200	3,100.00	9,920,000	貸付有価証券 800株
6088	シグマクシス・ホールディングス	50,300	1,216.00	61,164,800	貸付有価証券 8,800株
6089	ウィルグループ	27,700	1,038.00	28,752,600	貸付有価証券 2,800株
6093	エスクロー・エージェンツ・ジャパン	21,300	145.00	3,088,500	貸付有価証券 5,800株
6095	メドピア	29,100	1,146.00	33,348,600	貸付有価証券 2,000株
6096	レアジョブ	3,900	1,216.00	4,742,400	貸付有価証券 900株
6098	リクルートホールディングス	2,456,100	3,857.00	9,473,177,700	貸付有価証券 303,000株
6099	エラン	43,900	1,011.00	44,382,900	貸付有価証券 6,600株
6171	土木管理総合試験所	8,500	340.00	2,890,000	貸付有価証券 1,900株
6178	日本郵政	4,347,900	1,118.00	4,860,952,200	貸付有価証券 28,400株
6183	バルシステム24ホールディングス	44,500	1,400.00	62,300,000	貸付有価証券 11,200株
6184	鎌倉新書	37,700	906.00	34,156,200	貸付有価証券 5,200株
6185	SMN	4,700	468.00	2,199,600	貸付有価証券 700株
6186	一蔵	2,600	576.00	1,497,600	貸付有価証券 500株
6189	グローバルキッズCOMPANY	3,100	677.00	2,098,700	貸付有価証券 600株
6191	エアトリ	24,100	2,674.00	64,443,400	貸付有価証券 1,900株
6194	アトラエ	19,600	813.00	15,934,800	貸付有価証券 3,000株
6196	ストライク	14,000	3,560.00	49,840,000	貸付有価証券 2,400株
6197	ソラスト	91,400	639.00	58,404,600	
6199	セラク	10,100	1,658.00	16,745,800	貸付有価証券 1,300株

6200	インソース	72,000	1,291.00	92,952,000	貸付有価証券 8,000株
6532	バイカレント・コンサルティング	262,600	5,310.00	1,394,406,000	貸付有価証券 30,100株
6533	Orchestra Holdings	7,100	1,550.00	11,005,000	貸付有価証券 800株
6535	アイモバイル	14,800	1,310.00	19,388,000	貸付有価証券 1,300株
6538	キャリアインデックス	7,000	334.00	2,338,000	貸付有価証券 1,700株
6539	MS-Japan	8,300	1,025.00	8,507,500	貸付有価証券 1,400株
6540	船場	3,500	776.00	2,716,000	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	118,200	2,008.00	237,345,600	貸付有価証券 9,300株
6546	フルテック	2,900	1,135.00	3,291,500	貸付有価証券 700株
6547	グリーンズ	7,700	1,493.00	11,496,100	貸付有価証券 2,300株
6551	ツナググループ・ホールディングス	5,700	700.00	3,990,000	貸付有価証券 200株
6552	GameWith	6,100	363.00	2,214,300	貸付有価証券 1,400株
6555	MS&Consulting	3,000	619.00	1,857,000	貸付有価証券 500株
6556	ウェルビー	24,300	711.00	17,277,300	貸付有価証券 2,400株
6560	エル・ティー・エス	4,300	2,490.00	10,707,000	貸付有価証券 200株
6564	ミダックホールディングス	20,100	2,041.00	41,024,100	貸付有価証券 1,000株
6569	日総工産	24,900	840.00	20,916,000	貸付有価証券 4,800株
6571	キュービーネットホールディングス	15,700	1,418.00	22,262,600	貸付有価証券 2,600株
6572	RPAホールディングス	44,900	370.00	16,613,000	貸付有価証券 2,900株
7030	スプリックス	7,000	944.00	6,608,000	貸付有価証券 2,000株
7033	マネジメントソリューションズ	18,200	3,210.00	58,422,000	貸付有価証券 2,900株
7034	プロレド・パートナーズ	8,100	504.00	4,082,400	貸付有価証券 900株
7035	and factory	5,900	384.00	2,265,600	貸付有価証券 1,000株
7037	テノ.ホールディングス	2,500	753.00	1,882,500	貸付有価証券 800株
7038	フロンティア・マネジメント	11,100	916.00	10,167,600	貸付有価証券 1,700株

7044	ピアラ	3,300	533.00	1,758,900	貸付有価証券 700株
7059	コプロ・ホールディングス	4,000	1,440.00	5,760,000	貸付有価証券 600株
7060	ギークス	3,500	1,133.00	3,965,500	貸付有価証券 800株
7071	アンビスホールディングス	35,500	2,826.00	100,323,000	
7085	カーブスホールディングス	90,600	789.00	71,483,400	貸付有価証券 11,900株
7088	フォーラムエンジニアリング	19,300	858.00	16,559,400	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	11,300	1,775.00	20,057,500	
7354	ダイレクトマーケティングミックス	39,700	1,353.00	53,714,100	貸付有価証券 6,800株
7358	ポピンズ	4,900	1,749.00	8,570,100	貸付有価証券 1,000株
7366	L I T A L I C O	25,800	2,652.00	68,421,600	貸付有価証券 3,100株
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	10,300	460.00	4,738,000	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	184,700	2,000.00	369,400,000	貸付有価証券 32,000株
8920	東祥	23,100	1,250.00	28,875,000	貸付有価証券 3,700株
9216	ビーウィズ	8,300	2,005.00	16,641,500	
9247	T R Eホールディングス	69,800	1,203.00	83,969,400	貸付有価証券 4,900株
9248	人・夢・技術グループ	12,500	1,557.00	19,462,500	貸付有価証券 900株
9336	大栄環境	84,400	1,900.00	160,360,000	
9347	日本管財ホールディングス	34,800	2,710.00	94,308,000	
9603	エイチ・アイ・エス	86,700	2,001.00	173,486,700	貸付有価証券 6,600株
9612	ラックランド	13,700	3,195.00	43,771,500	貸付有価証券 800株
9616	共立メンテナンス	56,800	5,400.00	306,720,000	貸付有価証券 11,100株
9619	イチネンホールディングス	35,100	1,339.00	46,998,900	貸付有価証券 4,700株
9621	建設技術研究所	17,100	3,450.00	58,995,000	貸付有価証券 2,600株
9622	スペース	24,100	1,034.00	24,919,400	貸付有価証券 4,100株
9628	燦ホールディングス	14,100	2,299.00	32,415,900	貸付有価証券 1,900株
9632	スバル興業	1,300	9,620.00	12,506,000	貸付有価証券 300株

9633	東京テアトル	7,500	1,150.00	8,625,000	貸付有価証券 1,900株
9644	タナベコンサルティンググループ	7,900	899.00	7,102,100	貸付有価証券 1,600株
9663	ナガワ	8,900	6,530.00	58,117,000	貸付有価証券 1,600株
9672	東京都競馬	27,800	4,215.00	117,177,000	貸付有価証券 2,700株
9675	常磐興産	7,100	1,276.00	9,059,600	貸付有価証券 1,700株
9678	カナモト	60,800	2,201.00	133,820,800	貸付有価証券 10,200株
9699	ニシオホールディングス	30,800	3,195.00	98,406,000	貸付有価証券 6,100株
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	112,700	26.00	2,930,200	貸付有価証券 27,100株
9715	トランス・コスモス	41,200	3,355.00	138,226,000	貸付有価証券 5,800株
9716	乃村工藝社	144,700	932.00	134,860,400	貸付有価証券 23,200株
9722	藤田観光	14,700	3,855.00	56,668,500	貸付有価証券 2,700株
9726	KNT-CTホールディングス	19,800	1,546.00	30,610,800	貸付有価証券 2,600株
9729	トーカイ	29,400	2,010.00	59,094,000	貸付有価証券 4,100株
9731	白洋舎	1,900	2,260.00	4,294,000	貸付有価証券 500株
9735	セコム	337,900	8,838.00	2,986,360,200	貸付有価証券 52,300株
9740	セントラル警備保障	17,900	2,805.00	50,209,500	貸付有価証券 3,400株
9743	丹青社	64,300	819.00	52,661,700	貸付有価証券 11,100株
9744	メイテック	129,400	2,284.00	295,549,600	貸付有価証券 1,600株
9755	応用地質	31,000	2,037.00	63,147,000	貸付有価証券 4,500株
9757	船井総研ホールディングス	69,000	2,531.00	174,639,000	貸付有価証券 8,700株
9760	進学会ホールディングス	6,700	298.00	1,996,600	貸付有価証券 2,800株
9765	オオバ	12,800	780.00	9,984,000	貸付有価証券 3,300株
9768	いであ	4,500	1,621.00	7,294,500	貸付有価証券 800株
9769	学究社	13,200	2,219.00	29,290,800	
9783	ベネッセホールディングス	123,800	1,979.00	245,000,200	貸付有価証券 18,500株

9787	イオンディライト	36,700	3,035.00	111,384,500	貸付有価証券 7,900株
9788	ナック	14,700	965.00	14,185,500	貸付有価証券 2,400株
9793	ダイセキ	67,700	4,075.00	275,877,500	貸付有価証券 11,400株
9795	ステップ	12,100	1,811.00	21,913,100	貸付有価証券 1,600株
合 計		380,904,800		967,137,737,220	

(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5月12日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	4,620,509,285
コール・ローン	2,797,604,938
国債証券	432,163,832,554
派生商品評価勘定	765,097
未収利息	3,073,913,333
前払費用	457,804,233
流動資産合計	443,114,429,440
資産合計	443,114,429,440
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,928,974
未払金	3,075,466,592
未払解約金	1,084,926,207
未払利息	3,311
流動負債合計	4,165,325,084
負債合計	4,165,325,084
純資産の部	
元本等	
元本	187,414,503,873
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	251,534,600,483

元本等合計	438,949,104,356
純資産合計	438,949,104,356
負債純資産合計	443,114,429,440

## 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5月12日現在]
1. 期首	2022年5月13日
期首元本額	130,645,783,749円
期中追加設定元本額	89,496,876,451円
期中一部解約元本額	32,728,156,327円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	288,855,047円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	622,195,097円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	379,189,541円
三菱UFJ 外国債券オープン	943,508,323円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,245,206,953円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,108,692,888円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,442,752,400円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	546,364,581円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	96,488,467円
ファンド・マネジャー(海外債券)	625,951,232円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,748,942,871円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,330,308,055円
eMAXIS バランス(波乗り型)	227,901,520円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	950,166,493円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	391,387,792円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	201,413,304円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	129,612,489円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	28,814,450,386円
海外債券セレクション(ラップ向け)	5,530,356,826円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	10,187,407,813円
つみたて8資産均等バランス	4,881,952,480円
つみたて4資産均等バランス	1,657,706,534円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,858,584円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,996,018円



eMAXIS マイマネージャー 1990s	430,163円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	199,391,427円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	127,703,170円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	67,394,969円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	625,677,891円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,002,617,862円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,336,382,083円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国債券)	1,685,566,185円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	54,006,522円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	157,298,781円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	21,016,144円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	1,875,465,345円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	10,358,602円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	5,020,170,893円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	45,046,948円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	22,350,024円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	61,692,086円
三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金)	3,023,028,851円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	18,226,597,326円
ワールド・インカムオープン	1,053,216,176円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	14,892,577,798円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	431,469,643円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	1,895,240,582円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	688,643,497円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	519,245,544円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	252,402,895円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	287,539,625円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	150,296,670円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	58,006,403円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,176,683,452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)	8,925円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	14,307,790円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	532,787,246円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	13,027,436円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,689,603,690円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,249,524,589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)	39,738,593,500円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	509,769,954円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	403,401円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	536,373円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	1,446,793,569円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	64,756,271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)	672,493,265円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	29,012,753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)	2,780,155,532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)	670,216,424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)	729,262,532円
海外債券インデックスファンドS	1,589,361,392円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,696,708円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,998,291円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	675,668円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	857,987円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	5,148,930円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,704,278円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	9,981,478円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	5,999,800円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	15,312,462円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,794,102,985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)	206,007,507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)	566,800,741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)	454,194,293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)	178,017,661円
合計	187,414,503,873円
2. 受益権の総数	187,414,503,873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 5月 13日 至 2023年 5月 12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023年 5月 12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5月12日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		△13,456,630,335
合計		△13,456,630,335

(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5月12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	1,599,295,900	—	1,595,743,997	△3,551,903
	カナダドル	7,023,730	—	6,982,591	△41,139
	オーストラリアドル	5,463,240	—	5,411,886	△51,354
	イギリスポンド	25,357,380	—	25,263,978	△93,402
	スウェーデンクローネ	3,256,300	—	3,256,200	△100
	デンマーククローネ	3,945,000	—	3,944,700	△300
	メキシコペソ	5,134,210	—	5,126,103	△8,107
	オフショア元	26,660,076	—	26,635,794	△24,282
ユーロ	185,504,080	—	185,110,790	△393,290	
合計		1,861,639,916	—	1,857,476,039	△4,163,877

(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5月12日現在]
1口当たり純資産額	2.3421円
(1万口当たり純資産額)	(23,421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	6,774,814.46	
		0.25 T-NOTE 250531	5,000,000.00	4,644,726.55	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,172,680.68	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,365,113.27	
		0.25 T-NOTE 250831	4,200,000.00	3,876,714.82	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,009,664.07	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,465,740.27	
		0.375 T-NOTE 240715	6,200,000.00	5,910,464.83	
		0.375 T-NOTE 240815	7,200,000.00	6,845,765.61	
		0.375 T-NOTE 240915	12,000,000.00	11,387,109.36	
		0.375 T-NOTE 250430	4,670,000.00	4,359,426.74	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,339,189.47	
		0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,816,845.73	
		0.375 T-NOTE 260131	7,700,000.00	7,054,373.01	
		0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,298,842.76	
		0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,401,615.20	
	0.5 T-NOTE 250331	6,500,000.00	6,097,685.55		

0.5 T-NOTE 260228	7,900,000.00	7,249,021.51	
0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,707,553.11	
0.5 T-NOTE 270531	4,280,000.00	3,807,444.51	
0.5 T-NOTE 270630	4,700,000.00	4,172,259.74	
0.5 T-NOTE 270831	4,950,000.00	4,375,045.91	
0.5 T-NOTE 271031	7,900,000.00	6,951,845.71	
0.625 T-NOTE 241015	7,400,000.00	7,029,421.91	
0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,233,801.74	
0.625 T-NOTE 270331	1,800,000.00	1,617,011.71	
0.625 T-NOTE 271130	7,550,000.00	6,672,017.58	
0.625 T-NOTE 271231	7,630,000.00	6,729,004.26	
0.625 T-NOTE 300515	12,090,000.00	10,048,395.66	
0.625 T-NOTE 300815	15,160,000.00	12,532,464.10	
0.75 T-NOTE 241115	6,700,000.00	6,362,906.25	
0.75 T-NOTE 260331	8,100,000.00	7,483,957.01	
0.75 T-NOTE 260430	7,000,000.00	6,446,972.63	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,536,312.50	
0.75 T-NOTE 260831	7,600,000.00	6,945,687.50	
0.75 T-NOTE 280131	8,850,000.00	7,838,126.92	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,652,210.89	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,167,968.80	
0.875 T-NOTE 301115	17,730,000.00	14,903,242.44	
1 T-NOTE 241215	8,000,000.00	7,613,906.24	
1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	8,109,544.89	
1.125 T-BOND 400515	6,020,000.00	4,027,285.96	
1.125 T-BOND 400815	7,350,000.00	4,873,968.75	
1.125 T-NOTE 250115	6,000,000.00	5,711,250.00	
1.125 T-NOTE 250228	4,150,000.00	3,943,148.43	
1.125 T-NOTE 261031	7,600,000.00	7,013,523.42	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,708,641.59	
1.125 T-NOTE 280229	8,660,000.00	7,798,905.11	
1.125 T-NOTE 280831	8,500,000.00	7,570,312.50	
1.125 T-NOTE 310215	14,760,000.00	12,616,340.55	
1.25 T-BOND 500515	8,900,000.00	5,104,984.37	
1.25 T-NOTE 240831	9,500,000.00	9,126,679.64	
1.25 T-NOTE 261130	10,200,000.00	9,440,777.37	

1. 25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,578,593.75	
1. 25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,997,365.20	
1. 25 T-NOTE 280430	8,150,000.00	7,357,921.87	
1. 25 T-NOTE 280531	11,250,000.00	10,140,820.31	
1. 25 T-NOTE 280630	8,480,000.00	7,630,012.45	
1. 25 T-NOTE 280930	12,200,000.00	10,916,617.21	
1. 25 T-NOTE 310815	17,720,000.00	15,073,767.14	
1. 375 T-BOND 401115	8,100,000.00	5,593,271.44	
1. 375 T-BOND 500815	10,130,000.00	5,994,902.38	
1. 375 T-NOTE 250131	5,320,000.00	5,083,301.54	
1. 375 T-NOTE 260831	2,000,000.00	1,866,132.82	
1. 375 T-NOTE 281031	8,250,000.00	7,420,810.56	
1. 375 T-NOTE 281231	8,700,000.00	7,809,609.37	
1. 375 T-NOTE 311115	16,700,000.00	14,275,238.32	
1. 5 T-NOTE 240930	6,000,000.00	5,776,523.46	
1. 5 T-NOTE 241031	4,100,000.00	3,940,724.59	
1. 5 T-NOTE 241130	6,430,000.00	6,174,683.79	
1. 5 T-NOTE 250215	6,300,000.00	6,027,205.08	
1. 5 T-NOTE 260815	9,740,000.00	9,132,391.43	
1. 5 T-NOTE 270131	11,540,000.00	10,750,231.25	
1. 5 T-NOTE 281130	7,650,000.00	6,918,767.55	
1. 5 T-NOTE 300215	8,740,000.00	7,769,723.48	
1. 625 T-BOND 501115	10,140,000.00	6,413,153.92	
1. 625 T-NOTE 260215	9,760,000.00	9,247,981.22	
1. 625 T-NOTE 260515	7,670,000.00	7,245,453.53	
1. 625 T-NOTE 260930	2,100,000.00	1,974,697.26	
1. 625 T-NOTE 261031	3,350,000.00	3,146,840.82	
1. 625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,190,023.44	
1. 625 T-NOTE 290815	6,050,000.00	5,466,505.87	
1. 625 T-NOTE 310515	15,460,000.00	13,633,787.50	
1. 75 T-BOND 410815	11,370,000.00	8,254,575.54	
1. 75 T-NOTE 240630	3,500,000.00	3,392,607.43	
1. 75 T-NOTE 240731	5,150,000.00	4,984,435.53	
1. 75 T-NOTE 241231	3,350,000.00	3,224,767.58	
1. 75 T-NOTE 250315	9,030,000.00	8,670,916.45	
1. 75 T-NOTE 261231	4,300,000.00	4,047,458.97	

1. 75 T-NOTE 290131	7,300,000.00	6,677,931.66	
1. 75 T-NOTE 291115	5,150,000.00	4,684,890.62	
1. 875 T-BOND 410215	10,800,000.00	8,096,203.14	
1. 875 T-BOND 510215	11,310,000.00	7,627,623.01	
1. 875 T-BOND 511115	10,450,000.00	7,011,705.03	
1. 875 T-NOTE 260630	3,500,000.00	3,327,802.73	
1. 875 T-NOTE 260731	2,500,000.00	2,374,169.92	
1. 875 T-NOTE 270228	7,700,000.00	7,265,671.87	
1. 875 T-NOTE 290228	8,800,000.00	8,102,187.45	
1. 875 T-NOTE 320215	17,060,000.00	15,149,746.42	
2 T-BOND 411115	9,250,000.00	6,998,022.46	
2 T-BOND 500215	8,090,000.00	5,669,320.31	
2 T-BOND 510815	11,240,000.00	7,795,115.56	
2 T-NOTE 240531	11,730,000.00	11,411,674.19	
2 T-NOTE 240630	7,000,000.00	6,803,671.84	
2 T-NOTE 250215	8,110,000.00	7,829,634.78	
2 T-NOTE 250815	11,490,000.00	11,046,557.81	
2 T-NOTE 261115	9,550,000.00	9,079,960.93	
2. 125 T-NOTE 240731	3,450,000.00	3,354,451.18	
2. 125 T-NOTE 240930	6,800,000.00	6,603,968.78	
2. 125 T-NOTE 241130	1,900,000.00	1,841,775.39	
2. 125 T-NOTE 250515	6,970,000.00	6,730,950.74	
2. 125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,792,871.10	
2. 25 T-BOND 410515	8,940,000.00	7,112,363.69	
2. 25 T-BOND 460815	5,490,000.00	4,126,078.12	
2. 25 T-BOND 490815	6,330,000.00	4,713,624.61	
2. 25 T-BOND 520215	9,580,000.00	7,048,035.88	
2. 25 T-NOTE 241031	2,380,000.00	2,312,783.58	
2. 25 T-NOTE 241115	6,450,000.00	6,264,940.40	
2. 25 T-NOTE 241231	6,900,000.00	6,695,425.76	
2. 25 T-NOTE 251115	10,290,000.00	9,930,251.92	
2. 25 T-NOTE 260331	4,500,000.00	4,336,523.46	
2. 25 T-NOTE 270215	6,810,000.00	6,520,308.99	
2. 25 T-NOTE 270815	6,190,000.00	5,906,372.28	
2. 25 T-NOTE 271115	7,290,000.00	6,940,023.06	
2. 375 T-BOND 420215	7,780,000.00	6,261,988.25	

2.375 T-BOND 491115	6,100,000.00	4,663,878.88	
2.375 T-BOND 510515	11,720,000.00	8,893,007.77	
2.375 T-NOTE 240815	7,590,000.00	7,401,287.70	
2.375 T-NOTE 260430	4,500,000.00	4,348,740.24	
2.375 T-NOTE 270515	7,070,000.00	6,790,514.06	
2.375 T-NOTE 290331	6,200,000.00	5,862,753.91	
2.375 T-NOTE 290515	7,480,000.00	7,066,992.99	
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	4,029,742.18	
2.5 T-BOND 460215	4,030,000.00	3,192,358.21	
2.5 T-BOND 460515	3,830,000.00	3,031,684.37	
2.5 T-NOTE 240515	11,950,000.00	11,695,234.60	
2.5 T-NOTE 240531	6,000,000.00	5,867,877.78	
2.5 T-NOTE 250131	3,350,000.00	3,263,043.94	
2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,347,173.81	
2.5 T-NOTE 270331	9,200,000.00	8,883,031.29	
2.625 T-NOTE 250331	1,960,000.00	1,913,067.19	
2.625 T-NOTE 250415	4,000,000.00	3,902,265.64	
2.625 T-NOTE 251231	3,200,000.00	3,116,375.00	
2.625 T-NOTE 260131	3,900,000.00	3,797,320.33	
2.625 T-NOTE 270531	7,900,000.00	7,656,056.61	
2.625 T-NOTE 290215	10,420,000.00	9,999,129.73	
2.625 T-NOTE 290731	5,600,000.00	5,360,031.26	
2.75 T-BOND 420815	2,120,000.00	1,809,867.19	
2.75 T-BOND 421115	3,100,000.00	2,638,269.53	
2.75 T-BOND 470815	5,160,000.00	4,263,450.00	
2.75 T-BOND 471115	5,110,000.00	4,223,135.53	
2.75 T-NOTE 250228	3,440,000.00	3,365,018.73	
2.75 T-NOTE 250515	6,400,000.00	6,257,875.00	
2.75 T-NOTE 250630	2,370,000.00	2,316,397.25	
2.75 T-NOTE 250831	8,250,000.00	8,065,341.81	
2.75 T-NOTE 270430	9,700,000.00	9,448,406.25	
2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,447,543.97	
2.75 T-NOTE 280215	9,990,000.00	9,710,982.39	
2.75 T-NOTE 290531	5,500,000.00	5,306,210.90	
2.75 T-NOTE 320815	15,810,000.00	15,016,720.91	
2.875 T-BOND 430515	4,880,000.00	4,224,821.88	



2. 875 T-BOND 450815	3,500,000.00	2,977,119.14	
2. 875 T-BOND 461115	2,340,000.00	1,984,155.47	
2. 875 T-BOND 490515	7,270,000.00	6,171,264.47	
2. 875 T-BOND 520515	8,920,000.00	7,536,703.16	
2. 875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	5,879,531.28	
2. 875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,145,730.44	
2. 875 T-NOTE 250615	7,800,000.00	7,647,199.24	
2. 875 T-NOTE 250731	6,100,000.00	5,979,906.25	
2. 875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,723,703.14	
2. 875 T-NOTE 280515	8,990,000.00	8,777,541.03	
2. 875 T-NOTE 280815	9,110,000.00	8,885,808.54	
2. 875 T-NOTE 290430	7,000,000.00	6,801,894.54	
2. 875 T-NOTE 320515	14,680,000.00	14,107,996.13	
3 T-BOND 420515	1,920,000.00	1,710,450.00	
3 T-BOND 441115	3,560,000.00	3,107,212.50	
3 T-BOND 450515	2,190,000.00	1,906,497.65	
3 T-BOND 451115	2,300,000.00	1,998,753.90	
3 T-BOND 470215	4,210,000.00	3,645,925.76	
3 T-BOND 470515	3,390,000.00	2,934,336.33	
3 T-BOND 480215	5,800,000.00	5,022,210.95	
3 T-BOND 480815	6,770,000.00	5,865,305.86	
3 T-BOND 490215	7,090,000.00	6,158,191.21	
3 T-BOND 520815	8,670,000.00	7,518,515.62	
3 T-NOTE 240630	4,100,000.00	4,029,931.65	
3 T-NOTE 240731	6,000,000.00	5,895,351.54	
3 T-NOTE 250715	6,700,000.00	6,584,058.57	
3 T-NOTE 250930	5,400,000.00	5,306,343.75	
3 T-NOTE 251031	3,300,000.00	3,242,894.52	
3. 125 T-BOND 411115	1,990,000.00	1,816,924.40	
3. 125 T-BOND 420215	2,200,000.00	2,003,632.81	
3. 125 T-BOND 430215	2,850,000.00	2,571,345.69	
3. 125 T-BOND 440815	4,130,000.00	3,688,767.56	
3. 125 T-BOND 480515	6,010,000.00	5,325,188.68	
3. 125 T-NOTE 250815	5,000,000.00	4,927,734.40	
3. 125 T-NOTE 270831	7,300,000.00	7,214,453.12	
3. 125 T-NOTE 281115	8,280,000.00	8,164,856.25	

3. 125 T-NOTE 290831	5,900,000.00	5,809,425.79	
3. 25 T-BOND 420515	6,580,000.00	6,082,901.52	
3. 25 T-NOTE 240831	7,400,000.00	7,293,769.52	
3. 25 T-NOTE 270630	6,300,000.00	6,254,349.62	
3. 25 T-NOTE 290630	6,700,000.00	6,643,730.45	
3. 375 T-BOND 420815	6,300,000.00	5,923,476.59	
3. 375 T-BOND 440515	3,160,000.00	2,943,120.32	
3. 375 T-BOND 481115	6,620,000.00	6,146,773.40	
3. 5 T-BOND 390215	760,000.00	755,146.09	
3. 5 T-NOTE 250915	5,100,000.00	5,070,914.08	
3. 5 T-NOTE 280131	8,300,000.00	8,343,445.35	
3. 5 T-NOTE 300131	5,100,000.00	5,135,660.16	
3. 5 T-NOTE 330215	15,100,000.00	15,233,304.60	
3. 625 T-BOND 430815	3,500,000.00	3,405,527.32	
3. 625 T-BOND 440215	3,770,000.00	3,652,334.75	
3. 625 T-BOND 530215	8,690,000.00	8,512,126.54	
3. 625 T-NOTE 280331	4,500,000.00	4,552,382.79	
3. 625 T-NOTE 300331	6,500,000.00	6,603,593.75	
3. 75 T-BOND 410815	2,060,000.00	2,059,114.83	
3. 75 T-BOND 431115	3,450,000.00	3,415,904.28	
3. 75 T-NOTE 260415	7,000,000.00	7,030,625.00	
3. 875 T-BOND 400815	1,870,000.00	1,922,447.65	
3. 875 T-BOND 430215	4,290,000.00	4,325,861.73	
3. 875 T-NOTE 250331	5,000,000.00	4,990,722.65	
3. 875 T-NOTE 260115	6,700,000.00	6,735,201.19	
3. 875 T-NOTE 271130	6,900,000.00	7,042,177.74	
3. 875 T-NOTE 271231	7,000,000.00	7,144,921.84	
3. 875 T-NOTE 290930	5,100,000.00	5,238,257.83	
3. 875 T-NOTE 291130	5,100,000.00	5,243,636.70	
3. 875 T-NOTE 291231	5,700,000.00	5,864,765.62	
4 T-BOND 421115	6,370,000.00	6,548,160.91	
4 T-BOND 521115	8,950,000.00	9,387,710.92	
4 T-NOTE 251215	5,700,000.00	5,745,533.19	
4 T-NOTE 260215	8,000,000.00	8,075,312.48	
4 T-NOTE 280229	6,000,000.00	6,170,156.28	
4 T-NOTE 291031	5,500,000.00	5,692,070.34	

		4 T-NOTE 300228	5,000,000.00	5,187,109.40	
		4.125 T-NOTE 250131	5,000,000.00	5,002,636.70	
		4.125 T-NOTE 270930	5,900,000.00	6,068,242.15	
		4.125 T-NOTE 271031	6,500,000.00	6,690,048.82	
		4.125 T-NOTE 321115	14,300,000.00	15,142,359.35	
		4.25 T-BOND 390515	1,770,000.00	1,917,753.50	
		4.25 T-BOND 401115	2,180,000.00	2,346,991.40	
		4.25 T-NOTE 240930	2,200,000.00	2,197,851.56	
		4.25 T-NOTE 241231	5,200,000.00	5,207,312.50	
		4.25 T-NOTE 251015	6,000,000.00	6,069,257.82	
		4.375 T-BOND 380215	1,000,000.00	1,100,722.65	
		4.375 T-BOND 391115	1,930,000.00	2,115,385.55	
		4.375 T-BOND 400515	2,080,000.00	2,278,168.75	
		4.375 T-BOND 410515	1,760,000.00	1,918,812.50	
		4.375 T-NOTE 241031	4,000,000.00	4,006,328.12	
		4.5 T-BOND 360215	1,160,000.00	1,298,044.53	
		4.5 T-BOND 380515	1,530,000.00	1,704,874.22	
		4.5 T-BOND 390815	1,880,000.00	2,095,832.81	
		4.5 T-NOTE 241130	9,000,000.00	9,038,671.92	
		4.5 T-NOTE 251115	8,700,000.00	8,861,085.89	
		4.625 T-BOND 400215	2,100,000.00	2,371,605.46	
		4.625 T-NOTE 250228	8,000,000.00	8,083,281.28	
		4.625 T-NOTE 260315	6,000,000.00	6,166,640.64	
		4.75 T-BOND 410215	2,010,000.00	2,297,131.62	
		5 T-BOND 370515	1,020,000.00	1,195,850.38	
		5.25 T-BOND 281115	2,690,000.00	2,937,143.75	
		5.375 T-BOND 310215	2,300,000.00	2,619,933.58	
		6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,274,765.62	
		6.125 T-BOND 271115	1,160,000.00	1,292,085.93	
		6.25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,356,124.02	
		アメリカドル合計	1,725,740,000.00	1,585,778,821.18 (213,493,402,695)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	2,020,046.60	
		0.5 CAN GOVT 250901	2,900,000.00	2,707,184.80	
		0.5 CAN GOVT 301201	5,800,000.00	4,897,850.60	
		0.75 CAN GOVT 241001	3,500,000.00	3,351,922.00	

		1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,789,111.93	
		1.25 CAN GOVT 250301	2,100,000.00	2,012,148.60	
		1.25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,337,867.50	
		1.25 CAN GOVT 300601	3,510,000.00	3,165,037.20	
		1.5 CAN GOVT 240901	2,000,000.00	1,937,766.00	
		1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	960,478.00	
		1.5 CAN GOVT 260601	4,070,000.00	3,872,238.70	
		1.5 CAN GOVT 310601	5,900,000.00	5,347,624.30	
		1.5 CAN GOVT 311201	4,270,000.00	3,849,545.91	
		1.75 CAN GOVT 531201	4,500,000.00	3,395,839.50	
		2 CAN GOVT 280601	670,000.00	644,460.94	
		2 CAN GOVT 320601	3,750,000.00	3,506,910.00	
		2 CAN GOVT 511201	6,060,000.00	4,902,812.70	
		2.25 CAN GOVT 250601	4,360,000.00	4,248,235.76	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,147,187.38	
		2.25 CAN GOVT 291201	1,000,000.00	969,752.00	
		2.5 CAN GOVT 240601	4,000,000.00	3,933,080.00	
		2.5 CAN GOVT 321201	2,800,000.00	2,723,901.60	
		2.75 CAN GOVT 270901	2,000,000.00	1,979,558.00	
		2.75 CAN GOVT 330601	2,300,000.00	2,283,396.30	
		2.75 CAN GOVT 481201	1,680,000.00	1,603,457.52	
		2.75 CAN GOVT 551201	450,000.00	425,129.40	
		2.75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,177,291.25	
		3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,965,524.00	
		3.5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	2,049,830.00	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,775,708.55	
		3.75 CAN GOVT 250501	3,500,000.00	3,507,021.00	
		4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,359,865.20	
		5 CAN GOVT 370601	830,000.00	1,020,911.62	
		5.75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,105,163.50	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,791,044.97	
カナダドル合計			93,270,000.00	87,764,903.33	(8,758,059,703)
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	5,450,000.00	5,079,439.51	
		0.5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,766,572.17	
		1 AUST GOVT 301221	3,010,000.00	2,548,777.30	

		1 AUST GOVT 311121	4,250,000.00	3,515,027.22	
		1.25 AUST GOVT 320521	4,530,000.00	3,788,006.56	
		1.5 AUST GOVT 310621	4,740,000.00	4,130,991.08	
		1.75 AUST GOVT 321121	3,980,000.00	3,453,840.84	
		1.75 AUST GOVT 510621	3,070,000.00	1,929,987.15	
		2.25 AUST GOVT 280521	1,900,000.00	1,824,332.02	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,756,410.85	
		2.75 AUST GOVT 271121	2,490,000.00	2,454,005.80	
		2.75 AUST GOVT 281121	1,940,000.00	1,902,370.30	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,900,086.88	
		2.75 AUST GOVT 350621	1,520,000.00	1,405,548.75	
		2.75 AUST GOVT 410521	1,370,000.00	1,173,368.03	
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,951,306.53	
		3 AUST GOVT 470321	2,020,000.00	1,728,887.67	
		3.25 AUST GOVT 250421	5,460,000.00	5,465,745.55	
		3.25 AUST GOVT 290421	2,660,000.00	2,671,825.29	
		3.25 AUST GOVT 390621	2,130,000.00	1,997,288.24	
		3.5 AUST GOVT 341221	2,300,000.00	2,306,356.97	
		3.75 AUST GOVT 340521	1,700,000.00	1,749,451.30	
		3.75 AUST GOVT 370421	2,150,000.00	2,172,519.10	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,490,000.00	2,572,333.59	
		4.5 AUST GOVT 330421	3,100,000.00	3,389,202.10	
		4.75 AUST GOVT 270421	3,050,000.00	3,237,656.13	
オーストラリアドル合計			80,430,000.00	74,871,336.93	(6,755,640,731)
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	2,600,000.00	2,366,052.00	
		0.125 GILT 280131	2,300,000.00	1,956,978.00	
		0.25 GILT 250131	4,100,000.00	3,838,297.00	
		0.25 GILT 310731	4,460,000.00	3,402,043.40	
		0.375 GILT 261022	3,750,000.00	3,345,000.00	
		0.375 GILT 301022	2,390,000.00	1,895,166.75	
		0.5 GILT 290131	4,900,000.00	4,104,534.00	
		0.5 GILT 611022	2,550,000.00	844,757.62	
		0.625 GILT 250607	2,880,000.00	2,703,046.46	
		0.625 GILT 350731	4,030,000.00	2,772,849.56	
		0.625 GILT 501022	1,590,000.00	689,688.57	

0.875 GILT 291022	2,320,000.00	1,967,397.12	
0.875 GILT 330731	2,350,000.00	1,785,154.00	
0.875 GILT 460131	2,420,000.00	1,267,184.60	
1 GILT 320131	5,100,000.00	4,099,890.00	
1.125 GILT 390131	3,550,000.00	2,356,029.92	
1.125 GILT 731022	1,500,000.00	613,633.20	
1.25 GILT 270722	2,100,000.00	1,910,538.00	
1.25 GILT 411022	3,750,000.00	2,386,621.80	
1.25 GILT 510731	3,480,000.00	1,835,031.84	
1.5 GILT 260722	2,490,000.00	2,328,223.55	
1.5 GILT 470722	3,160,000.00	1,893,536.46	
1.5 GILT 530731	1,250,000.00	691,900.00	
1.625 GILT 281022	1,790,000.00	1,621,295.36	
1.625 GILT 541022	2,060,000.00	1,171,233.60	
1.625 GILT 711022	2,530,000.00	1,307,908.80	
1.75 GILT 370907	3,340,000.00	2,540,664.52	
1.75 GILT 490122	1,780,000.00	1,115,554.48	
1.75 GILT 570722	2,830,000.00	1,647,626.00	
2 GILT 250907	2,100,000.00	2,015,229.23	
2.5 GILT 650722	2,480,000.00	1,747,060.80	
3.25 GILT 330131	2,100,000.00	2,023,140.00	
3.25 GILT 440122	3,060,000.00	2,684,684.88	
3.5 GILT 251022	2,500,000.00	2,464,401.35	
3.5 GILT 450122	3,190,000.00	2,893,480.56	
3.5 GILT 680722	2,250,000.00	2,038,167.00	
3.75 GILT 380129	1,250,000.00	1,215,737.50	
3.75 GILT 520722	1,810,000.00	1,698,480.10	
3.75 GILT 531022	2,150,000.00	2,009,175.00	
4 GILT 600122	1,980,000.00	1,975,376.70	
4.125 GILT 270129	3,300,000.00	3,325,674.00	
4.25 GILT 271207	2,450,000.00	2,514,753.01	
4.25 GILT 320607	2,770,000.00	2,907,588.67	
4.25 GILT 360307	2,410,000.00	2,509,521.43	
4.25 GILT 390907	2,320,000.00	2,376,538.40	
4.25 GILT 401207	2,120,000.00	2,169,295.93	
4.25 GILT 461207	2,680,000.00	2,718,768.88	

		4. 25 GILT 491207	2,340,000.00	2,380,337.85	
		4. 25 GILT 551207	2,770,000.00	2,853,986.40	
		4. 5 GILT 340907	1,990,000.00	2,123,084.83	
		4. 5 GILT 421207	2,790,000.00	2,945,659.68	
		4. 75 GILT 301207	3,650,000.00	3,934,705.84	
		4. 75 GILT 381207	2,310,000.00	2,516,278.38	
		5 GILT 250307	2,490,000.00	2,532,379.80	
		6 GILT 281207	1,890,000.00	2,118,217.50	
イギリスポンド合計			146,500,000.00	123,149,560.33 (20,750,700,915)	
シンガポ ールドル	国債証券	1. 25 SINGAPORGOVT 261101	700,000.00	662,550.00	
		1. 625 SINGAPORGOV 310701	1,050,000.00	967,050.00	
		1. 875 SINGAPORGOV 500301	700,000.00	642,950.00	
		1. 875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00	884,592.50	
		2. 125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00	1,494,045.00	
		2. 25 SINGAPORGOVT 360801	1,300,000.00	1,245,660.00	
		2. 375 SINGAPORGOV 250601	1,560,000.00	1,537,785.60	
		2. 375 SINGAPORGOV 390701	380,000.00	370,625.40	
		2. 625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00	797,776.00	
		2. 625 SINGAPORGOV 320801	700,000.00	693,605.50	
		2. 75 SINGAPORGOVT 420401	980,000.00	1,026,888.10	
		2. 75 SINGAPORGOVT 460301	1,140,000.00	1,208,400.00	
		2. 875 SINGAPORGOV 270901	1,000,000.00	1,006,000.00	
		2. 875 SINGAPORGOV 290701	920,000.00	930,580.00	
		2. 875 SINGAPORGOVT 300901	1,340,000.00	1,354,740.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,500,000.00	1,492,950.00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	560,000.00	690,760.00	
		3. 375 SINGAPORGOV 330901	780,000.00	825,786.00	
3. 5 SINGAPORGOVT 270301	1,000,000.00	1,025,900.00			
シンガポールドル合計			18,890,000.00	18,858,644.10 (1,906,986,091)	
マレーシ アリング ット	国債証券	2. 632 MALAYSIAGOV 310415	2,800,000.00	2,587,450.34	
		3. 478 MALAYSIAGOV 240614	1,300,000.00	1,305,856.63	
		3. 502MALAYSIAGOV 270531	3,000,000.00	2,995,187.03	
		3. 582 MALAYSIAGOV 320715	2,100,000.00	2,080,779.12	
		3. 733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,827,861.96	

		3. 757 MALAYSIAGOV 400522	3, 630, 000. 00	3, 540, 019. 84	
		3. 828 MALAYSIAGOV 340705	2, 300, 000. 00	2, 302, 758. 39	
		3. 844 MALAYSIAGOV 330415	2, 400, 000. 00	2, 408, 407. 92	
		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	2, 410, 000. 00	2, 439, 788. 56	
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	3, 600, 000. 00	3, 641, 572. 08	
		3. 892 MALAYSIAGOV 270315	5, 100, 000. 00	5, 170, 316. 76	
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	5, 640, 000. 00	5, 737, 737. 25	
		3. 9 MALAYSIAGOV 261130	1, 100, 000. 00	1, 116, 691. 40	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	1, 400, 000. 00	1, 422, 793. 54	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	4, 270, 000. 00	4, 334, 939. 86	
		4. 059 MALAYSIAGOV 240930	2, 000, 000. 00	2, 022, 926. 20	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	5, 250, 000. 00	5, 189, 400. 96	
		4. 181 MALAYSIAGOV 240715	2, 500, 000. 00	2, 527, 980. 50	
		4. 232MALAYSIAGOV 310630	2, 550, 000. 00	2, 637, 144. 46	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	2, 150, 000. 00	2, 213, 007. 90	
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	900, 000. 00	925, 950. 06	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	600, 000. 00	631, 887. 60	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	2, 240, 000. 00	2, 356, 669. 95	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	1, 500, 000. 00	1, 567, 015. 20	
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	1, 200, 000. 00	1, 292, 560. 44	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	1, 900, 000. 00	2, 097, 767. 58	
		4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1, 650, 000. 00	1, 806, 323. 80	
		4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4, 440, 000. 00	4, 814, 681. 38	
		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	2, 750, 000. 00	3, 065, 621. 62	
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	2, 020, 000. 00	2, 327, 690. 44	
		4. 935 MALAYSIAGOV 430930	1, 000, 000. 00	1, 118, 444. 60	
		マレーシアリングット合計	78, 500, 000. 00	80, 507, 233. 37 (2, 420, 297, 007)	
ニュージーランドドル	国債証券	0. 25 NZ GOVT 280515	2, 000, 000. 00	1, 659, 007. 70	
		1. 75 NZ GOVT 410515	600, 000. 00	400, 557. 48	
		2 NZ GOVT 320515	2, 300, 000. 00	1, 939, 169. 34	
		2. 75 NZ GOVT 250415	2, 000, 000. 00	1, 931, 295. 04	
		2. 75 NZ GOVT 370415	1, 450, 000. 00	1, 210, 271. 68	
		2. 75 NZ GOVT 510515	680, 000. 00	503, 031. 31	
		3 NZ GOVT 290420	1, 700, 000. 00	1, 604, 927. 87	
		3. 5 NZ GOVT 330414	800, 000. 00	760, 234. 72	



		4. 5 NZ GOVT 270415	1, 800, 000. 00	1, 825, 616. 70	
ニュージーランドドル合計			13, 330, 000. 00	11, 834, 111. 84 (1, 003, 059, 319)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	9, 450, 000. 00	8, 034, 966. 45	
		0. 75 SWD GOVT 280512	8, 000, 000. 00	7, 421, 679. 35	
		0. 75 SWD GOVT 291112	12, 200, 000. 00	11, 123, 223. 12	
		1 SWD GOVT 261112	11, 960, 000. 00	11, 371, 420. 29	
		1. 75 SWD GOVT 331111	3, 500, 000. 00	3, 362, 894. 53	
		2. 25 SWD GOVT 320601	6, 750, 000. 00	6, 764, 509. 12	
		2. 5 SWD GOVT 250512	8, 840, 000. 00	8, 785, 945. 42	
		3. 5 SWD GOVT 390330	6, 470, 000. 00	7, 460, 880. 50	
スウェーデンクローネ合計			67, 170, 000. 00	64, 325, 518. 78 (838, 161, 509)	
ノルウェークローネ	国債証券	1. 25 NORWE GOVT 310917	4, 700, 000. 00	4, 049, 031. 20	
		1. 375 NORWE GOVT 300819	8, 770, 000. 00	7, 773, 036. 04	
		1. 5 NORWE GOVT 260219	6, 040, 000. 00	5, 760, 317. 80	
		1. 75 NORWE GOVT 250313	10, 200, 000. 00	9, 894, 838. 44	
		1. 75 NORWE GOVT 270217	5, 120, 000. 00	4, 868, 459. 52	
		1. 75 NORWE GOVT 290906	4, 600, 000. 00	4, 245, 487. 20	
		2 NORWE GOVT 280426	6, 900, 000. 00	6, 541, 310. 40	
		2. 125 NORWE GOVT 320518	5, 500, 000. 00	5, 057, 470. 00	
		3 NORWE GOVT 330815	4, 500, 000. 00	4, 441, 241. 70	
ノルウェークローネ合計			56, 330, 000. 00	52, 631, 192. 30 (664, 205, 646)	
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 241115	4, 800, 000. 00	4, 603, 440. 00	
		0 DMK GOVT 311115	14, 550, 000. 00	11, 873, 051. 56	
		0. 25 DMK GOVT 521115	8, 900, 000. 00	4, 713, 155. 20	
		0. 5 DMK GOVT 271115	10, 200, 000. 00	9, 388, 233. 00	
		0. 5 DMK GOVT 291115	10, 550, 000. 00	9, 360, 540. 25	
		1. 75 DMK GOVT 251115	7, 490, 000. 00	7, 336, 724. 64	
		4. 5 DMK GOVT 391115	15, 650, 000. 00	19, 536, 411. 45	
デンマーククローネ合計			72, 140, 000. 00	66, 811, 556. 10 (1, 318, 192, 001)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	58, 650, 000. 00	58, 093, 227. 92	
		10 MEXICAN BONOS 361120	12, 350, 000. 00	13, 566, 475. 00	
		5 MEXICAN BONOS 250306	49, 000, 000. 00	44, 787, 960. 00	

		5. 5 MEXICAN BONOS 270304	34,000,000.00	30,188,600.00	
		5. 75 MEXICAN BONO 260305	65,500,000.00	59,562,624.12	
		7. 5 MEXICAN BONOS 270603	48,750,000.00	46,332,000.00	
		7. 5 MEXICAN BONOS 330526	10,000,000.00	9,167,450.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 310529	68,050,000.00	64,052,062.50	
		7. 75 MEXICAN BONO 341123	13,400,000.00	12,423,140.00	
		7. 75 MEXICAN BONO 421113	35,190,000.00	31,065,732.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	12,000,000.00	11,592,971.76	
		8 MEXICAN BONOS 471107	39,100,000.00	35,273,283.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	20,500,000.00	18,355,085.00	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290531	39,150,000.00	38,674,327.50	
		8. 5 MEXICAN BONOS 381118	39,700,000.00	38,183,460.00	
メキシコペソ合計			545,340,000.00	511,318,398.80	(3,918,232,890)
イスラエル シェケル	国債証券	0. 5 ISRAEL FIXED 250430	6,500,000.00	6,082,050.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,370,000.00	2,859,445.00	
		1. 3 ISRAEL FIXED 320430	1,300,000.00	1,078,285.00	
		1. 5 ISRAEL FIXED 370531	4,900,000.00	3,771,040.00	
		2. 25 ISRAEL FIXED 280928	3,080,000.00	2,943,556.00	
		2. 8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	636,800.00	
		3. 75 ISRAEL FIXED 470331	3,790,000.00	3,672,320.50	
		5. 5 ISRAEL FIXED 420131	3,130,000.00	3,850,995.50	
		6. 25 ISRAEL FIXED 261030	5,000,000.00	5,574,500.00	
イスラエルシェケル合計			31,870,000.00	30,468,992.00	(1,125,216,827)
ポーランド ズロチ	国債証券	0. 25 POLAND 261025	3,000,000.00	2,500,290.00	
		0. 75 POLAND 250425	3,500,000.00	3,190,600.00	
		1. 25 POLAND 301025	5,890,000.00	4,346,348.80	
		1. 75 POLAND 320425	7,600,000.00	5,552,940.00	
		2. 25 POLAND 241025	4,000,000.00	3,816,900.00	
		2. 5 POLAND 260725	7,840,000.00	7,119,268.80	
		2. 5 POLAND 270725	6,110,000.00	5,394,824.50	
		2. 75 POLAND 280425	5,760,000.00	5,047,488.00	
		2. 75 POLAND 291025	7,900,000.00	6,684,743.00	
		3. 25 POLAND 250725	8,700,000.00	8,268,219.00	
		3. 75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,721,600.00	

		5. 75 POLAND 290425	1, 450, 000. 00	1, 457, 395. 00	
		7. 5 POLAND 280725	3, 500, 000. 00	3, 763, 754. 75	
ポーランドズロチ合計			69, 250, 000. 00	60, 864, 371. 85 (1, 970, 642, 286)	
中国元	国債証券	1. 99 CHINA GOVT 240915	14, 000, 000. 00	13, 950, 161. 12	
		1. 99 CHINA GOVT 250409	20, 000, 000. 00	19, 866, 593. 80	
		2. 18 CHINA GOVT 240625	26, 000, 000. 00	25, 992, 937. 88	
		2. 18 CHINA GOVT 250825	16, 000, 000. 00	15, 923, 289. 60	
		2. 24 CHINA GOVT 250525	9, 000, 000. 00	8, 979, 784. 83	
		2. 26 CHINA GOVT 250224	14, 000, 000. 00	13, 985, 313. 16	
		2. 28 CHINA GOVT 251125	22, 000, 000. 00	21, 946, 186. 68	
		2. 29 CHINA GOVT 241225	33, 000, 000. 00	33, 014, 826. 90	
		2. 35 CHINA GOVT 250315	12, 000, 000. 00	12, 010, 218. 00	
		2. 37 CHINA GOVT 270120	21, 000, 000. 00	20, 887, 009. 08	
		2. 44 CHINA GOVT 271015	15, 000, 000. 00	14, 924, 957. 85	
		2. 46 CHINA GOVT 260215	20, 000, 000. 00	20, 033, 076. 00	
		2. 47 CHINA GOVT 240902	16, 000, 000. 00	16, 047, 028. 80	
		2. 48 CHINA GOVT 270415	13, 000, 000. 00	12, 974, 079. 82	
		2. 5 CHINA GOVT 270725	17, 000, 000. 00	16, 962, 381. 55	
		2. 6 CHINA GOVT 320901	17, 000, 000. 00	16, 753, 601. 15	
		2. 62 CHINA GOVT 280415	8, 000, 000. 00	8, 016, 990. 40	
		2. 62 CHINA GOVT 290925	14, 000, 000. 00	13, 922, 353. 06	
		2. 64 CHINA GOVT 280115	19, 000, 000. 00	19, 052, 432. 40	
		2. 68 CHINA GOVT 300521	27, 000, 000. 00	26, 907, 834. 15	
		2. 69 CHINA GOVT 260812	24, 000, 000. 00	24, 163, 408. 80	
		2. 69 CHINA GOVT 320815	17, 000, 000. 00	16, 879, 060. 81	
		2. 74 CHINA GOVT 260804	5, 000, 000. 00	5, 042, 788. 50	
		2. 75 CHINA GOVT 290615	20, 000, 000. 00	20, 061, 090. 00	
		2. 75 CHINA GOVT 320217	15, 000, 000. 00	14, 969, 448. 45	
		2. 76 CHINA GOVT 320515	16, 000, 000. 00	15, 985, 104. 16	
		2. 79 CHINA GOVT 291215	19, 000, 000. 00	19, 077, 958. 90	
		2. 8 CHINA GOVT 290324	14, 000, 000. 00	14, 089, 611. 20	
		2. 8 CHINA GOVT 300325	15, 000, 000. 00	15, 077, 284. 50	
		2. 8 CHINA GOVT 321115	17, 000, 000. 00	17, 049, 526. 10	
2. 85 CHINA GOVT 270604	22, 000, 000. 00	22, 267, 979. 80			
2. 88 CHINA GOVT 330225	13, 000, 000. 00	13, 168, 487. 80			

2.89 CHINA GOVT 311118	18,000,000.00	18,156,787.20	
2.9 CHINA GOVT 260505	17,000,000.00	17,243,169.70	
2.91 CHINA GOVT 281014	16,000,000.00	16,222,400.00	
2.94 CHINA GOVT 241017	10,000,000.00	10,105,691.00	
2.99 CHINA GOVT 251015	9,000,000.00	9,136,429.20	
3.01 CHINA GOVT 280513	21,000,000.00	21,428,983.80	
3.02 CHINA GOVT 251022	22,000,000.00	22,353,163.80	
3.02 CHINA GOVT 310527	30,000,000.00	30,625,500.00	
3.03 CHINA GOVT 260311	28,000,000.00	28,504,084.00	
3.12 CHINA GOVT 261205	17,000,000.00	17,369,146.50	
3.12 CHINA GOVT 521025	8,000,000.00	8,053,488.80	
3.13 CHINA GOVT 291121	21,000,000.00	21,599,621.40	
3.22 CHINA GOVT 251206	13,000,000.00	13,293,176.00	
3.25 CHINA GOVT 260606	18,000,000.00	18,467,424.00	
3.25 CHINA GOVT 281122	17,000,000.00	17,622,504.30	
3.27 CHINA GOVT 301119	24,000,000.00	25,050,868.80	
3.28 CHINA GOVT 271203	24,000,000.00	24,822,057.60	
3.29 CHINA GOVT 290523	25,000,000.00	26,011,370.00	
3.32 CHINA GOVT 520415	14,000,000.00	14,502,796.00	
3.39 CHINA GOVT 500316	20,000,000.00	20,896,886.00	
3.52 CHINA GOVT 270504	19,000,000.00	19,851,688.30	
3.53 CHINA GOVT 511018	12,000,000.00	12,889,687.20	
3.54 CHINA GOVT 280816	13,000,000.00	13,686,185.50	
3.57 CHINA GOVT 240622	10,000,000.00	10,175,304.00	
3.59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,345,699.20	
3.6 CHINA GOVT 250906	8,000,000.00	8,262,017.60	
3.61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,312,053.00	
3.69 CHINA GOVT 240921	20,000,000.00	20,460,810.00	
3.69 CHINA GOVT 280517	18,000,000.00	19,091,507.40	
3.72 CHINA GOVT 510412	14,000,000.00	15,511,727.00	
3.77 CHINA GOVT 250308	11,000,000.00	11,343,811.60	
3.81 CHINA GOVT 500914	23,000,000.00	25,823,070.60	
3.86 CHINA GOVT 490722	17,000,000.00	19,191,769.20	
4.08 CHINA GOVT 481022	16,000,000.00	18,664,628.80	
中国元合計	1,120,000,000.00	1,144,058,312.75 (22,153,430,762)	

ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	800,000.00	760,220.00	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	900,000.00	781,730.10	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	2,150,000.00	1,794,858.70	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	2,130,000.00	1,722,950.61	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	810,000.00	475,523.46	
		0 BEL GOVT 271022	1,800,000.00	1,610,532.00	
		0 BEL GOVT 311022	1,700,000.00	1,347,129.30	
		0 BUND 260815	5,930,000.00	5,513,885.97	
		0 BUND 271115	3,100,000.00	2,816,238.40	
		0 BUND 281115	4,400,000.00	3,916,871.20	
		0 BUND 290815	4,550,000.00	3,989,694.80	
		0 BUND 300215	4,120,000.00	3,575,492.56	
		0 BUND 300815	4,960,000.00	4,260,615.20	
		0 BUND 300815	650,000.00	559,402.35	
		0 BUND 310215	3,700,000.00	3,143,335.00	
		0 BUND 310815	5,400,000.00	4,537,004.40	
		0 BUND 310815	1,900,000.00	1,598,445.30	
		0 BUND 320215	4,690,000.00	3,892,990.78	
		0 BUND 350515	3,630,000.00	2,757,533.13	
		0 BUND 360515	3,800,000.00	2,804,954.80	
		0 BUND 500815	5,350,000.00	2,863,282.55	
		0 BUND 500815	1,560,000.00	838,055.40	
		0 BUND 520815	3,690,000.00	1,878,844.68	
		0 FINNISH GOVT 240915	850,000.00	820,136.10	
		0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	616,404.75	
		0 IRISH GOVT 311018	1,350,000.00	1,083,191.73	
		0 ITALY GOVT 240815	2,500,000.00	2,400,382.50	
		0 ITALY GOVT 241215	2,000,000.00	1,901,516.00	
		0 ITALY GOVT 260401	3,300,000.00	3,002,326.80	
		0 ITALY GOVT 260801	2,500,000.00	2,248,897.50	
		0 NETH GOVT 260115	2,200,000.00	2,059,294.16	
		0 NETH GOVT 270115	1,950,000.00	1,785,523.35	
		0 NETH GOVT 290115	1,300,000.00	1,134,972.80	
		0 NETH GOVT 300715	2,650,000.00	2,227,311.48	
0 NETH GOVT 310715	1,620,000.00	1,325,700.43			
0 NETH GOVT 380115	1,540,000.00	1,036,196.70			

0 NETH GOVT 520115	2,830,000.00	1,367,351.85	
0 O. A. T 250225	2,900,000.00	2,764,329.30	
0 O. A. T 250325	7,380,000.00	7,023,477.14	
0 O. A. T 260225	6,600,000.00	6,149,451.00	
0 O. A. T 270225	6,130,000.00	5,581,358.87	
0 O. A. T 291125	6,380,000.00	5,408,517.40	
0 O. A. T 301125	8,390,000.00	6,904,340.75	
0 O. A. T 311125	9,100,000.00	7,263,847.50	
0 O. A. T 320525	5,430,000.00	4,265,547.36	
0 OBL 241018	4,400,000.00	4,235,085.40	
0 OBL 250411	2,800,000.00	2,669,772.00	
0 OBL 251010	4,000,000.00	3,775,243.31	
0 OBL 251010	1,000,000.00	945,141.27	
0 OBL 260410	3,700,000.00	3,460,857.90	
0 OBL 261009	2,900,000.00	2,687,321.97	
0 OBL 270416	3,050,000.00	2,800,098.25	
0 SPAIN GOVT 240531	5,600,000.00	5,421,223.64	
0 SPAIN GOVT 250131	3,630,000.00	3,459,190.35	
0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,359,175.00	
0 SPAIN GOVT 260131	3,000,000.00	2,781,423.00	
0 SPAIN GOVT 270131	2,800,000.00	2,522,364.32	
0 SPAIN GOVT 280131	3,800,000.00	3,325,836.00	
0. 1 BEL GOVT 300622	2,520,000.00	2,108,975.40	
0. 1 SPAIN GOVT 310430	4,360,000.00	3,451,713.90	
0. 125 FINNISH GOV 310915	1,070,000.00	862,795.57	
0. 125 FINNISH GOV 360415	510,000.00	353,794.65	
0. 125 FINNISH GOV 520415	750,000.00	347,226.75	
0. 2 IRISH GOVT 270515	500,000.00	456,718.50	
0. 2 IRISH GOVT 301018	620,000.00	522,553.05	
0. 2 SCHATS 240614	3,800,000.00	3,693,619.76	
0. 25 AUSTRIA GOVT 361020	1,050,000.00	731,146.50	
0. 25 BUND 270215	4,490,000.00	4,177,769.89	
0. 25 BUND 280815	4,170,000.00	3,782,265.06	
0. 25 BUND 290215	4,050,000.00	3,641,764.05	
0. 25 FINNISH GOVT 400915	540,000.00	337,688.46	
0. 25 ITALY GOVT 280315	2,700,000.00	2,314,947.60	

0. 25 NETH GOVT 250715	1, 930, 000. 00	1, 838, 818. 40	
0. 25 NETH GOVT 290715	2, 950, 000. 00	2, 587, 931. 75	
0. 25 O. A. T 261125	5, 680, 000. 00	5, 246, 445. 60	
0. 25 SPAIN GOVT 240730	2, 700, 000. 00	2, 610, 667. 80	
0. 35 BEL GOVT 320622	2, 450, 000. 00	1, 964, 510. 45	
0. 35 IRISH GOVT 321018	400, 000. 00	323, 314. 66	
0. 35 ITALY GOVT 250201	3, 060, 000. 00	2, 914, 809. 12	
0. 4 BEL GOVT 400622	1, 300, 000. 00	816, 416. 90	
0. 4 IRISH GOVT 350515	700, 000. 00	527, 335. 90	
0. 45 ITALY GOVT 290215	2, 300, 000. 00	1, 922, 869. 00	
0. 5 AUSTRIA GOVT 270420	2, 300, 000. 00	2, 125, 581. 80	
0. 5 AUSTRIA GOVT 290220	2, 050, 000. 00	1, 819, 764. 50	
0. 5 BEL GOVT 241022	2, 190, 000. 00	2, 121, 046. 75	
0. 5 BUND 250215	7, 110, 000. 00	6, 862, 074. 30	
0. 5 BUND 260215	6, 660, 000. 00	6, 336, 343. 98	
0. 5 BUND 270815	5, 120, 000. 00	4, 777, 994. 24	
0. 5 BUND 280215	4, 280, 000. 00	3, 965, 719. 60	
0. 5 FINNISH GOVT 260415	1, 670, 000. 00	1, 578, 575. 85	
0. 5 FINNISH GOVT 270915	700, 000. 00	642, 861. 80	
0. 5 FINNISH GOVT 280915	1, 480, 000. 00	1, 329, 590. 56	
0. 5 FINNISH GOVT 290915	720, 000. 00	631, 378. 80	
0. 5 FINNISH GOVT 430415	480, 000. 00	297, 425. 28	
0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 450, 000. 00	2, 273, 421. 15	
0. 5 ITALY GOVT 280715	2, 400, 000. 00	2, 059, 560. 00	
0. 5 NETH GOVT 260715	3, 970, 000. 00	3, 737, 159. 50	
0. 5 NETH GOVT 320715	2, 300, 000. 00	1, 921, 608. 60	
0. 5 NETH GOVT 400115	2, 630, 000. 00	1, 852, 671. 94	
0. 5 O. A. T 250525	6, 490, 000. 00	6, 214, 804. 53	
0. 5 O. A. T 260525	7, 530, 000. 00	7, 084, 547. 79	
0. 5 O. A. T 290525	9, 570, 000. 00	8, 488, 503. 87	
0. 5 O. A. T 400525	4, 390, 000. 00	2, 869, 483. 99	
0. 5 O. A. T 440625	2, 730, 000. 00	1, 625, 239. 98	
0. 5 O. A. T 720525	1, 500, 000. 00	588, 295. 50	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	3, 580, 000. 00	3, 023, 256. 30	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	2, 490, 000. 00	2, 007, 614. 79	
0. 55 IRISH GOVT 410422	1, 000, 000. 00	650, 953. 00	

0. 6 ITALY GOVT 310801	3, 100, 000. 00	2, 388, 005. 02	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	3, 680, 000. 00	3, 173, 996. 32	
0. 65 BEL GOVT 710622	910, 000. 00	376, 858. 30	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	680, 000. 00	306, 724. 20	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	3, 800, 000. 00	3, 073, 033. 40	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	2, 480, 000. 00	2, 336, 477. 44	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	1, 690, 000. 00	1, 553, 375. 33	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	1, 180, 000. 00	676, 321. 72	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	1, 050, 000. 00	902, 344. 80	
0. 75 NETH GOVT 270715	2, 670, 000. 00	2, 497, 021. 38	
0. 75 NETH GOVT 280715	3, 020, 000. 00	2, 780, 287. 50	
0. 75 O. A. T 280225	7, 400, 000. 00	6, 812, 706. 40	
0. 75 O. A. T 280525	8, 850, 000. 00	8, 115, 450. 00	
0. 75 O. A. T 281125	8, 360, 000. 00	7, 600, 661. 20	
0. 75 O. A. T 520525	4, 710, 000. 00	2, 546, 777. 07	
0. 75 O. A. T 530525	5, 540, 000. 00	2, 915, 668. 76	
0. 8 BEL GOVT 250622	2, 970, 000. 00	2, 861, 342. 55	
0. 8 BEL GOVT 270622	2, 880, 000. 00	2, 686, 936. 32	
0. 8 BEL GOVT 280622	2, 250, 000. 00	2, 067, 693. 75	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	4, 850, 000. 00	4, 460, 375. 25	
0. 8 SPAIN GOVT 290730	2, 530, 000. 00	2, 218, 270. 09	
0. 85 AUSTRIA GOVT 200630	650, 000. 00	275, 925. 65	
0. 85 ITALY GOVT 270115	3, 060, 000. 00	2, 798, 663. 76	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	1, 850, 000. 00	1, 284, 445. 75	
0. 875 FINNISH GOV 250915	630, 000. 00	606, 566. 52	
0. 9 AUSTRIA GOVT 320220	2, 120, 000. 00	1, 805, 930. 48	
0. 9 BEL GOVT 290622	3, 090, 000. 00	2, 804, 307. 87	
0. 9 IRISH GOVT 280515	1, 640, 000. 00	1, 521, 165. 60	
0. 9 ITALY GOVT 310401	2, 830, 000. 00	2, 263, 071. 76	
0. 95 ITALY GOVT 270915	4, 000, 000. 00	3, 606, 595. 60	
0. 95 ITALY GOVT 300801	2, 500, 000. 00	2, 052, 502. 50	
0. 95 ITALY GOVT 311201	2, 730, 000. 00	2, 143, 191. 96	
0. 95 ITALY GOVT 320601	2, 600, 000. 00	2, 008, 141. 20	
0. 95 ITALY GOVT 370301	2, 560, 000. 00	1, 683, 576. 32	
1 BEL GOVT 260622	2, 760, 000. 00	2, 634, 337. 20	
1 BEL GOVT 310622	2, 850, 000. 00	2, 494, 382. 70	



1 BUND 240815	3,600,000.00	3,523,608.00	
1 BUND 250815	5,580,000.00	5,403,002.40	
1 BUND 380515	2,260,000.00	1,860,827.50	
1 IRISH GOVT 260515	1,850,000.00	1,771,124.50	
1 O. A. T 251125	6,580,000.00	6,327,064.80	
1 O. A. T 270525	6,260,000.00	5,899,017.10	
1 SPAIN GOVT 420730	1,350,000.00	843,993.00	
1 SPAIN GOVT 501031	3,100,000.00	1,627,903.00	
1. 1 IRISH GOVT 290515	1,610,000.00	1,488,358.06	
1. 1 ITALY GOVT 270401	3,300,000.00	3,028,713.60	
1. 125 FINNISH GOV 340415	730,000.00	608,943.37	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	2,710,000.00	2,623,771.86	
1. 2 ITALY GOVT 250815	2,100,000.00	2,007,495.00	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	2,730,000.00	1,846,675.74	
1. 25 BEL GOVT 330422	1,770,000.00	1,530,809.28	
1. 25 BUND 480815	5,740,000.00	4,558,478.40	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2,680,000.00	2,495,851.84	
1. 25 O. A. T 340525	6,390,000.00	5,413,556.88	
1. 25 O. A. T 360525	7,070,000.00	5,745,647.60	
1. 25 O. A. T 380525	2,000,000.00	1,558,840.00	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	3,230,000.00	2,844,042.61	
1. 3 IRISH GOVT 330515	860,000.00	753,041.80	
1. 3 OBL 271015	4,050,000.00	3,901,737.60	
1. 3 OBL 271015	2,500,000.00	2,415,575.00	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	3,650,000.00	3,472,339.90	
1. 35 IRISH GOVT 310318	1,070,000.00	978,767.52	
1. 35 ITALY GOVT 300401	3,610,000.00	3,085,026.58	
1. 375 FINNISH GOV 270415	800,000.00	766,830.40	
1. 375 FINNISH GOV 470415	840,000.00	615,472.51	
1. 4 BEL GOVT 530622	2,120,000.00	1,338,830.12	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	3,740,000.00	3,487,597.42	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	4,240,000.00	3,935,975.04	
1. 45 BEL GOVT 370622	1,220,000.00	986,374.88	
1. 45 ITALY GOVT 241115	2,400,000.00	2,337,806.40	
1. 45 ITALY GOVT 250515	2,300,000.00	2,222,996.00	
1. 45 ITALY GOVT 360301	2,140,000.00	1,547,117.28	

1. 45 SPAIN GOVT 271031	3, 330, 000. 00	3, 135, 478. 05	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	3, 300, 000. 00	3, 036, 270. 60	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	950, 000. 00	450, 930. 80	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1, 430, 000. 00	1, 052, 544. 35	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	460, 000. 00	275, 879. 48	
1. 5 BUND 240515	2, 460, 000. 00	2, 428, 111. 02	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	750, 000. 00	670, 341. 75	
1. 5 IRISH GOVT 500515	1, 160, 000. 00	809, 436. 40	
1. 5 ITALY GOVT 250601	3, 300, 000. 00	3, 188, 499. 60	
1. 5 ITALY GOVT 450430	2, 010, 000. 00	1, 196, 287. 68	
1. 5 O. A. T 310525	8, 560, 000. 00	7, 883, 126. 56	
1. 5 O. A. T 500525	5, 230, 000. 00	3, 618, 448. 72	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	3, 290, 000. 00	3, 128, 296. 50	
1. 6 BEL GOVT 470622	1, 570, 000. 00	1, 122, 193. 61	
1. 6 ITALY GOVT 260601	2, 620, 000. 00	2, 490, 629. 64	
1. 6 SPAIN GOVT 250430	3, 510, 000. 00	3, 429, 305. 10	
1. 65 AUSTRIA GOVT 241021	2, 510, 000. 00	2, 472, 412. 75	
1. 65 ITALY GOVT 301201	3, 870, 000. 00	3, 315, 769. 56	
1. 65 ITALY GOVT 320301	4, 450, 000. 00	3, 698, 337. 15	
1. 7 BEL GOVT 500622	1, 540, 000. 00	1, 092, 145. 67	
1. 7 BUND 320815	3, 750, 000. 00	3, 601, 170. 60	
1. 7 IRISH GOVT 370515	1, 190, 000. 00	1, 015, 962. 50	
1. 7 ITALY GOVT 510901	2, 390, 000. 00	1, 366, 855. 69	
1. 75 ITALY GOVT 240530	2, 500, 000. 00	2, 458, 018. 75	
1. 75 ITALY GOVT 240701	3, 000, 000. 00	2, 947, 135. 50	
1. 75 O. A. T 241125	6, 520, 000. 00	6, 420, 439. 60	
1. 75 O. A. T 390625	4, 550, 000. 00	3, 790, 514. 00	
1. 75 O. A. T 660525	2, 590, 000. 00	1, 762, 145. 92	
1. 8 BUND 530815	1, 850, 000. 00	1, 609, 868. 15	
1. 8 ITALY GOVT 410301	2, 240, 000. 00	1, 522, 707. 20	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	870, 000. 00	676, 969. 62	
1. 85 ITALY GOVT 240515	1, 870, 000. 00	1, 843, 107. 53	
1. 85 ITALY GOVT 250701	2, 400, 000. 00	2, 335, 848. 00	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	4, 200, 000. 00	3, 532, 893. 00	
1. 9 BEL GOVT 380622	1, 360, 000. 00	1, 150, 957. 12	
1. 9 SPAIN GOVT 521031	1, 700, 000. 00	1, 104, 031. 00	

1. 95 SPAIN GOVT 260430	3, 520, 000. 00	3, 435, 942. 40	
1. 95 SPAIN GOVT 300730	3, 790, 000. 00	3, 525, 344. 30	
2 AUSTRIA GOVT 260715	1, 000, 000. 00	984, 275. 00	
2 IRISH GOVT 450218	1, 640, 000. 00	1, 338, 518. 80	
2 ITALY GOVT 251201	3, 530, 000. 00	3, 422, 223. 62	
2 ITALY GOVT 280201	4, 580, 000. 00	4, 291, 093. 60	
2 NETH GOVT 240715	2, 900, 000. 00	2, 875, 640. 00	
2 NETH GOVT 540115	960, 000. 00	825, 845. 76	
2 O. A. T 321125	6, 650, 000. 00	6, 242, 587. 75	
2 O. A. T 480525	4, 650, 000. 00	3, 680, 893. 50	
2. 05 ITALY GOVT 270801	3, 650, 000. 00	3, 458, 254. 55	
2. 1 AUSTRIA GOVT 170920	810, 000. 00	595, 908. 09	
2. 1 BUND 291115	3, 800, 000. 00	3, 786, 329. 50	
2. 1 ITALY GOVT 260715	2, 350, 000. 00	2, 264, 507. 00	
2. 15 BEL GOVT 660622	1, 090, 000. 00	813, 336. 20	
2. 15 ITALY GOVT 520901	2, 150, 000. 00	1, 346, 467. 60	
2. 15 ITALY GOVT 720301	850, 000. 00	476, 955. 40	
2. 2 ITALY GOVT 270601	2, 000, 000. 00	1, 911, 668. 00	
2. 2 OBL 280413	2, 250, 000. 00	2, 253, 453. 75	
2. 25 BEL GOVT 570622	1, 020, 000. 00	798, 144. 90	
2. 25 ITALY GOVT 360901	2, 720, 000. 00	2, 156, 870. 24	
2. 25 O. A. T 240525	6, 190, 000. 00	6, 141, 625. 15	
2. 3 BUND 330215	3, 450, 000. 00	3, 472, 975. 96	
2. 35 SPAIN GOVT 330730	3, 110, 000. 00	2, 857, 107. 24	
2. 4 AUSTRIA GOVT 340523	1, 300, 000. 00	1, 236, 006. 20	
2. 4 IRISH GOVT 300515	2, 090, 000. 00	2, 078, 484. 10	
2. 45 ITALY GOVT 330901	2, 870, 000. 00	2, 468, 286. 10	
2. 45 ITALY GOVT 500901	2, 490, 000. 00	1, 704, 632. 83	
2. 5 BUND 440704	4, 730, 000. 00	4, 803, 707. 59	
2. 5 BUND 460815	4, 600, 000. 00	4, 706, 779. 80	
2. 5 ITALY GOVT 241201	3, 360, 000. 00	3, 322, 988. 92	
2. 5 ITALY GOVT 251115	2, 330, 000. 00	2, 289, 593. 14	
2. 5 ITALY GOVT 321201	2, 850, 000. 00	2, 507, 675. 10	
2. 5 NETH GOVT 330115	2, 250, 000. 00	2, 241, 607. 50	
2. 5 NETH GOVT 330715	650, 000. 00	647, 562. 50	
2. 5 O. A. T 260924	1, 800, 000. 00	1, 794, 286. 80	

2.5 O. A. T 300525	9,590,000.00	9,548,686.28	
2.5 O. A. T 430525	1,330,000.00	1,188,993.40	
2.5 SCHATS 250313	1,000,000.00	998,575.00	
2.55 SPAIN GOVT 321031	4,190,000.00	3,955,397.71	
2.6 BEL GOVT 240622	2,180,000.00	2,171,181.90	
2.625 FINNISH GOV 420704	940,000.00	884,114.08	
2.65 ITALY GOVT 271201	2,800,000.00	2,707,104.40	
2.7 ITALY GOVT 470301	2,630,000.00	1,966,837.61	
2.7 SPAIN GOVT 481031	2,610,000.00	2,126,607.12	
2.75 BEL GOVT 390422	950,000.00	893,000.00	
2.75 FINNISH GOVT 280704	1,110,000.00	1,121,566.20	
2.75 FINNISH GOVT 380415	680,000.00	652,751.08	
2.75 NETH GOVT 470115	3,270,000.00	3,319,236.39	
2.75 O. A. T 271025	8,490,000.00	8,572,115.28	
2.75 O. A. T 290225	1,500,000.00	1,513,365.00	
2.75 SPAIN GOVT 241031	5,400,000.00	5,386,964.40	
2.8 ITALY GOVT 281201	4,680,000.00	4,500,311.40	
2.8 ITALY GOVT 290615	3,200,000.00	3,046,064.00	
2.8 ITALY GOVT 670301	1,620,000.00	1,104,516.00	
2.8 SPAIN GOVT 260531	1,500,000.00	1,496,623.50	
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	700,000.00	709,065.00	
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	1,000,000.00	1,000,579.00	
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,990,000.00	2,576,363.40	
2.95 ITALY GOVT 380901	2,380,000.00	2,000,357.87	
3 BEL GOVT 330622	1,300,000.00	1,308,312.59	
3 BEL GOVT 340622	1,230,000.00	1,231,190.64	
3 IRISH GOVT 431018	450,000.00	440,677.10	
3 ITALY GOVT 290801	3,400,000.00	3,275,410.40	
3 O. A. T 330525	1,000,000.00	1,017,356.00	
3 O. A. T 540525	700,000.00	656,805.10	
3.1 ITALY GOVT 400301	1,890,000.00	1,590,673.14	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	1,250,000.00	1,258,793.75	
3.15 SPAIN GOVT 330430	3,000,000.00	2,960,862.80	
3.25 BUND 420704	2,880,000.00	3,238,125.12	
3.25 ITALY GOVT 380301	1,340,000.00	1,171,445.92	
3.25 ITALY GOVT 460901	2,740,000.00	2,263,782.52	

3. 25 O. A. T 450525	4, 710, 000. 00	4, 733, 469. 93	
3. 3 BEL GOVT 540622	800, 000. 00	778, 046. 40	
3. 35 ITALY GOVT 350301	3, 110, 000. 00	2, 842, 664. 40	
3. 4 ITALY GOVT 250328	2, 300, 000. 00	2, 303, 277. 50	
3. 4 ITALY GOVT 280401	1, 500, 000. 00	1, 491, 733. 11	
3. 45 ITALY GOVT 480301	2, 820, 000. 00	2, 388, 060. 60	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	1, 820, 000. 00	1, 718, 454. 92	
3. 45 SPAIN GOVT 660730	2, 230, 000. 00	2, 001, 144. 38	
3. 5 ITALY GOVT 260115	2, 500, 000. 00	2, 511, 495. 00	
3. 5 ITALY GOVT 300301	3, 670, 000. 00	3, 621, 556. 00	
3. 5 O. A. T 260425	6, 690, 000. 00	6, 867, 251. 55	
3. 75 BEL GOVT 450622	1, 620, 000. 00	1, 727, 370. 36	
3. 75 ITALY GOVT 240901	4, 230, 000. 00	4, 255, 248. 87	
3. 75 NETH GOVT 420115	2, 690, 000. 00	3, 078, 933. 65	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	700, 000. 00	811, 041. 35	
3. 8 ITALY GOVT 260415	1, 500, 000. 00	1, 518, 183. 30	
3. 85 ITALY GOVT 291215	2, 600, 000. 00	2, 613, 668. 20	
3. 85 ITALY GOVT 490901	1, 950, 000. 00	1, 750, 429. 20	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	1, 050, 000. 00	1, 071, 651. 31	
4 BEL GOVT 320328	1, 250, 000. 00	1, 364, 292. 50	
4 BUND 370104	4, 040, 000. 00	4, 798, 404. 96	
4 FINNISH GOVT 250704	240, 000. 00	247, 099. 20	
4 ITALY GOVT 311030	2, 400, 000. 00	2, 415, 423. 36	
4 ITALY GOVT 350430	1, 150, 000. 00	1, 119, 545. 52	
4 ITALY GOVT 370201	4, 300, 000. 00	4, 152, 295. 00	
4 NETH GOVT 370115	3, 100, 000. 00	3, 546, 148. 90	
4 O. A. T 381025	4, 020, 000. 00	4, 455, 148. 92	
4 O. A. T 550425	3, 090, 000. 00	3, 521, 397. 99	
4 O. A. T 600425	2, 740, 000. 00	3, 158, 789. 82	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	2, 190, 000. 00	2, 454, 746. 91	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	3, 460, 000. 00	3, 696, 871. 60	
4. 25 BEL GOVT 410328	2, 780, 000. 00	3, 142, 517. 56	
4. 25 BUND 390704	2, 710, 000. 00	3, 366, 118. 10	
4. 4 ITALY GOVT 330501	2, 900, 000. 00	2, 975, 530. 50	
4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 200, 000. 00	1, 182, 958. 80	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 610, 000. 00	1, 695, 272. 04	

4. 5 ITALY GOVT 260301	3, 740, 000. 00	3, 858, 808. 58	
4. 5 ITALY GOVT 531001	700, 000. 00	688, 184. 00	
4. 5 O. A. T 410425	5, 580, 000. 00	6, 593, 143. 86	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	2, 890, 000. 00	3, 001, 952. 82	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	3, 200, 000. 00	3, 593, 107. 20	
4. 75 BUND 280704	2, 340, 000. 00	2, 636, 246. 34	
4. 75 BUND 340704	3, 550, 000. 00	4, 411, 620. 50	
4. 75 BUND 400704	3, 430, 000. 00	4, 539, 687. 32	
4. 75 ITALY GOVT 280901	3, 930, 000. 00	4, 156, 368. 00	
4. 75 ITALY GOVT 440901	2, 650, 000. 00	2, 726, 081. 50	
4. 75 O. A. T 350425	4, 800, 000. 00	5, 669, 424. 00	
4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1, 370, 000. 00	1, 457, 221. 05	
4. 9 SPAIN GOVT 400730	2, 930, 000. 00	3, 367, 771. 30	
5 BEL GOVT 350328	2, 950, 000. 00	3, 513, 780. 40	
5 ITALY GOVT 250301	4, 280, 000. 00	4, 409, 333. 04	
5 ITALY GOVT 340801	3, 850, 000. 00	4, 108, 057. 80	
5 ITALY GOVT 390801	3, 980, 000. 00	4, 230, 978. 80	
5 ITALY GOVT 400901	3, 600, 000. 00	3, 828, 636. 00	
5. 15 SPAIN GOVT 281031	2, 500, 000. 00	2, 774, 877. 50	
5. 15 SPAIN GOVT 441031	2, 390, 000. 00	2, 851, 693. 03	
5. 25 ITALY GOVT 291101	4, 110, 000. 00	4, 486, 718. 49	
5. 4 IRISH GOVT 250313	2, 100, 000. 00	2, 203, 400. 22	
5. 5 BEL GOVT 280328	2, 380, 000. 00	2, 703, 399. 16	
5. 5 BUND 310104	4, 280, 000. 00	5, 279, 790. 88	
5. 5 NETH GOVT 280115	1, 480, 000. 00	1, 677, 625. 14	
5. 5 O. A. T 290425	5, 820, 000. 00	6, 747, 801. 12	
5. 625 BUND 280104	2, 540, 000. 00	2, 926, 320. 53	
5. 75 ITALY GOVT 330201	3, 820, 000. 00	4, 326, 363. 92	
5. 75 O. A. T 321025	5, 090, 000. 00	6, 356, 997. 71	
5. 75 SPAIN GOVT 320730	3, 480, 000. 00	4, 188, 354. 00	
5. 9 SPAIN GOVT 260730	4, 650, 000. 00	5, 080, 566. 75	
6 ITALY GOVT 310501	5, 230, 000. 00	5, 998, 271. 31	
6 O. A. T 251025	8, 760, 000. 00	9, 451, 803. 48	
6 SPAIN GOVT 290131	4, 230, 000. 00	4, 905, 750. 53	
6. 25 AUSTRIA GOVT 270715	1, 630, 000. 00	1, 860, 627. 07	
6. 25 BUND 300104	1, 700, 000. 00	2, 130, 251. 30	

	6.5 BUND 270704	1,750,000.00	2,045,286.25	
	6.5 ITALY GOVT 271101	3,900,000.00	4,398,841.20	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,592,983.20	
ユーロ合計		1,068,350,000.00	987,259,146.52 (145,087,604,172)	
	合計		432,163,832,554 (432,163,832,554)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 263 銘柄	100.00%	49.40%
カナダドル	国債証券 35 銘柄	100.00%	2.03%
オーストラリアドル	国債証券 26 銘柄	100.00%	1.56%
イギリスポンド	国債証券 55 銘柄	100.00%	4.80%
シンガポールドル	国債証券 19 銘柄	100.00%	0.44%
マレーシアリングgit	国債証券 31 銘柄	100.00%	0.56%
ニュージーランドドル	国債証券 9 銘柄	100.00%	0.23%
スウェーデンクローネ	国債証券 8 銘柄	100.00%	0.19%
ノルウェークローネ	国債証券 9 銘柄	100.00%	0.15%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.31%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.00%	0.91%
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%	0.46%
中国元	国債証券 66 銘柄	100.00%	5.13%
ユーロ	国債証券 363 銘柄	100.00%	33.57%

#### 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5月12日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	46,483,635,983
コール・ローン	20,364,592,132
株式	2,249,091,987,527
投資証券	48,867,325,173
派生商品評価勘定	587,422,110
未収入金	175,555,719
未収配当金	2,755,697,387
差入委託証拠金	73,222,113,813
流動資産合計	2,441,548,329,844
資産合計	2,441,548,329,844
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	311,758,190
未払金	1,328,805
未払解約金	19,422,632,738
未払利息	24,102
流動負債合計	19,735,743,835
負債合計	19,735,743,835
純資産の部	
元本等	
元本	492,758,095,240
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	1,929,054,490,769
元本等合計	2,421,812,586,009
純資産合計	2,421,812,586,009
負債純資産合計	2,441,548,329,844

## 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5月12日現在]
1. 期首	2022年5月13日
期首元本額	334,911,394,157円



期中追加設定元本額	247,251,627,495 円
期中一部解約元本額	89,404,926,412 円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	218,397,991 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	999,665,489 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	895,931,397 円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,980,601,053 円
MAXIS 全世界株式(オール・カンントリー)上場投信	3,901,946,703 円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,697,561,051 円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	9,814,679,436 円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,497,147,878 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	51,885,227 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	137,577,464 円
ファンド・マネジャー(海外株式)	780,627 円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,662,649,624 円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,126,674,853 円
eMAXIS バランス(波乗り型)	172,506,731 円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,796,011,054 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	223,842,663 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	268,047,202 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	248,086,702 円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	89,113,035,897 円
海外株式セレクション(ラップ向け)	2,361,507,125 円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	4,841,487,973 円
つみたて先進国株式	24,184,571,604 円
つみたて8資産均等バランス	2,315,584,775 円
つみたて4資産均等バランス	787,262,571 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,935,664 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,376,145 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,143,376 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	189,672,403 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	206,287,708 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	134,601,105 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	59,132,908 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	473,792,535 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,136,724,885 円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	43,345,196,651 円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	492,396,109 円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国株式)	3,568,835,757 円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カンントリー)	177,707,926,804 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	117,325,554 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	44,598,918 円
つみたて全世界株式	220,608,674 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065(確定拠出年金)	45,879,733 円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,276,819,729 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式80)	17,948,229 円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	2,597,412,835 円

ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	23,308,533円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	29,568,651,569円
eMAXIS 全世界株式インデックス	4,654,957,864円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	346,325,778円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	648,174,766円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	96,611,928円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	348,262,060円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	238,927,425円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	327,708,850円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	91,023,197円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	112,954,199円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	464,935,803円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	369,214,159円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	694,052,261円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,560,992,448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)	14,341円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	6,158,365円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,950,405,868円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	47,293,452円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	779,145,400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)	10,537,379,053円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	382,651円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	620,852,708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)	5,322,492,482円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	9,208,601円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	61,931,786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)	984,889,283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)	311,099,541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)	358,921,183円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	54,840,058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)	1,376,509,034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)	86,635,739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)	2,458,563,341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)	361,569,301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)	4,827,568,805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)	26,483,922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)	120,694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)	2,574,768,678円
海外株式インデックスファンドS	2,790,959,557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)	206,404円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,707,936,668円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	807,958円

インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	2,137,140円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	641,375円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	2,056,896円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	24,893,550円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	881,211円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	9,512,789円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,425,444円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	14,547,633円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,597,247,971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）	97,910,897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）	404,629,809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）	433,412,957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）	422,493,043円
合計	492,758,095,240円
2. 受益権の総数	492,758,095,240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 5 月 13 日 至 2023 年 5 月 12 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和 26 年法律第 198 号）第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2023 年 5 月 12 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。
	(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2023年5月12日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		127,545,349,780
投資証券		△4,729,668,513
合計		122,815,681,267

(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5月12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	124,103,348,823	—	124,376,689,659	273,340,836
合計		124,103,348,823	—	124,376,689,659	273,340,836

(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5月12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	1,940,604,372	—	1,943,412,084	2,807,712
	カナダドル	80,375,313	—	80,096,088	△279,225
	イギリスポンド	125,879,586	—	125,476,476	△403,110
	スイスフラン	52,996,064	—	52,995,078	△986

	ユーロ	181,725,196	—	181,720,866	△4,330
	売建				
	スイスフラン	47,969,664	—	47,878,270	91,394
	ユーロ	33,609,024	—	33,497,395	111,629
	合計	2,463,159,219	—	2,465,076,257	2,323,084

(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5月12日現在]
1口当たり純資産額	4.9148円
(1万口当たり純資産額)	(49,148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	33.08	3,826,992.12	
	BAKER HUGHES CO	344,454	27.36	9,424,261.44	
	CHENIERE ENERGY INC	75,920	147.00	11,160,240.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	37,475	77.26	2,895,318.50	
	CHEVRON CORP	620,871	156.22	96,992,467.62	
	CONOCOPHILLIPS	420,421	99.89	41,995,853.69	
	COTERRA ENERGY INC	274,210	24.36	6,679,755.60	
	DEVON ENERGY CORP	212,671	47.26	10,050,831.46	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	56,570	127.66	7,221,726.20	
	EOG RESOURCES INC	198,059	110.53	21,891,461.27	
	EQT CORP	116,920	31.90	3,729,748.00	

EXXON MOBIL CORP	1, 391, 956	105. 79	147, 255, 025. 24
HALLIBURTON CO	297, 827	28. 49	8, 485, 091. 23
HESS CORP	93, 997	132. 53	12, 457, 422. 41
HF SINCLAIR CORP	47, 286	40. 11	1, 896, 641. 46
KINDER MORGAN INC	689, 362	16. 70	11, 512, 345. 40
MARATHON OIL CORP	217, 347	22. 47	4, 883, 787. 09
MARATHON PETROLEUM CORP	157, 708	110. 10	17, 363, 650. 80
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	245, 589	57. 93	14, 226, 970. 77
ONEOK INC	152, 897	62. 83	9, 606, 518. 51
OVINTIV INC	82, 940	33. 26	2, 758, 584. 40
PHILLIPS 66	159, 332	93. 40	14, 881, 608. 80
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	76, 136	207. 20	15, 775, 379. 20
SCHLUMBERGER LTD	480, 055	44. 14	21, 189, 627. 70
TARGA RESOURCES CORP	76, 008	69. 69	5, 296, 997. 52
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2, 158	1, 364. 27	2, 944, 094. 66
VALERO ENERGY CORP	129, 929	110. 66	14, 377, 943. 14
WILLIAMS COS INC	412, 041	29. 00	11, 949, 189. 00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	74, 978	276. 55	20, 735, 165. 90
ALBEMARLE CORP	40, 222	198. 52	7, 984, 871. 44
ALCOA CORP	65, 943	35. 33	2, 329, 766. 19
AMCOR PLC	523, 563	10. 36	5, 424, 112. 68
AVERY DENNISON CORP	27, 835	172. 31	4, 796, 248. 85
BALL CORP	110, 807	57. 09	6, 325, 971. 63
CELANESE CORP	35, 523	101. 23	3, 595, 993. 29
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	69, 306	67. 18	4, 655, 977. 08
CLEVELAND-CLIFFS INC	171, 019	14. 61	2, 498, 587. 59
CORTEVA INC	241, 362	56. 83	13, 716, 602. 46
CROWN HOLDINGS INC	43, 629	83. 41	3, 639, 094. 89
DOW INC	237, 897	52. 34	12, 451, 528. 98
DUPONT DE NEMOURS INC	168, 154	63. 86	10, 738, 314. 44
EASTMAN CHEMICAL CO	40, 284	78. 81	3, 174, 782. 04
ECOLAB INC	86, 699	174. 22	15, 104, 699. 78
FMC CORP	43, 553	109. 50	4, 769, 053. 50
FREEMPORT-MCMORAN INC	484, 137	34. 54	16, 722, 091. 98
INTERNATIONAL PAPER CO	111, 608	31. 69	3, 536, 857. 52
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	83, 518	85. 36	7, 129, 096. 48

LINDE PLC	166,930	367.04	61,269,987.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	89,921	88.77	7,982,287.17
MARTIN MARIETTA MATERIALS	21,677	400.57	8,683,155.89
MOSAIC CO/THE	113,000	35.95	4,062,350.00
NEWMONT CORP	269,695	45.88	12,373,606.60
NUCOR CORP	87,035	137.51	11,968,182.85
PACKAGING CORP OF AMERICA	30,858	132.34	4,083,747.72
PPG INDUSTRIES INC	80,081	137.24	10,990,316.44
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	19,300	239.39	4,620,227.00
RPM INTERNATIONAL INC	45,708	80.61	3,684,521.88
SEALED AIR CORP	49,467	42.19	2,087,012.73
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	83,266	230.18	19,166,167.88
STEEL DYNAMICS INC	60,708	96.99	5,888,068.92
VULCAN MATERIALS CO	46,218	194.83	9,004,652.94
WESTLAKE CORP	13,051	113.40	1,479,983.40
WESTROCK CO	81,719	27.62	2,257,078.78
3M CO	186,921	100.78	18,837,898.38
AECOM	43,500	77.88	3,387,780.00
AERCAP HOLDINGS NV	56,854	55.94	3,180,412.76
ALLEGION PLC	31,093	108.87	3,385,094.91
AMETEK INC	78,150	143.76	11,234,844.00
AXON ENTERPRISE INC	22,200	204.59	4,542,009.00
BOEING CO/THE	191,511	201.84	38,654,580.24
CARLISLE COS INC	16,689	207.64	3,465,303.96
CARRIER GLOBAL CORP	282,934	42.83	12,118,063.22
CATERPILLAR INC	176,014	210.03	36,968,220.42
CUMMINS INC	48,113	216.95	10,438,115.35
DEERE & CO	96,972	372.79	36,150,191.88
DOVER CORP	49,146	139.31	6,846,529.26
EATON CORP PLC	134,160	168.52	22,608,643.20
EMERSON ELECTRIC CO	199,931	81.98	16,390,343.38
FASTENAL CO	196,429	54.87	10,778,059.23
FERGUSON PLC	71,420	145.23	10,372,326.60
FORTIVE CORP	113,654	64.14	7,289,767.56
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	47,372	65.40	3,098,128.80
GENERAC HOLDINGS INC	21,013	111.96	2,352,615.48

GENERAL DYNAMICS CORP	78,819	208.05	16,398,292.95
GENERAL ELECTRIC CO	369,361	99.51	36,755,113.11
GRACO INC	56,100	77.45	4,344,945.00
HEICO CORP	15,479	168.34	2,605,734.86
HEICO CORP-CLASS A	22,744	133.49	3,036,096.56
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	227,216	193.98	44,075,359.68
HOWMET AEROSPACE INC	121,799	43.96	5,354,284.04
HUBBELL INC	17,543	272.75	4,784,853.25
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	13,307	196.76	2,618,285.32
IDEX CORP	24,460	207.95	5,086,457.00
ILLINOIS TOOL WORKS	103,686	227.90	23,630,039.40
INGERSOLL-RAND INC	137,295	57.95	7,956,245.25
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	52,400	50.60	2,651,440.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	232,371	62.06	14,420,944.26
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	64,716	186.87	12,093,478.92
LENNOX INTERNATIONAL INC	11,485	289.42	3,323,988.70
LOCKHEED MARTIN CORP	79,768	450.69	35,950,639.92
MASCO CORP	73,970	52.58	3,889,342.60
NORDSON CORP	16,618	216.24	3,593,476.32
NORTHROP GRUMMAN CORP	49,471	435.85	21,561,935.35
OTIS WORLDWIDE CORP	141,318	84.54	11,947,023.72
OWENS CORNING	29,948	105.02	3,145,138.96
PACCAR INC	176,802	72.44	12,807,536.88
PARKER HANNIFIN CORP	43,399	324.59	14,086,881.41
PENTAIR PLC	53,508	58.65	3,138,244.20
PLUG POWER INC	170,755	7.65	1,306,275.75
QUANTA SERVICES INC	48,871	171.59	8,385,774.89
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	497,093	95.54	47,492,265.22
ROCKWELL AUTOMATION INC	39,232	270.49	10,611,863.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	47,364	40.21	1,904,506.44
SMITH (A. O.) CORP	41,076	68.40	2,809,598.40
SNAP-ON INC	18,428	256.03	4,718,120.84
STANLEY BLACK & DECKER INC	49,255	80.45	3,962,564.75
TEXTRON INC	68,142	64.43	4,390,389.06
TORO CO	34,600	105.02	3,633,692.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	77,894	176.84	13,774,774.96



TRANSDIGM GROUP INC	17,484	796.88	13,932,649.92
UNITED RENTALS INC	23,430	334.08	7,827,494.40
WABTEC CORP	56,644	98.08	5,555,643.52
WW GRAINGER INC	15,533	684.37	10,630,319.21
XYLEM INC	59,030	105.12	6,205,233.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	140,090	209.81	29,392,282.90
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	46,380	92.13	4,272,989.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	38,932	154.70	6,022,780.40
CERIDIAN HCM HOLDING INC	46,280	57.54	2,662,951.20
CINTAS CORP	30,817	474.23	14,614,345.91
CLARIVATE PLC	115,796	8.01	927,525.96
COPART INC	144,068	80.58	11,608,999.44
COSTAR GROUP INC	139,906	74.97	10,488,752.82
EQUIFAX INC	41,823	203.67	8,518,090.41
JACOBS SOLUTIONS INC	40,785	116.23	4,740,440.55
LEIDOS HOLDINGS INC	42,946	78.27	3,361,383.42
PAYCHEX INC	109,756	106.61	11,701,087.16
PAYCOM SOFTWARE INC	16,897	265.31	4,482,943.07
PAYLOCITY HOLDING CORP	13,942	165.20	2,303,218.40
REPUBLIC SERVICES INC	75,957	148.12	11,250,750.84
ROBERT HALF INTL INC	38,389	67.15	2,577,821.35
ROLLINS INC	79,141	42.40	3,355,578.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	80,381	55.03	4,423,366.43
TRANSUNION	63,235	66.62	4,212,715.70
VERISK ANALYTICS INC	53,789	215.33	11,582,385.37
WASTE CONNECTIONS INC	87,590	143.59	12,577,048.10
WASTE MANAGEMENT INC	138,156	170.19	23,512,769.64
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	40,475	99.30	4,019,167.50
CSX CORP	711,513	31.79	22,618,998.27
DELTA AIR LINES INC	53,589	33.22	1,780,226.58
EXPEDITORS INTL WASH INC	51,822	112.37	5,823,238.14
FEDEX CORP	83,662	224.84	18,810,564.08
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	367,326	3.21	1,179,116.46
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	28,551	176.34	5,034,683.34
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	49,106	57.13	2,805,425.78
NORFOLK SOUTHERN CORP	78,408	210.31	16,489,986.48

OLD DOMINION FREIGHT LINE	32,010	310.42	9,936,544.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	50,383	28.97	1,459,595.51
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	27,432	54.81	1,503,547.92
UBER TECHNOLOGIES INC	506,142	38.42	19,445,975.64
UNION PACIFIC CORP	207,983	198.08	41,197,272.64
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	246,834	170.23	42,018,551.82
APTIV PLC	93,079	94.29	8,776,418.91
BORGWARNER INC	78,768	44.64	3,516,203.52
FORD MOTOR CO	1,334,620	11.87	15,841,939.40
GENERAL MOTORS CO	479,660	33.12	15,886,339.20
LEAR CORP	20,206	125.57	2,537,267.42
LUCID GROUP INC	173,075	7.06	1,221,909.50
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	108,400	13.84	1,500,256.00
TESLA INC	907,917	172.08	156,234,357.36
DR HORTON INC	110,353	109.15	12,045,029.95
GARMIN LTD	53,987	103.56	5,590,893.72
HASBRO INC	42,578	60.02	2,555,531.56
LENNAR CORP-A	83,896	114.00	9,564,144.00
LULULEMON ATHLETICA INC	39,288	377.32	14,824,148.16
MOHAWK INDUSTRIES INC	16,546	97.76	1,617,536.96
NEWELL BRANDS INC	130,633	9.50	1,241,013.50
NIKE INC -CL B	425,922	122.22	52,056,186.84
NVR INC	1,054	5,837.83	6,153,072.82
PULTEGROUP INC	76,342	68.12	5,200,417.04
VF CORP	121,637	21.49	2,613,979.13
WHIRLPOOL CORP	20,470	132.42	2,710,637.40
AIRBNB INC-CLASS A	127,832	111.20	14,214,918.40
ARAMARK	72,988	37.20	2,715,153.60
BOOKING HOLDINGS INC	13,101	2,656.58	34,803,854.58
CAESARS ENTERTAINMENT INC	67,558	43.60	2,945,528.80
CARNIVAL CORP	322,950	10.24	3,307,008.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	9,363	2,058.50	19,273,735.50
DARDEN RESTAURANTS INC	41,711	147.01	6,131,934.11
DOMINO'S PIZZA INC	12,458	306.93	3,823,733.94
DOORDASH INC - A	77,241	67.22	5,192,140.02
EXPEDIA GROUP INC	53,423	91.22	4,873,246.06

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	92,759	141.70	13,143,950.30
LAS VEGAS SANDS CORP	118,255	61.15	7,231,293.25
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	90,559	174.49	15,801,639.91
MCDONALD'S CORP	247,399	294.79	72,930,751.21
MGM RESORTS INTERNATIONAL	104,054	42.52	4,424,376.08
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	79,355	76.35	6,058,754.25
STARBUCKS CORP	387,680	105.63	40,950,638.40
VAIL RESORTS INC	12,637	239.42	3,025,550.54
WYNN RESORTS LTD	38,455	106.90	4,110,839.50
YUM! BRANDS INC	94,846	137.34	13,026,149.64
ACTIVISION BLIZZARD INC	264,505	77.04	20,377,465.20
ALPHABET INC-CL A	2,019,252	116.57	235,384,205.64
ALPHABET INC-CL C	1,854,492	116.90	216,790,114.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	36,893	341.71	12,606,707.03
COMCAST CORP-CLASS A	1,459,233	40.37	58,909,236.21
DISH NETWORK CORP-A	84,434	6.23	526,023.82
ELECTRONIC ARTS INC	93,351	125.32	11,698,747.32
FOX CORP - CLASS A	94,197	30.67	2,889,021.99
FOX CORP - CLASS B	50,847	28.16	1,431,851.52
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	128,763	36.26	4,668,946.38
LIBERTY BROADBAND-C	43,606	78.28	3,413,477.68
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	22,942	29.02	665,776.84
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	50,965	28.86	1,470,849.90
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	65,129	71.39	4,649,559.31
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	57,466	77.76	4,468,556.16
MATCH GROUP INC	89,286	31.70	2,830,366.20
META PLATFORMS INC-CLASS A	760,728	235.79	179,372,055.12
NETFLIX INC	150,532	344.76	51,897,412.32
NEWS CORP - CLASS A	130,626	16.74	2,186,679.24
OMNICOM GROUP	69,272	91.13	6,312,757.36
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	217,553	15.37	3,343,789.61
PINTEREST INC- CLASS A	199,346	21.48	4,281,952.08
ROBLOX CORP -CLASS A	116,296	39.88	4,637,884.48
ROKU INC	38,981	56.85	2,216,069.85
SEA LTD-ADR	124,778	86.71	10,819,500.38
SIRIUS XM HOLDINGS INC	234,669	3.62	849,501.78

SNAP INC - A	350,310	8.75	3,065,212.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	54,831	125.57	6,885,128.67
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	151,975	64.53	9,806,946.75
WALT DISNEY CO/THE	616,581	92.31	56,916,592.11
WARNER BROS DISCOVERY INC	786,624	12.38	9,738,405.12
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	90,161	21.19	1,910,511.59
ADVANCE AUTO PARTS INC	19,129	124.17	2,375,247.93
AMAZON.COM INC	3,106,063	112.18	348,438,147.34
AUTOZONE INC	6,401	2,715.20	17,379,995.20
BATH & BODY WORKS INC	84,151	32.23	2,712,186.73
BEST BUY CO INC	70,326	71.62	5,036,748.12
BURLINGTON STORES INC	21,172	173.04	3,663,602.88
CARMAX INC	49,982	72.27	3,612,199.14
CHEWY INC - CLASS A	31,027	35.06	1,087,806.62
EBAY INC	183,310	45.78	8,391,931.80
ETSY INC	41,138	96.36	3,964,057.68
GENUINE PARTS CO	48,177	171.64	8,269,100.28
HOME DEPOT INC	344,628	287.69	99,146,029.32
LKQ CORP	89,808	56.64	5,086,725.12
LOWE'S COS INC	204,337	203.30	41,541,712.10
MERCADOLIBRE INC	15,305	1,296.52	19,843,238.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21,102	958.26	20,221,202.52
POOL CORP	12,964	348.04	4,511,990.56
ROSS STORES INC	118,258	102.53	12,124,992.74
TJX COMPANIES INC	392,039	78.06	30,602,564.34
TRACTOR SUPPLY COMPANY	36,289	241.82	8,775,405.98
ULTA BEAUTY INC	17,726	512.11	9,077,661.86
COSTCO WHOLESALE CORP	149,574	501.89	75,069,694.86
DOLLAR GENERAL CORP	76,158	217.29	16,548,371.82
DOLLAR TREE INC	75,692	155.21	11,748,155.32
KROGER CO	231,439	49.16	11,377,541.24
SYSCO CORP	171,181	73.66	12,609,192.46
TARGET CORP	155,507	158.87	24,705,397.09
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	255,139	31.17	7,952,682.63
WALMART INC	504,397	153.12	77,233,268.64
ALTRIA GROUP INC	606,088	45.67	27,680,038.96

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	185,783	74.90	13,915,146.70
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	105,095	64.22	6,749,200.90
BUNGE LTD	49,109	89.97	4,418,336.73
CAMPBELL SOUP CO	67,404	54.46	3,670,821.84
COCA-COLA CO/THE	1,389,234	63.86	88,716,483.24
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	66,711	65.92	4,397,589.12
CONAGRA BRANDS INC	158,908	36.50	5,800,142.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	56,240	224.87	12,646,688.80
DARLING INGREDIENTS INC	52,560	63.20	3,321,792.00
GENERAL MILLS INC	200,736	90.26	18,118,431.36
HERSHEY CO/THE	49,875	274.78	13,704,652.50
HORMEL FOODS CORP	104,570	40.29	4,213,125.30
JM SMUCKER CO/THE	37,304	157.39	5,871,276.56
KELLOGG CO	84,861	70.70	5,999,672.70
KEURIG DR PEPPER INC	268,712	32.43	8,714,330.16
KRAFT HEINZ CO/THE	252,403	40.65	10,260,181.95
LAMB WESTON HOLDINGS INC	46,449	113.06	5,251,523.94
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	85,069	89.51	7,614,526.19
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	62,806	64.00	4,019,584.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	461,515	78.36	36,164,315.40
MONSTER BEVERAGE CORP	264,475	59.28	15,678,078.00
PEPSICO INC	465,849	195.34	90,998,943.66
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	524,294	95.04	49,828,901.76
TYSON FOODS INC-CL A	99,095	49.34	4,889,347.30
CHURCH & DWIGHT CO INC	82,599	96.38	7,960,891.62
CLOROX COMPANY	40,580	169.25	6,868,165.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	268,471	81.63	21,915,287.73
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	78,250	201.79	15,790,067.50
KIMBERLY-CLARK CORP	114,207	143.68	16,409,261.76
PROCTER & GAMBLE CO/THE	801,398	154.39	123,727,837.22
ABBOTT LABORATORIES	589,190	110.05	64,840,359.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	25,443	296.08	7,533,163.44
AMERISOURCEBERGEN CORP	53,705	171.44	9,207,185.20
BAXTER INTERNATIONAL INC	174,039	43.38	7,549,811.82
BECTON DICKINSON AND CO	95,554	251.40	24,022,275.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	481,873	53.39	25,727,199.47

CARDINAL HEALTH INC	89,557	84.84	7,598,015.88
CENTENE CORP	192,134	67.37	12,944,067.58
COOPER COS INC/THE	16,931	392.09	6,638,475.79
CVS HEALTH CORP	444,660	68.97	30,668,200.20
DAVITA INC	16,659	95.59	1,592,433.81
DENTSPLY SIRONA INC	77,655	40.99	3,183,078.45
DEXCOM INC	130,490	121.07	15,798,424.30
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	208,425	88.78	18,503,971.50
ELEVANCE HEALTH INC	80,788	456.78	36,902,342.64
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	123,457	74.99	9,258,040.43
HCA HEALTHCARE INC	71,708	278.10	19,941,994.80
HENRY SCHEIN INC	47,391	76.93	3,645,789.63
HOLOGIC INC	84,542	81.85	6,919,762.70
HUMANA INC	42,832	528.99	22,657,699.68
IDEXX LABORATORIES INC	27,985	486.73	13,621,139.05
INSULET CORP	23,701	321.27	7,614,420.27
INTUITIVE SURGICAL INC	119,325	303.47	36,211,557.75
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	29,015	220.08	6,385,621.20
MASIMO CORP	16,542	172.76	2,857,795.92
MCKESSON CORP	47,903	392.05	18,780,371.15
MEDTRONIC PLC	449,278	89.02	39,994,727.56
MOLINA HEALTHCARE INC	19,200	297.40	5,710,080.00
NOVOCURE LTD	30,832	73.18	2,256,285.76
QUEST DIAGNOSTICS INC	37,107	130.88	4,856,564.16
RESMED INC	49,382	236.12	11,660,077.84
STERIS PLC	34,015	208.00	7,075,120.00
STRYKER CORP	114,866	285.12	32,750,593.92
TELEFLEX INC	15,114	249.69	3,773,814.66
THE CIGNA GROUP	103,445	260.00	26,895,700.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	316,070	488.76	154,482,373.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20,248	140.03	2,835,327.44
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	47,565	173.28	8,242,063.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	72,643	136.69	9,929,571.67
ABBVIE INC	597,920	146.59	87,649,092.80
AGILENT TECHNOLOGIES INC	99,711	127.66	12,729,106.26
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	42,810	206.09	8,822,712.90

AMGEN INC	180,305	232.29	41,883,048.45
AVANTOR INC	217,209	20.39	4,428,891.51
BIO-RAD LABORATORIES-A	8,004	364.34	2,916,177.36
BIO-TECHNE CORP	54,867	81.93	4,495,253.31
BIOGEN INC	48,738	310.56	15,136,073.28
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	63,356	95.39	6,043,528.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	718,704	69.08	49,648,072.32
CATALENT INC	56,121	34.19	1,918,776.99
CHARLES RIVER LABORATORIES	18,126	195.75	3,548,164.50
DANAHER CORP	233,803	230.81	53,964,070.43
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	148,648	8.79	1,306,615.92
ELI LILLY & CO	273,155	435.55	118,972,660.25
EXACT SCIENCES CORP	56,656	78.07	4,423,133.92
GILEAD SCIENCES INC	423,500	78.70	33,329,450.00
HORIZON THERAPEUTICS PLC	73,767	110.03	8,116,583.01
ILLUMINA INC	53,498	208.21	11,138,818.58
INCYTE CORP	66,688	64.17	4,279,368.96
IQVIA HOLDINGS INC	62,970	189.87	11,956,113.90
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	20,987	137.09	2,877,107.83
JOHNSON & JOHNSON	883,970	160.99	142,310,330.30
MERCK & CO. INC.	857,228	117.55	100,767,151.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	7,555	1,348.08	10,184,744.40
MODERNA INC	110,425	128.41	14,179,674.25
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	31,737	97.82	3,104,513.34
PERKINELMER INC	41,516	118.37	4,914,248.92
PFIZER INC	1,898,688	37.58	71,352,695.04
REGENERON PHARMACEUTICALS	36,185	745.57	26,978,450.45
REPLIGEN CORP	17,444	152.34	2,657,418.96
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	125,527	34.50	4,330,681.50
SEAGEN INC	48,071	199.50	9,590,164.50
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	360,337	8.21	2,958,366.77
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	132,615	529.79	70,258,100.85
UNITED THERAPEUTICS CORP	15,000	213.48	3,202,200.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	86,692	350.40	30,376,876.80
VIATRIS INC	431,866	9.36	4,042,265.76
WATERS CORP	19,356	268.97	5,206,183.32

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	25,323	360.10	9,118,812.30
ZOETIS INC	157,582	185.12	29,171,579.84
BANK OF AMERICA CORP	2,442,971	27.39	66,912,975.69
CITIGROUP INC	655,854	46.03	30,188,959.62
CITIZENS FINANCIAL GROUP	171,073	24.80	4,242,610.40
FIFTH THIRD BANCORP	236,722	23.66	5,600,842.52
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	3,794	1,233.89	4,681,378.66
FIRST HORIZON CORP	173,558	9.77	1,695,661.66
HUNTINGTON BANCSHARES INC	505,449	9.28	4,690,566.72
JPMORGAN CHASE & CO	992,086	136.05	134,973,300.30
KEYCORP	306,076	9.09	2,782,230.84
M & T BANK CORP	60,159	113.25	6,813,006.75
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	136,707	112.70	15,406,878.90
REGIONS FINANCIAL CORP	304,015	15.52	4,718,312.80
TRUIST FINANCIAL CORP	450,022	26.83	12,074,090.26
US BANCORP	477,461	28.92	13,808,172.12
WEBSTER FINANCIAL CORP	57,805	32.66	1,887,911.30
WELLS FARGO & CO	1,289,049	38.33	49,409,248.17
ALLY FINANCIAL INC	92,854	25.29	2,348,277.66
AMERICAN EXPRESS CO	214,878	147.99	31,799,795.22
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36,365	290.58	10,566,941.70
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	147,838	18.92	2,797,094.96
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	138,965	63.72	8,854,849.80
ARES MANAGEMENT CORP - A	51,159	81.49	4,168,946.91
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	260,381	40.68	10,592,299.08
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	440,257	322.64	142,044,518.48
BLACKROCK INC	50,780	642.02	32,601,775.60
BLACKSTONE INC	237,382	83.28	19,769,172.96
BLOCK INC	182,870	57.31	10,480,279.70
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	129,860	87.42	11,352,361.20
CARLYLE GROUP INC/THE	60,998	26.41	1,611,262.17
CBOE GLOBAL MARKETS INC	35,152	139.04	4,887,534.08
CME GROUP INC	121,621	183.48	22,315,021.08
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	41,300	60.35	2,492,455.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	93,741	95.83	8,983,200.03
EQUITABLE HOLDINGS INC	136,406	23.43	3,195,992.58



FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12,356	400.27	4,945,736.12
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	201,163	55.00	11,063,965.00
FISERV INC	203,945	119.35	24,340,835.75
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23,091	227.17	5,245,582.47
FRANKLIN RESOURCES INC	95,796	24.52	2,348,917.92
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	42.95	859,000.00
GLOBAL PAYMENTS INC	91,798	103.53	9,503,846.94
GOLDMAN SACHS GROUP INC	114,537	320.72	36,734,306.64
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	188,891	108.21	20,439,895.11
INVESCO LTD	115,882	15.40	1,784,582.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	24,225	154.98	3,754,390.50
KKR & CO INC	191,878	48.61	9,327,189.58
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	26,019	187.96	4,890,531.24
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12,374	300.25	3,715,293.50
MASTERCARD INC - A	290,395	383.39	111,334,539.05
MOODY' S CORP	55,753	308.95	17,224,889.35
MORGAN STANLEY	428,579	82.63	35,413,482.77
MSCI INC	27,039	470.40	12,719,145.60
NASDAQ INC	117,506	55.22	6,488,681.32
NORTHERN TRUST CORP	68,340	70.52	4,819,336.80
PAYPAL HOLDINGS INC	366,636	64.18	23,530,698.48
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	66,129	85.04	5,623,610.16
S&P GLOBAL INC	112,516	360.29	40,538,389.64
SCHWAB (CHARLES) CORP	491,353	47.73	23,452,278.69
SEI INVESTMENTS COMPANY	39,270	58.33	2,290,619.10
STATE STREET CORP	126,012	67.73	8,534,792.76
SYNCHRONY FINANCIAL	154,684	27.41	4,239,888.44
T ROWE PRICE GROUP INC	77,974	106.05	8,269,142.70
TOAST INC-CLASS A	71,887	20.80	1,495,249.60
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	37,148	72.44	2,691,001.12
VISA INC-CLASS A SHARES	550,703	231.01	127,217,900.03
AFLAC INC	200,428	66.67	13,362,534.76
ALLSTATE CORP	89,782	118.33	10,623,904.06
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	23,305	116.00	2,703,380.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	251,687	52.81	13,291,590.47
AON PLC-CLASS A	69,923	335.22	23,439,588.06

ARCH CAPITAL GROUP LTD	128,199	77.31	9,911,064.69
ARTHUR J GALLAGHER & CO	71,148	216.81	15,425,597.88
ASSURANT INC	18,269	129.32	2,362,547.08
BROWN & BROWN INC	83,573	65.66	5,487,403.18
CHUBB LTD	140,235	201.39	28,241,926.65
CINCINNATI FINANCIAL CORP	51,694	103.95	5,373,591.30
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9,638	233.93	2,254,617.34
EVEREST RE GROUP LTD	12,726	387.10	4,926,234.60
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86,645	34.46	2,985,786.70
GLOBE LIFE INC	30,200	107.83	3,256,466.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	110,821	69.87	7,743,063.27
LOEWS CORP	65,826	58.40	3,844,238.40
MARKEL CORP	4,594	1,373.87	6,311,558.78
MARSH & MCLENNAN COS	167,389	180.37	30,191,953.93
METLIFE INC	225,726	51.23	11,563,942.98
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	82,864	68.72	5,694,414.08
PROGRESSIVE CORP	197,608	133.94	26,467,615.52
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	124,877	80.51	10,053,847.27
TRAVELERS COS INC/THE	79,176	182.81	14,474,164.56
WILLIS TOWERS WATSON PLC	37,225	228.34	8,499,956.50
WR BERKLEY CORP	70,051	58.88	4,124,602.88
ACCENTURE PLC-CL A	213,063	272.27	58,010,663.01
ADOBE INC	157,239	341.58	53,709,697.62
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	54,596	85.92	4,690,888.32
ANSYS INC	29,425	296.01	8,710,094.25
ASPEN TECHNOLOGY INC	10,737	166.47	1,787,388.39
ATLASSIAN CORP-CL A	51,839	135.68	7,033,515.52
AUTODESK INC	73,004	193.10	14,097,072.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	61,932	45.22	2,800,565.04
BILL HOLDINGS INC	28,947	99.52	2,880,805.44
BLACK KNIGHT INC	51,474	54.51	2,805,847.74
CADENCE DESIGN SYS INC	92,653	201.46	18,665,873.38
CHECK POINT SOFTWARE TECH	33,201	120.89	4,013,668.89
CLOUDFLARE INC - CLASS A	84,516	50.02	4,227,490.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	176,097	61.88	10,896,882.36
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	69,072	132.15	9,127,864.80

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	14,727	142.71	2,101,690.17
DATADOG INC - CLASS A	86,065	86.65	7,457,532.25
DOCUSIGN INC	70,528	49.44	3,486,904.32
DROPBOX INC-CLASS A	105,421	21.72	2,289,744.12
DYNATRACE INC	71,672	46.96	3,365,717.12
EPAM SYSTEMS INC	20,043	232.66	4,663,204.38
FAIR ISAAC CORP	8,140	749.29	6,099,220.60
FORTINET INC	224,468	67.50	15,151,590.00
GARTNER INC	26,705	305.85	8,167,724.25
GEN DIGITAL INC	212,134	17.16	3,640,219.44
GODADDY INC - CLASS A	50,548	70.43	3,560,095.64
HUBSPOT INC	16,061	461.47	7,411,669.67
INTL BUSINESS MACHINES CORP	305,643	120.90	36,952,238.70
INTUIT INC	90,222	424.89	38,334,425.58
MICROSOFT CORP	2,395,596	310.11	742,898,275.56
MONGODB INC	22,594	264.09	5,966,849.46
OKTA INC	53,584	78.89	4,227,241.76
ORACLE CORP	547,001	97.44	53,299,777.44
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	586,176	9.88	5,791,418.88
PALO ALTO NETWORKS INC	102,227	197.18	20,157,119.86
PTC INC	36,419	129.48	4,715,532.12
ROPER TECHNOLOGIES INC	35,813	458.46	16,418,827.98
SALESFORCE INC	338,208	203.47	68,815,181.76
SERVICENOW INC	68,438	452.57	30,972,985.66
SNOWFLAKE INC-CLASS A	76,762	170.07	13,054,913.34
SPLUNK INC	53,603	85.61	4,588,952.83
SYNOPSYS INC	51,632	367.96	18,998,510.72
TWILIO INC - A	58,401	47.48	2,772,879.48
TYLER TECHNOLOGIES INC	13,376	388.62	5,198,181.12
UNITY SOFTWARE INC	81,932	32.46	2,659,512.72
VERISIGN INC	32,791	220.47	7,229,431.77
VMWARE INC-CLASS A	73,008	123.06	8,984,364.48
WIX.COM LTD	21,919	77.64	1,701,791.16
WORKDAY INC-CLASS A	68,099	178.32	12,143,413.68
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	76,191	64.45	4,910,509.95
ZSCALER INC	28,648	115.42	3,306,552.16

AMPHENOL CORP-CL A	200,195	75.12	15,038,648.40
APPLE INC	5,381,369	173.75	935,012,863.75
ARISTA NETWORKS INC	82,654	139.01	11,489,732.54
ARROW ELECTRONICS INC	22,422	118.70	2,661,491.40
CDW CORP/DE	47,028	167.50	7,877,190.00
CISCO SYSTEMS INC	1,388,917	46.37	64,404,081.29
COGNEX CORP	56,700	50.13	2,842,371.00
CORNING INC	271,056	30.98	8,397,314.88
DELL TECHNOLOGIES -C	82,035	44.70	3,666,964.50
F5 INC	20,124	134.80	2,712,715.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	420,634	13.78	5,796,336.52
HP INC	342,009	29.39	10,051,644.51
JUNIPER NETWORKS INC	105,432	28.92	3,049,093.44
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	60,247	144.51	8,706,293.97
MOTOROLA SOLUTIONS INC	56,483	288.42	16,290,826.86
NETAPP INC	71,581	63.05	4,513,182.05
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	70,258	56.80	3,990,654.40
TE CONNECTIVITY LTD	107,282	120.06	12,880,276.92
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	16,214	413.64	6,706,758.96
TRIMBLE INC	81,451	46.74	3,807,019.74
WESTERN DIGITAL CORP	104,789	32.55	3,410,881.95
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	18,052	265.28	4,788,834.56
AT&T INC	2,411,426	16.96	40,897,784.96
LIBERTY GLOBAL PLC- C	82,999	18.15	1,506,431.85
LIBERTY GLOBAL PLC-A	55,653	17.35	965,579.55
T-MOBILE US INC	210,580	142.70	30,049,766.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,421,945	37.60	53,465,132.00
AES CORP	236,364	22.03	5,207,098.92
ALLIANT ENERGY CORP	87,688	54.60	4,787,764.80
AMEREN CORPORATION	84,684	88.84	7,523,326.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	173,624	90.68	15,744,224.32
AMERICAN WATER WORKS CO INC	65,282	149.42	9,754,436.44
ATMOS ENERGY CORP	49,123	118.10	5,801,426.30
CENTERPOINT ENERGY INC	214,951	29.91	6,429,184.41
CMS ENERGY CORP	100,621	61.55	6,193,222.55
CONSOLIDATED EDISON INC	119,881	98.96	11,863,423.76

CONSTELLATION ENERGY	113,055	79.12	8,944,911.60
DOMINION ENERGY INC	282,251	55.46	15,653,640.46
DTE ENERGY COMPANY	63,693	113.06	7,201,130.58
DUKE ENERGY CORP	260,277	97.33	25,332,760.41
EDISON INTERNATIONAL	131,955	73.21	9,660,425.55
ENTERGY CORP	66,606	106.31	7,080,883.86
ESSENTIAL UTILITIES INC	83,324	42.19	3,515,439.56
EVERGY INC	80,215	62.43	5,007,822.45
EVERSOURCE ENERGY	120,162	76.25	9,162,352.50
EXELON CORP	335,812	42.48	14,265,293.76
FIRSTENERGY CORP	177,948	39.39	7,009,371.72
NEXTERA ENERGY INC	671,900	76.10	51,131,590.00
NISOURCE INC	135,740	28.16	3,822,438.40
NRG ENERGY INC	77,774	31.04	2,414,104.96
P G & E CORP	506,057	17.35	8,780,088.95
PPL CORP	240,681	28.39	6,832,933.59
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	170,815	63.44	10,836,503.60
SEMPRA ENERGY	106,219	153.48	16,302,492.12
SOUTHERN CO/THE	367,855	74.65	27,460,375.75
UGI CORP	77,644	28.77	2,233,817.88
VISTRA CORP	119,689	24.64	2,949,136.96
WEC ENERGY GROUP INC	108,126	93.83	10,145,462.58
XCEL ENERGY INC	185,387	68.62	12,721,255.94
ADVANCED MICRO DEVICES	545,290	97.10	52,947,659.00
ANALOG DEVICES INC	171,959	180.59	31,054,075.81
APPLIED MATERIALS INC	290,460	115.46	33,536,511.60
BROADCOM INC	140,986	627.67	88,492,682.62
ENPHASE ENERGY INC	45,983	160.79	7,393,606.57
ENTEGRIS INC	53,642	93.43	5,011,772.06
FIRST SOLAR INC	32,904	183.19	6,027,683.76
INTEL CORP	1,396,217	28.86	40,294,822.62
KLA CORP	47,852	386.54	18,496,712.08
LAM RESEARCH CORP	46,072	527.48	24,302,058.56
MARVELL TECHNOLOGY INC	289,468	39.73	11,500,563.64
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	185,661	73.15	13,581,102.15
MICRON TECHNOLOGY INC	367,703	61.61	22,654,181.83

	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	15,407	398.61	6,141,384.27	
	NVIDIA CORP	832,121	285.78	237,803,539.38	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	87,535	163.35	14,298,842.25	
	ON SEMICONDUCTOR	147,518	80.32	11,848,645.76	
	QORVO INC	33,116	90.56	2,998,984.96	
	QUALCOMM INC	379,099	104.06	39,449,041.94	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	55,375	96.91	5,366,391.25	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	19,580	296.06	5,796,854.80	
	TERADYNE INC	52,994	91.18	4,831,992.92	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	306,747	161.17	49,438,413.99	
	WOLFSPEED INC	40,925	39.48	1,615,719.00	
	CBRE GROUP INC - A	107,372	73.64	7,906,874.08	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	356,100	4.43	1,577,523.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	51,785	45.73	2,368,128.05	
	アメリカドル 小計	114,540,453		12,059,974,477.00 (1,623,634,363,838)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	192,700	17.04	3,283,608.00	
	CAMECO CORP	142,600	37.42	5,336,092.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	373,200	75.19	28,060,908.00	
	CENOVUS ENERGY INC	497,400	21.41	10,649,334.00	
	ENBRIDGE INC	683,100	53.28	36,395,568.00	
	IMPERIAL OIL LTD	75,500	61.16	4,617,580.00	
	KEYERA CORP	76,700	32.21	2,470,507.00	
	PARKLAND CORP	42,600	33.41	1,423,266.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	193,232	43.15	8,337,960.80	
	SUNCOR ENERGY INC	457,400	38.87	17,779,138.00	
	TC ENERGY CORP	342,300	55.85	19,117,455.00	
	TOURMALINE OIL CORP	104,800	55.70	5,837,360.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	165,140	76.62	12,653,026.80	
	BARRICK GOLD CORP	605,600	25.67	15,545,752.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	50,500	67.72	3,419,860.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193,600	30.93	5,988,048.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	66,400	208.81	13,864,984.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	193,100	10.97	2,118,307.00	
	KINROSS GOLD CORP	392,200	7.20	2,823,840.00	
	LUNDIN MINING CORP	222,100	10.15	2,254,315.00	

NUTRIEN LTD	176,559	83.29	14,705,599.11
PAN AMERICAN SILVER CORP	75,100	22.77	1,710,027.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	155,300	58.00	9,007,400.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	18,200	100.06	1,821,092.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	153,000	67.74	10,364,220.00
CAE INC	97,800	29.09	2,845,002.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	28,300	104.31	2,951,973.00
WSP GLOBAL INC	44,300	173.84	7,701,112.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	62,000	51.06	3,165,720.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	57,700	73.60	4,246,720.00
THOMSON REUTERS CORP	55,032	165.88	9,128,708.16
AIR CANADA	62,200	21.01	1,306,822.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	194,400	161.96	31,485,024.00
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	314,800	109.24	34,388,752.00
TFI INTERNATIONAL INC	25,900	143.26	3,710,434.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	88,900	71.89	6,391,021.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	98.77	1,550,689.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	57,100	40.74	2,326,254.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	100,710	98.24	9,893,750.40
QUEBECOR INC -CL B	55,600	33.91	1,885,396.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19,100	171.05	3,267,055.00
DOLLARAMA INC	95,100	84.44	8,030,244.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	273,700	67.21	18,395,377.00
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	35.37	1,955,961.00
LOBLAW COMPANIES LTD	56,300	123.46	6,950,798.00
METRO INC/CN	84,000	77.86	6,540,240.00
WESTON (GEORGE) LTD	25,711	170.84	4,392,467.24
SAPUTO INC	95,600	35.63	3,406,228.00
BANK OF MONTREAL	229,200	118.08	27,063,936.00
BANK OF NOVA SCOTIA	403,400	66.56	26,850,304.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	308,000	56.21	17,312,680.00
NATIONAL BANK OF CANADA	110,500	101.05	11,166,025.00
ROYAL BANK OF CANADA	467,300	129.84	60,674,232.00
TORONTO-DOMINION BANK	613,300	82.17	50,394,861.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	113,788	43.77	4,980,500.76
BROOKFIELD CORP	480,650	42.11	20,240,171.50

	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	115,800	20.25	2,344,950.00	
	IGM FINANCIAL INC	20,700	39.49	817,443.00	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	17,800	48.97	871,666.00	
	ONEX CORPORATION	24,300	62.51	1,518,993.00	
	TMX GROUP LTD	19,600	145.96	2,860,816.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7,400	937.51	6,937,574.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	86,000	37.91	3,260,260.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	34,100	85.12	2,902,592.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	59,500	199.53	11,872,035.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	638,500	26.19	16,722,315.00	
	POWER CORP OF CANADA	188,300	35.89	6,758,087.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	201,900	64.53	13,028,607.00	
	CGI INC	69,100	138.42	9,564,822.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	6,800	2,597.19	17,660,892.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	29,200	105.89	3,091,988.00	
	OPEN TEXT CORP	91,800	54.32	4,986,576.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	403,000	84.93	34,226,790.00	
	BCE INC	22,600	64.29	1,452,954.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	123,300	66.00	8,137,800.00	
	TELUS CORP	145,100	27.67	4,014,917.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	241,500	11.61	2,803,815.00	
	ALTAGAS LTD	94,600	23.66	2,238,236.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	39,350	47.49	1,868,731.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	38,000	39.29	1,493,020.00	
	EMERA INC	89,100	58.46	5,208,786.00	
	FORTIS INC	164,000	61.15	10,028,600.00	
	HYDRO ONE LTD	110,100	39.14	4,309,314.00	
	NORTHLAND POWER INC	79,600	28.74	2,287,704.00	
	FIRSTSERVICE CORP	13,900	199.44	2,772,216.00	
	カナダドル 小計	13,514,672		820,226,205.27 (81,850,373,023)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	82,331	30.44	2,506,155.64	
	SANTOS LTD	1,045,835	7.18	7,509,095.30	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	64,847	32.52	2,108,824.44	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	640,088	33.81	21,641,375.28	
	BHP GROUP LTD	1,711,968	44.00	75,326,592.00	



BLUESCOPE STEEL LTD	157,082	19.37	3,042,678.34
FORTESCUE METALS GROUP LTD	574,706	20.22	11,620,555.32
IGO LTD	231,962	14.69	3,407,521.78
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	147,510	34.52	5,092,045.20
MINERAL RESOURCES LTD	62,759	73.58	4,617,807.22
NEWCREST MINING LTD	294,637	28.89	8,512,062.93
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	369,774	13.88	5,132,463.12
ORICA LTD	158,310	16.61	2,629,529.10
PILBARA MINERALS LTD	924,776	4.78	4,420,429.28
RIO TINTO LTD	125,567	109.01	13,688,058.67
SOUTH32 LTD	1,507,938	4.06	6,122,228.28
REECE LTD	81,800	18.05	1,476,490.00
BRAMBLES LTD	460,976	14.21	6,550,468.96
COMPUTERSHARE LTD	169,145	21.79	3,685,669.55
AURIZON HOLDINGS LTD	607,049	3.51	2,130,741.99
QANTAS AIRWAYS LTD	318,258	6.35	2,020,938.30
TRANSURBAN GROUP	1,064,099	14.80	15,748,665.20
ARISTOCRAT LEISURE LTD	196,842	38.53	7,584,322.26
IDP EDUCATION LTD	66,233	27.01	1,788,953.33
LOTTERY CORP LTD/THE	820,014	4.89	4,009,868.46
REA GROUP LTD	16,523	138.71	2,291,905.33
SEEK LTD	111,070	24.37	2,706,775.90
WESFARMERS LTD	385,211	51.30	19,761,324.30
COLES GROUP LTD	465,135	18.10	8,418,943.50
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	449,953	6.40	2,879,699.20
WOOLWORTHS GROUP LTD	415,153	38.57	16,012,451.21
TREASURY WINE ESTATES LTD	245,838	13.18	3,240,144.84
COCHLEAR LTD	23,404	245.70	5,750,362.80
RAMSAY HEALTH CARE LTD	66,537	60.92	4,053,434.04
SONIC HEALTHCARE LTD	163,646	35.68	5,838,889.28
CSL LTD	162,692	302.00	49,132,984.00
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,007,785	24.31	24,499,253.35
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	572,179	98.35	56,273,804.65
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,062,674	26.37	28,022,713.38
WESTPAC BANKING CORP	1,181,646	21.13	24,968,179.98
ASX LTD	70,918	68.11	4,830,224.98

	MACQUARIE GROUP LTD	123,788	179.50	22,219,946.00
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	762,528	4.88	3,721,136.64
	MEDIBANK PRIVATE LTD	936,375	3.53	3,305,403.75
	QBE INSURANCE GROUP LTD	488,602	15.16	7,407,206.32
	SUNCORP GROUP LTD	404,738	12.38	5,010,656.44
	WISETECH GLOBAL LTD	55,637	70.21	3,906,273.77
	XERO LTD	42,700	93.16	3,977,932.00
	TELSTRA GROUP LTD	1,329,461	4.32	5,743,271.52
	APA GROUP	397,094	10.27	4,078,155.38
	ORIGIN ENERGY LTD	540,177	8.35	4,510,477.95
	LENLEASE GROUP	244,789	7.91	1,936,280.99
	オーストラリアドル 小計	23,610,759		546,871,371.45 (49,344,203,845)
イギリスポンド	BP PLC	6,126,750	4.77	29,267,484.75
	SHELL PLC	2,385,189	23.87	56,934,461.43
	ANGLO AMERICAN PLC	431,835	23.47	10,137,326.62
	ANTOFAGASTA PLC	124,065	13.82	1,714,578.30
	CRODA INTERNATIONAL PLC	45,330	68.52	3,106,011.60
	GLENORE PLC	3,486,306	4.27	14,907,444.45
	JOHNSON MATTHEY PLC	58,854	19.42	1,142,944.68
	MONDI PLC	161,979	12.98	2,103,297.31
	RIO TINTO PLC	381,068	48.82	18,605,645.10
	ASHTAD GROUP PLC	151,489	46.70	7,074,536.30
	BAE SYSTEMS PLC	1,047,026	9.82	10,281,795.32
	BUNZL PLC	111,508	31.67	3,531,458.36
	DCC PLC	30,399	47.42	1,441,520.58
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,934,768	1.45	4,281,826.51
	SMITHS GROUP PLC	113,243	16.52	1,871,340.57
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	24,603	111.15	2,734,623.45
	EXPERIAN PLC	311,703	27.43	8,550,013.29
	INTERTEK GROUP PLC	55,231	41.58	2,296,504.98
	RELX PLC	646,773	24.96	16,143,454.08
	RENTOKIL INITIAL PLC	885,676	6.43	5,698,439.38
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	378,223	4.96	1,875,986.08
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32,323	43.29	1,399,262.67
	BURBERRY GROUP PLC	126,278	25.24	3,187,256.72

PERSIMMON PLC	103,740	13.04	1,352,769.60
TAYLOR WIMPEY PLC	1,180,533	1.23	1,458,548.52
COMPASS GROUP PLC	596,590	21.14	12,611,912.60
ENTAIN PLC	198,717	14.73	2,928,094.99
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	57,197	53.26	3,046,312.22
PEARSON PLC	194,698	8.11	1,579,000.78
WHITBREAD PLC	65,187	32.46	2,115,970.02
AUTO TRADER GROUP PLC	333,922	6.32	2,113,058.41
INFORMA PLC	468,909	7.02	3,293,616.81
WPP PLC	357,177	8.90	3,181,018.36
JD SPORTS FASHION PLC	969,434	1.68	1,634,465.72
KINGFISHER PLC	726,268	2.53	1,839,636.84
NEXT PLC	41,419	68.52	2,838,029.88
OCADO GROUP PLC	164,438	4.53	744,904.14
SAINSBURY (J) PLC	620,861	2.87	1,783,733.65
TESCO PLC	2,502,282	2.73	6,846,243.55
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	119,280	19.08	2,275,862.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	720,727	27.27	19,657,828.92
COCA-COLA HBC AG-DI	61,536	25.46	1,566,706.56
DIAGEO PLC	769,954	36.19	27,868,485.03
IMPERIAL BRANDS PLC	294,866	18.81	5,547,903.79
HALEON PLC	1,723,187	3.42	5,907,946.62
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	242,516	64.54	15,651,982.64
UNILEVER PLC	857,936	43.39	37,230,132.72
SMITH & NEPHEW PLC	282,738	12.76	3,609,150.57
ASTRAZENECA PLC	524,161	119.24	62,500,957.64
GSK PLC	1,376,865	14.44	19,892,945.52
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	54,192	18.56	1,005,803.52
BARCLAYS PLC	5,403,921	1.53	8,293,937.95
HSBC HOLDINGS PLC	6,756,737	5.93	40,107,990.83
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,846,414	0.45	10,480,792.42
NATWEST GROUP PLC	1,818,709	2.59	4,726,824.69
STANDARD CHARTERED PLC	805,585	6.20	4,994,627.00
3I GROUP PLC	319,724	17.98	5,750,236.14
ABRDN PLC	590,816	2.08	1,229,488.09
HARGREAVES LANSDOWN PLC	123,322	8.03	991,015.59

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	128,078	85.04	10,891,753.12
	M&G PLC	725,660	2.00	1,453,496.98
	SCHRODERS PLC	321,906	4.68	1,509,095.32
	ST JAMES' S PLACE PLC	199,717	11.45	2,286,759.65
	ADMIRAL GROUP PLC	63,019	22.34	1,407,844.46
	AVIVA PLC	934,484	4.14	3,872,501.69
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,050,970	2.29	4,711,078.09
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	293,906	5.75	1,692,310.74
	PRUDENTIAL PLC	931,229	11.81	11,002,470.63
	SAGE GROUP PLC/THE	358,305	8.17	2,928,068.46
	HALMA PLC	121,077	24.33	2,945,803.41
	BT GROUP PLC	2,429,600	1.52	3,706,354.80
	VODAFONE GROUP PLC	8,932,193	0.90	8,127,402.41
	NATIONAL GRID PLC	1,241,019	11.54	14,327,564.35
	SEVERN TRENT PLC	83,766	29.35	2,458,532.10
	SSE PLC	377,095	18.62	7,021,508.90
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	232,410	10.76	2,501,893.65
	イギリスポンド 小計	93,749,611		619,789,586.02 (104,434,545,244)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	60,430	13.92	841,185.60
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2,396	722.00	1,729,912.00
	GIVAUDAN-REG	3,166	3,183.00	10,077,378.00
	HOLCIM LTD	187,907	57.72	10,845,992.04
	SIG GROUP AG	103,650	26.10	2,705,265.00
	SIKA AG-REG	49,378	250.80	12,384,002.40
	ABB LTD-REG	530,275	32.94	17,467,258.50
	GEBERIT AG-REG	11,828	502.80	5,947,118.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	7,216	188.10	1,357,329.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	14,965	197.50	2,955,587.50
	VAT GROUP AG	8,759	318.80	2,792,369.20
	ADECCO GROUP AG-REG	55,553	29.19	1,621,592.07
	SGS SA-REG	56,050	80.56	4,515,388.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	17,625	259.50	4,573,687.50
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	176,258	149.45	26,341,758.10
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	9,553	297.60	2,842,972.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	17,907	54.40	974,140.80

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,298	1,952.00	2,533,696.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	350	11,160.00	3,906,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	37	112,000.00	4,144,000.00	
	NESTLE SA-REG	930,156	115.18	107,135,368.08	
	ALCON INC	170,295	71.34	12,148,845.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	17,404	283.50	4,934,034.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	36,777	142.50	5,240,722.50	
	BACHEM HOLDING AG	12,632	94.45	1,193,092.40	
	LONZA GROUP AG-REG	25,176	576.80	14,521,516.80	
	NOVARTIS AG-REG	731,400	92.58	67,713,012.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	9,828	312.00	3,066,336.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	236,786	282.45	66,880,205.70	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	9,251	85.75	793,273.25	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,198,227	0.76	910,652.52	
	JULIUS BAER GROUP LTD	74,047	62.06	4,595,356.82	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	7,700	847.00	6,521,900.00	
	UBS GROUP AG-REG	1,132,045	17.14	19,408,911.52	
	BALOISE HOLDING AG - REG	15,786	138.80	2,191,096.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10,419	537.20	5,597,086.80	
	SWISS RE AG	103,477	89.46	9,257,052.42	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	50,783	426.80	21,674,184.40	
	TEMENOS AG - REG	22,921	73.50	1,684,693.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55,125	57.34	3,160,867.50	
	SWISSCOM AG-REG	8,956	592.40	5,305,534.40	
	BKW AG	6,450	160.70	1,036,515.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	28,756	79.15	2,276,037.40	
	スイスフラン 小計	6,208,998		487,802,928.62 (73,453,364,991)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	883,868	53.00	46,845,004.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	451,500	80.30	36,255,450.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	656,000	13.38	8,777,280.00	
	MTR CORP	552,000	39.50	21,804,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	352,000	13.36	4,702,720.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	767,000	51.55	39,538,850.00	
	SANDS CHINA LTD	775,600	26.00	20,165,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	562,000	20.95	11,773,900.00	

	WH GROUP LTD	2,846,000	4.26	12,123,960.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,321,000	24.65	32,562,650.00	
	HANG SENG BANK LTD	249,300	113.90	28,395,270.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	408,900	312.40	127,740,360.00	
	AIA GROUP LTD	4,007,400	80.95	324,399,030.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,165,000	10.22	11,906,300.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	253,000	46.75	11,827,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	546,000	61.50	33,579,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	3,603,348	7.65	27,565,612.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	514,500	46.35	23,847,075.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	652,868	46.45	30,325,718.60	
	ESR GROUP LTD	632,800	12.28	7,770,784.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	13.24	9,585,760.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	559,641	27.65	15,474,073.65	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	552,250	20.40	11,265,900.00	
	SINO LAND CO	1,247,400	10.30	12,848,220.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	477,500	105.00	50,137,500.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	145,000	59.05	8,562,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	20.75	10,391,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	534,000	42.45	22,668,300.00	
	香港ドル 小計	25,940,675		1,002,839,917.45 (17,218,761,382)	
シンガポールド ル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	34.20	1,032,840.00	
	KEPPEL CORP LTD	477,500	6.43	3,070,325.00	
	SEATRIM LTD	15,794,803	0.12	1,990,145.17	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	529,600	3.65	1,933,040.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	461,640	5.91	2,728,292.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,914,500	1.12	2,144,240.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	670,600	3.96	2,655,576.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	614,700	31.10	19,117,170.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,152,500	12.30	14,175,750.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	407,400	27.98	11,399,052.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	303,500	9.46	2,871,110.00	
	VENTURE CORP LTD	76,900	15.66	1,204,254.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,888,260	2.58	7,451,710.80	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	802,000	3.74	2,999,480.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	118,100	6.97	823,157.00	
	UOL GROUP LTD	194,000	6.90	1,338,600.00	
	シンガポールドル 小計	26,436,203		76,934,742.37 (7,779,641,148)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	418,085	8.80	3,679,148.00	
	EBOS GROUP LTD	54,700	44.40	2,428,680.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	205,994	26.35	5,427,941.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	630,447	5.21	3,284,628.87	
	MERCURY NZ LTD	216,705	6.55	1,419,417.75	
	MERIDIAN ENERGY LTD	445,023	5.47	2,434,275.81	
	ニュージーランドドル 小計	1,970,954		18,674,092.33 (1,582,816,065)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	89,974	340.40	30,627,149.60	
	BOLIDEN AB RED SHS	89,974	11.45	1,030,922.09	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	413.20	13,642,624.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	189,562	145.50	27,581,271.00	
	ALFA LAVAL AB	92,471	381.70	35,296,180.70	
	ASSA ABLOY AB-B	348,981	245.60	85,709,733.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	886,563	150.00	132,984,450.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	536,895	132.10	70,923,829.50	
	EPIROC AB-A	235,563	200.90	47,324,606.70	
	EPIROC AB-B	132,310	172.90	22,876,399.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	90.38	14,391,388.16	
	INDUTRADE AB	83,800	256.90	21,528,220.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	218.60	12,779,137.40	
	LIFCO AB-B SHS	71,700	239.50	17,172,150.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	495,296	114.50	56,711,392.00	
	SANDVIK AB	370,537	199.25	73,829,497.25	
	SKANSKA AB-B SHS	104,733	149.85	15,694,240.05	
	SKF AB-B SHARES	139,662	176.30	24,622,410.60	
	VOLVO AB-A SHS	62,474	210.60	13,157,024.40	
	VOLVO AB-B SHS	515,139	205.20	105,706,522.80	
SECURITAS AB-B SHS	156,813	85.82	13,457,691.66		
VOLVO CAR AB-B	207,500	37.50	7,781,250.00		
ELECTROLUX AB-B	84,165	165.05	13,891,433.25		
EVOLUTION AB	63,418	1,340.20	84,992,803.60		

	EMBRACER GROUP AB	230,400	54.78	12,621,312.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	260,961	143.36	37,411,368.96	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	211,829	305.10	64,629,027.90	
	GETINGE AB-B SHS	85,916	249.60	21,444,633.60	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	60,727	232.80	14,137,245.60	
	NORDEA BANK ABP	1,127,309	107.00	120,622,063.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	525,384	112.20	58,948,084.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	515,326	86.26	44,452,020.76	
	SWEDBANK AB - A SHARES	294,827	165.50	48,793,868.50	
	EQT AB	117,771	211.20	24,873,235.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	44,871	287.90	12,918,360.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	53,600	287.70	15,420,720.00	
	INVESTOR AB-A SHS	178,300	219.70	39,172,510.00	
	INVESTOR AB-B SHS	617,963	216.10	133,541,804.30	
	KINNEVIK AB - B	80,928	167.70	13,571,625.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	24,225	489.20	11,850,870.00	
	ERICSSON LM-B SHS	950,219	53.49	50,827,214.31	
	HEXAGON AB-B SHS	673,784	116.95	78,799,038.80	
	TELE2 AB-B SHS	198,238	105.35	20,884,373.30	
	TELIA CO AB	910,648	27.08	24,660,347.84	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	147,348	40.84	6,017,692.32	
	SAGAX AB-B	64,700	224.40	14,518,680.00	
	スウェーデンクローネ 小計	12,583,512		1,813,828,425.45 (23,634,184,383)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	103,871	238.80	24,804,394.80	
	EQUINOR ASA	327,567	295.80	96,894,318.60	
	NORSK HYDRO ASA	434,804	68.12	29,618,848.48	
	YARA INTERNATIONAL ASA	61,095	416.40	25,439,958.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,500	471.00	15,307,500.00	
	ADEVINTA ASA	106,857	80.15	8,564,588.55	
	MOWI ASA	135,763	192.85	26,181,894.55	
	ORKLA ASA	250,892	81.26	20,387,483.92	
	SALMAR ASA	25,891	469.30	12,150,646.30	
	DNB BANK ASA	315,870	182.45	57,630,481.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69,251	180.40	12,492,880.40	
	TELENOR ASA	211,605	123.55	26,143,797.75	



	ノルウェークローネ 小計	2,075,966		355,616,792.85 (4,487,883,925)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	33,357	530.00	17,679,210.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	71,863	356.10	25,590,414.30	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	1,746.00	6,112,746.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	341,626	193.10	65,967,980.60	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,039	11,770.00	12,229,030.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,814	11,945.00	21,668,230.00	
	DSV A/S	63,994	1,324.00	84,728,056.00	
	PANDORA A/S	30,806	612.00	18,853,272.00	
	CARLSBERG AS-B	34,731	1,118.00	38,829,258.00	
	COLOPLAST-B	39,767	932.60	37,086,704.20	
	DEMANT A/S	34,228	283.00	9,686,524.00	
	GENMAB A/S	22,246	2,869.00	63,823,774.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	559,792	1,155.60	646,895,635.20	
	DANSKE BANK A/S	221,483	138.60	30,697,543.80	
	TRYG A/S	114,270	158.00	18,054,660.00	
ORSTED A/S	60,759	630.80	38,326,777.20		
	デンマーククローネ 小計	1,635,276		1,136,229,815.30 (22,417,814,255)	
イスラエルシケル	ICL GROUP LTD	211,785	22.47	4,758,808.95	
	ELBIT SYSTEMS LTD	10,169	701.30	7,131,519.70	
	BANK HAPOALIM BM	445,216	32.73	14,571,919.68	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	520,979	29.30	15,264,684.70	
	FIRST INTL BANK ISRAEL	24,000	138.70	3,328,800.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	403,741	19.30	7,792,201.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48,267	125.50	6,057,508.50	
	NICE LTD	22,115	684.40	15,135,506.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	572,400	5.18	2,965,032.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	35,700	152.20	5,433,540.00	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	214.80	3,180,328.80	
	イスラエルシケル 小計	2,309,178		85,619,849.63 (3,161,932,484)	
ユーロ	ENI SPA	846,219	13.19	11,165,013.48	
	GALP ENERGIA SGPS SA	151,355	10.45	1,582,416.52	
	NESTE OYJ	144,923	39.31	5,696,923.13	

OMV AG	55,701	41.49	2,311,034.49
REPSOL SA	480,018	13.06	6,269,035.08
TENARIS SA	169,211	12.11	2,049,145.21
TOTALENERGIES SE	840,319	54.87	46,108,303.53
AIR LIQUIDE SA	176,925	162.72	28,789,236.00
AKZO NOBEL N. V.	58,755	74.44	4,373,722.20
ARCELORMITTAL	172,493	24.04	4,146,731.72
ARKEMA	19,014	87.68	1,667,147.52
BASF SE	311,075	47.11	14,654,743.25
COVESTRO AG	64,321	39.34	2,530,388.14
CRH PLC	251,302	45.27	11,376,441.54
DSM-FIRMENICH AG	59,131	117.80	6,965,631.80
EVONIK INDUSTRIES AG	76,974	19.36	1,490,216.64
HEIDELBERGCEMENT AG	47,261	69.44	3,281,803.84
OCI NV	34,955	22.26	778,098.30
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	81,855	34.77	2,846,098.35
SOLVAY SA	24,153	107.45	2,595,239.85
STORA ENSO OYJ-R SHS	184,408	11.85	2,185,234.80
SYMRISE AG	47,263	108.85	5,144,577.55
UMICORE	77,865	28.88	2,248,741.20
UPM-KYMMENE OYJ	175,063	30.28	5,300,907.64
VOESTALPINE AG	39,061	30.20	1,179,642.20
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	80,655	31.68	2,555,150.40
AIRBUS SE	200,012	121.32	24,265,455.84
ALSTOM	114,969	23.91	2,748,908.79
BOUYGUES SA	69,916	31.55	2,205,849.80
BRENTAG SE	49,586	76.54	3,795,312.44
CNH INDUSTRIAL NV	357,627	12.69	4,538,286.63
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	168,378	53.05	8,932,452.90
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	147,911	28.71	4,246,524.81
DASSAULT AVIATION SA	9,266	169.60	1,571,513.60
EIFFAGE	27,982	105.55	2,953,500.10
FERROVIAL SA	157,922	28.70	4,532,361.40
GEA GROUP AG	52,112	40.17	2,093,339.04
IMCD NV	18,078	138.40	2,501,995.20
KINGSPAN GROUP PLC	51,132	62.22	3,181,433.04

KNORR-BREMSE AG	25,881	66.38	1,717,980.78
KONE OYJ-B	115,873	51.90	6,013,808.70
LEGRAND SA	92,909	85.82	7,973,450.38
METSO CORPORATION	226,750	10.58	2,400,148.75
MTU AERO ENGINES AG	17,773	228.70	4,064,685.10
PRYSMIAN SPA	81,681	35.13	2,869,453.53
RATIONAL AG	2,060	653.50	1,346,210.00
RHEINMETALL AG	14,260	259.30	3,697,618.00
SAFRAN SA	115,627	139.48	16,127,653.96
SCHNEIDER ELECTRIC SE	183,501	157.12	28,831,677.12
SIEMENS AG-REG	258,652	148.86	38,502,936.72
SIEMENS ENERGY AG	176,654	21.66	3,826,325.64
THALES SA	36,648	136.10	4,987,792.80
VINCI SA	181,964	108.68	19,775,847.52
WARTSILA OYJ ABP	161,062	11.00	1,772,487.31
BUREAU VERITAS SA	94,880	25.42	2,411,849.60
RANDSTAD NV	40,342	47.39	1,911,807.38
TELEPERFORMANCE	19,579	154.15	3,018,102.85
WOLTERS KLUWER	87,049	110.85	9,649,381.65
ADP	10,260	141.00	1,446,660.00
AENA SME SA	24,220	149.55	3,622,101.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	227,150	9.14	2,076,605.30
DEUTSCHE POST AG-REG	335,930	41.11	13,811,761.95
GETLINK SE	162,686	16.48	2,681,065.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	113,502	108.40	12,303,616.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	18,227	105.00	1,913,835.00
CONTINENTAL AG	34,400	65.22	2,243,568.00
DR ING HC F PORSCHE AG	38,470	114.35	4,399,044.50
FERRARI NV	41,289	269.40	11,123,256.60
MERCEDES-BENZ GROUP AG	270,759	67.77	18,349,337.43
MICHELIN (CGDE)	231,927	28.55	6,621,515.85
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	54,611	52.34	2,858,339.74
RENAULT SA	69,801	33.32	2,326,118.32
STELLANTIS NV	763,345	14.91	11,381,473.95
VALEO	72,083	17.35	1,250,640.05
VOLKSWAGEN AG	8,950	149.75	1,340,262.50

VOLKSWAGEN AG-PREF	63,649	119.64	7,614,966.36
ADIDAS AG	56,468	167.14	9,438,061.52
HERMES INTERNATIONAL	10,692	1,988.80	21,264,249.60
KERING	25,304	544.90	13,788,149.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	93,584	887.60	83,065,158.40
MONCLER SPA	70,646	66.78	4,717,739.88
PUMA SE	32,556	51.16	1,665,564.96
SEB SA	9,694	106.10	1,028,533.40
ACCOR SA	57,043	32.23	1,838,495.89
AMADEUS IT GROUP SA	154,871	65.50	10,144,050.50
DELIVERY HERO SE	54,469	39.10	2,129,737.90
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	57,568	183.50	10,563,728.00
JUST EAT TAKEAWAY	57,881	16.22	939,061.34
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	37,870	37.64	1,425,426.80
SODEXO SA	32,194	99.06	3,189,137.64
BOLLORE SE	271,925	5.99	1,628,830.75
PUBLICIS GROUPE	75,307	70.18	5,285,045.26
SCOUT24 SE	27,257	59.26	1,615,249.82
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	248,437	18.78	4,666,889.04
VIVENDI SE	236,529	9.75	2,307,576.92
D' IETEREN GROUP	8,226	166.70	1,371,274.20
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	372,239	31.30	11,651,080.70
PROSUS NV	271,137	65.62	17,792,009.94
ZALANDO SE	72,249	31.94	2,307,633.06
CARREFOUR SA	197,337	18.34	3,619,160.58
HELLOFRESH SE	45,738	23.53	1,076,215.14
JERONIMO MARTINS	95,613	22.90	2,189,537.70
KESKO OYJ-B SHS	93,457	19.00	1,776,150.28
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	355,206	31.01	11,016,714.09
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	293,942	56.51	16,610,662.42
DANONE	217,799	59.02	12,854,496.98
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	156,074	12.23	1,909,565.39
HEINEKEN HOLDING NV	38,117	86.80	3,308,555.60
HEINEKEN NV	88,926	103.75	9,226,072.50
JDE PEET'S NV	35,400	27.54	974,916.00
KERRY GROUP PLC-A	52,682	94.88	4,998,468.16

PERNOD RICARD SA	69,894	215.00	15,027,210.00
REMY COINTREAU	6,746	156.90	1,058,447.40
BEIERSDORF AG	33,411	125.90	4,206,444.90
HENKEL AG & CO KGAA	34,620	67.46	2,335,465.20
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	64,021	74.88	4,793,892.48
L'OREAL	81,720	423.70	34,624,764.00
AMPLIFON SPA	42,891	35.79	1,535,068.89
BIOMERIEUX	13,869	95.88	1,329,759.72
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	15,246	111.80	1,704,502.80
DIASORIN SPA	9,103	104.75	953,539.25
ESSILORLUXOTTICA	98,203	185.70	18,236,297.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	67,833	44.21	2,998,896.93
FRESENIUS SE & CO KGAA	148,916	27.80	4,139,864.80
KONINKLIJKE PHILIPS NV	315,514	18.96	5,983,407.49
SIEMENS HEALTHINEERS AG	92,542	53.84	4,982,461.28
ARGENX SE	18,640	368.30	6,865,112.00
BAYER AG-REG	332,422	53.94	17,930,842.68
EUROFINS SCIENTIFIC	44,948	60.60	2,723,848.80
GRIFOLS SA	82,564	11.02	909,855.28
IPSEN	13,860	112.10	1,553,706.00
MERCK KGAA	44,683	165.25	7,383,865.75
ORION OYJ-CLASS B	34,824	42.50	1,480,020.00
QIAGEN N. V.	73,322	41.57	3,047,995.54
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	32,103	43.14	1,384,923.42
SANOFI	385,873	99.16	38,263,166.68
SARTORIUS AG-VORZUG	8,436	347.60	2,932,353.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10,076	243.60	2,454,513.60
UCB SA	42,461	84.64	3,593,899.04
ABN AMRO BANK NV-CVA	133,234	13.79	1,837,296.86
AIB GROUP PLC	297,214	3.80	1,129,413.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,045,453	6.53	13,373,171.71
BANCO SANTANDER SA	5,697,822	3.13	17,885,463.25
BANK OF IRELAND GROUP PLC	351,816	8.88	3,125,533.34
BNP PARIBAS	376,464	57.35	21,590,210.40
CAIXABANK SA	1,457,948	3.32	4,846,219.15
COMMERZBANK AG	350,612	9.88	3,466,150.23

CREDIT AGRICOLE SA	418,393	11.55	4,833,275.93
ERSTE GROUP BANK AG	110,379	31.87	3,517,778.73
FINECOBANK SPA	218,566	12.49	2,729,889.34
ING GROEP NV	1,265,902	11.49	14,555,341.19
INTESA SANPAOLO	5,457,895	2.40	13,107,134.84
KBC GROUP NV	86,970	60.70	5,279,079.00
MEDIOBANCA SPA	181,481	9.68	1,758,187.92
SOCIETE GENERALE SA	281,872	21.80	6,144,809.60
UNICREDIT SPA	653,147	18.86	12,322,271.30
ADYEN NV	7,360	1,457.00	10,723,520.00
AMUNDI SA	21,837	60.30	1,316,771.10
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	724,419	9.58	6,945,729.37
DEUTSCHE BOERSE AG	64,617	172.50	11,146,432.50
EENREDE	81,610	58.60	4,782,346.00
EURAZEO SE	11,669	64.15	748,566.35
EURONEXT NV	28,504	70.25	2,002,406.00
EXOR NV	35,414	76.08	2,694,297.12
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	32,086	77.00	2,470,622.00
NEXI SPA	224,714	7.65	1,719,062.10
SOFINA	5,291	207.80	1,099,469.80
WENDEL	9,312	99.80	929,337.60
WORLDLINE SA	76,356	39.45	3,012,244.20
AEGON NV	589,592	4.03	2,381,362.08
AGEAS	51,936	40.00	2,077,440.00
ALLIANZ SE-REG	136,428	211.60	28,868,164.80
ASSICURAZIONI GENERALI	381,027	18.60	7,089,007.33
AXA SA	635,976	26.92	17,123,653.80
HANNOVER RUECK SE	20,084	190.25	3,820,981.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	47,380	324.90	15,393,762.00
NN GROUP NV	91,002	33.19	3,020,356.38
POSTE ITALIANE SPA	188,025	9.50	1,786,989.60
SAMPO OYJ-A SHS	164,393	45.58	7,493,032.94
BECHTLE AG	26,787	39.06	1,046,300.22
CAPGEMINI SE	56,142	160.30	8,999,562.60
DASSAULT SYSTEMES SE	230,071	36.23	8,335,472.33
NEMETSCHEK SE	20,683	68.66	1,420,094.78

SAP SE	353,077	122.30	43,181,317.10
NOKIA OYJ	1,876,698	3.72	6,995,391.79
CELLNEX TELECOM SA	185,248	37.65	6,974,587.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,098,711	21.54	23,666,234.94
ELISA OYJ	51,319	55.86	2,866,679.34
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	114,083	12.16	1,387,249.28
KONINKLIJKE KPN NV	1,065,750	3.30	3,519,106.50
ORANGE	659,792	11.56	7,631,154.27
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.27	984,680.28
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	297,838	3.07	916,447.52
TELEFONICA SA	1,787,950	3.84	6,878,243.65
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	30,096	14.53	437,294.88
ACCIONA SA	8,326	170.30	1,417,917.80
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	19,200	33.62	645,504.00
E.ON SE	760,421	11.96	9,098,437.26
EDP RENOVAVEIS SA	96,779	19.76	1,912,353.04
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS-RTS	96,779	0.26	25,501.26
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	985,811	4.79	4,730,906.98
ELIA GROUP SA/NV	10,658	124.20	1,323,723.60
ENAGAS SA	82,825	18.21	1,508,243.25
ENDESA SA	108,855	19.88	2,164,581.67
ENEL SPA	2,737,695	6.04	16,546,628.58
ENGIE	626,822	14.78	9,269,443.73
FORTUM OYJ	136,337	13.61	1,856,228.25
IBERDROLA SA	2,080,729	11.77	24,490,180.33
NATURGY ENERGY GROUP SA	45,200	28.28	1,278,256.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	131,018	16.38	2,146,729.93
RWE AG	217,674	41.76	9,090,066.24
SNAM SPA	693,764	5.07	3,517,383.48
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	469,067	7.96	3,736,587.72
VEOLIA ENVIRONNEMENT	218,632	27.84	6,086,714.88
VERBUND AG	22,697	77.45	1,757,882.65
ASM INTERNATIONAL NV	15,362	337.95	5,191,587.90
ASML HOLDING NV	136,399	593.30	80,925,526.70
INFINEON TECHNOLOGIES AG	441,727	33.17	14,654,293.22
STMICROELECTRONICS NV	230,831	38.25	8,829,285.75

	AROUNDTOWN SA	379,138	1.01	386,531.19
	LEG IMMOBILIEN SE	21,715	53.84	1,169,135.60
	VONOVIA SE	237,081	18.64	4,420,375.24
	ユーロ 小計	62,303,562		1,606,505,871.97 (236,092,102,944)
	合 計	386,879,819		2,249,091,987,527 (2,249,091,987,527)

(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	53,749	6,471,917.09	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	107,934	3,776,610.66	
		AMERICAN TOWER CORP	157,345	30,790,843.05	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	47,616	8,588,021.76	
		BOSTON PROPERTIES INC	47,057	2,326,027.51	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	32,617	3,616,899.13	
		CROWN CASTLE INC	146,289	17,070,463.41	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	99,468	9,724,986.36	
		EQUINIX INC	31,234	23,220,604.96	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	57,122	3,955,127.28	
		EQUITY RESIDENTIAL	123,902	7,794,674.82	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,585	4,683,513.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	45,690	6,970,923.30	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	85,391	4,227,708.41	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	140,933	2,815,841.34	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	171,442	3,613,997.36	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	236,020	3,979,297.20	
		INVITATION HOMES INC	202,193	6,880,627.79	
		IRON MOUNTAIN INC	93,347	5,154,621.34	
		KIMCO REALTY CORP	206,423	3,715,614.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	177,787	1,495,188.67	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	39,926	6,113,868.38			
PROLOGIS INC	311,662	39,188,379.88			



		PUBLIC STORAGE	53,263	15,712,585.00	
		REALTY INCOME CORP	212,780	13,149,804.00	
		REGENCY CENTERS CORP	55,581	3,250,932.69	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	37,260	8,683,443.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	111,021	11,795,981.25	
		SUN COMMUNITIES INC	43,591	5,926,196.45	
		UDR INC	113,375	4,688,056.25	
		VENTAS INC	137,514	6,421,903.80	
		VICI PROPERTIES INC	330,478	10,548,857.76	
		WELLTOWER INC	161,169	12,756,526.35	
		WEYERHAEUSER CO	241,709	7,190,842.75	
		WP CAREY INC	68,940	4,945,755.60	
アメリカドル合計			4,203,413	311,246,641.90 (41,903,135,398)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,300	1,152,185.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,194,268.00	
カナダドル合計			81,900	2,346,453.00 (234,152,544)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	413,611	3,296,479.67	
		GOODMAN GROUP	587,247	11,727,322.59	
		GPT GROUP	656,296	2,887,702.40	
		MIRVAC GROUP	1,521,680	3,575,948.00	
		SCENTRE GROUP	1,734,337	4,908,173.71	
		STOCKLAND	815,965	3,655,523.20	
		VICINITY CENTRES	1,315,193	2,709,297.58	
オーストラリアドル合計			7,044,329	32,760,447.15 (2,955,975,146)	
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	317,051	1,211,134.82	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	250,833	1,570,214.58	
		SEGRO PLC	403,906	3,269,215.16	
イギリスポンド合計			971,790	6,050,564.56 (1,019,520,128)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	865,200	43,260,000.00	
香港ドル合計			865,200	43,260,000.00 (742,774,200)	
シンガポ	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,134,200	3,266,496.00	

ールドル		CAPITALAND ASCOTT TRUST	45,724	48,924.68
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,879,771	3,872,328.26
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,029,700	1,791,678.00
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	650,700	1,112,697.00
シンガポールドル合計			4,740,095	10,092,123.94 (1,020,515,572)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	13,302	649,137.60
		GECINA SA	16,340	1,598,052.00
		KLEPIERRE	71,486	1,527,655.82
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,721	1,615,660.83
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,808	1,354,541.28
ユーロ合計			187,657	6,745,047.53 (991,252,185)
合計				48,867,325,173 (48,867,325,173)

(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 601 銘柄	97.48%	—	70.66%
	投資証券 35 銘柄	—	2.52%	1.82%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.71%	—	3.56%
	投資証券 2 銘柄	—	0.29%	0.01%
オーストラリアドル	株式 52 銘柄	94.35%	—	2.15%
	投資証券 7 銘柄	—	5.65%	0.13%
イギリスポンド	株式 76 銘柄	99.03%	—	4.54%
	投資証券 3 銘柄	—	0.97%	0.04%
スイスフラン	株式 43 銘柄	100.00%	—	3.20%
香港ドル	株式 28 銘柄	95.86%	—	0.75%
	投資証券 1 銘柄	—	4.14%	0.03%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	88.40%	—	0.34%
	投資証券 5 銘柄	—	11.60%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.00%	—	0.07%
スウェーデンクローネ	株式 46 銘柄	100.00%	—	1.03%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.00%	—	0.20%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.00%	—	0.98%

イスラエルシェケル	株式	11 銘柄	100.00%	—	0.14%
ユーロ	株式	222 銘柄	99.58%	—	10.27%
	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。

### 【中間財務諸表】

- 1 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。
- 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、当中間計算期間(2023年5月13日から2023年11月12日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により中間監査を受けております。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年1月17日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所  
指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）の2023年5月13日から2023年11月12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、三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）の2023年11月12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5月13日から2023年11月12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。

【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) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 [ 2023年5月12日現在 ]	第23期中間計算期間末 [ 2023年11月12日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	4,272,223
コール・ローン	270,992,581	304,181,041
親投資信託受益証券	8,161,342,739	9,091,844,849
未収入金	8,100,891	-
流動資産合計	8,440,436,211	9,400,298,113
資産合計	8,440,436,211	9,400,298,113
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,980,551	11,180,633
未払受託者報酬	2,186,305	2,508,118
未払委託者報酬	13,992,316	16,051,881
未払利息	320	480
その他未払費用	157,354	180,522
流動負債合計	27,316,846	29,921,634
負債合計	27,316,846	29,921,634
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,063,709,155	3,155,042,247
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	5,349,410,210	6,215,334,232
(分配準備積立金)	2,177,088,522	2,056,911,710
元本等合計	8,413,119,365	9,370,376,479
純資産合計	8,413,119,365	9,370,376,479
負債純資産合計	8,440,436,211	9,400,298,113

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期中間計算期間 自 2022年5月13日 至 2022年11月12日	第23期中間計算期間 自 2023年5月13日 至 2023年11月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	185	1,865
有価証券売買等損益	454,611,724	710,904,830
営業収益合計	454,611,909	710,906,695
<b>営業費用</b>		
支払利息	44,258	78,552
受託者報酬	2,141,764	2,508,118
委託者報酬	13,707,242	16,051,881

その他費用	154,146	180,522
営業費用合計	16,047,410	18,819,073
営業利益又は営業損失(△)	438,564,499	692,087,622
経常利益又は経常損失(△)	438,564,499	692,087,622
中間純利益又は中間純損失(△)	438,564,499	692,087,622
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(△)	13,778,371	27,040,026
期首剰余金又は期首欠損金(△)	4,475,369,683	5,349,410,210
剰余金増加額又は欠損金減少額	339,517,098	510,446,565
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	339,517,098	510,446,565
剰余金減少額又は欠損金増加額	261,175,360	309,570,139
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	261,175,360	309,570,139
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	4,978,497,549	6,215,334,232

### (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。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第22期 [2023年5月12日現在]	第23期中間計算期間末 [2023年11月12日現在]
1. 期首元本額	2,974,517,379円	3,063,709,155円
期中追加設定元本額	423,114,832円	268,106,350円
期中一部解約元本額	333,923,056円	176,773,258円
2. 受益権の総数	3,063,709,155口	3,155,042,247口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期中間計算期間 自2022年5月13日 至2022年11月12日	第23期中間計算期間 自2023年5月13日 至2023年11月12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22期 [2023年5月12日現在]	第23期中間計算期間末 [2023年11月12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。 (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	(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	等) は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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 22 期 [2023 年 5 月 12 日現在]	第 23 期中間計算期間末 [2023 年 11 月 12 日現在]
1口当たり純資産額	2,7461 円	2,9700 円
(1万口当たり純資産額)	(27,461 円)	(29,700 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。

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 11 月 12 日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,234,731,942
国債証券	633,324,681,220
地方債証券	41,317,213,204
特殊債券	35,328,539,088
社債券	45,758,108,000
未収利息	1,322,666,639
前払金	150,000
前払費用	51,861,667
差入委託証拠金	1,587,732
流動資産合計	758,339,539,492
資産合計	758,339,539,492
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	370,935



未払解約金	389,833,190
未払利息	649
流動負債合計	390,204,774
負債合計	390,204,774
純資産の部	
元本等	
元本	599,981,884,973
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	157,967,449,745
元本等合計	757,949,334,718
純資産合計	757,949,334,718
負債純資産合計	758,339,539,492

## 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11月12日現在]
1. 期首	2023年5月13日
期首元本額	552,953,193,068円
期中追加設定元本額	80,106,297,595円
期中一部解約元本額	33,077,605,690円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	7,314,940,458円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	10,341,719,825円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	2,631,134,418円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	56,040,222,204円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	99,500,004,161円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	30,926,598,626円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	205,401,038円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	190,009,342円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,963,435,441円
eMAXIS 国内債券インデックス	7,059,256,982円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	4,317,374,004円
eMAXIS バランス(波乗り型)	846,596,323円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	16,180,756,634円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	41,574,651,434円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	10,601,113,513円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	4,808,744,233円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	2,139,255,261円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	16,689,165,038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)	20,383,273,851円
つみたて8資産均等バランス	9,868,585,324円
つみたて4資産均等バランス	3,638,834,487円

eMAXIS マイマネージャー 1970s	17,795,530円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	13,703,748円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	422,007円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	5,864,747,526円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	2,537,789,823円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	958,230,051円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	6,883,579,429円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	6,381,503,694円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	3,695,388,235円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	695,699,220円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	1,269,754,931円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	1,447,994,720円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	321,989,260円
ラップ向けインデックスf 国内債券	5,985,673,417円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	2,215,683,176円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,094,126,372円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	5,609,856円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	2,118,023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)	75,847,769円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,479,733,586円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,857,324,421円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	1,084,646,001円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	2,165,575,926円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	108,897,825円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	43,222,832円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	6,140,555,118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)	30,143円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	25,806,089円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	8,932,149,854円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	667,445,647円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,459,482,372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)	120,536,715,423円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	445,793,163円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,469,236円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	292,501円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,291,378,047円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,482,901,841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)	3,505,290,254円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	485,268,244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)	13,185,179,518円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投	2,288,353,875円

資家限定)	
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, 880, 271 円
日本債券インデックスファンドS	3, 498, 084, 948 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, 199, 259 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, 273, 558 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3, 133, 120 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	9, 473, 806 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	17, 496, 721 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	43, 536, 184 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	8, 858, 507 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	30, 515, 518 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4, 283, 438, 390 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, 234, 206, 139 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, 669, 822, 919 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, 881, 375, 551 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, 990, 373, 033 円
合計	599, 981, 884, 973 円
2. 受益権の総数	599, 981, 884, 973 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11月12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

債券関連

[2023年11月12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	144,910,000	—	144,540,000	△370,000
合計		144,910,000	—	144,540,000	△370,000

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	[2023年11月12日現在]
1口当たり純資産額	1.2633円
(1万口当たり純資産額)	(12,633円)

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

[2023年11月12日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	63,907,483,405
株式	1,133,564,667,930
派生商品評価勘定	422,927,750
未収入金	999,842,288
未収配当金	10,782,753,310
未収利息	209,261
その他未収収益	28,299,876
差入委託証拠金	775,638,355
流動資産合計	1,210,481,822,175
資産合計	1,210,481,822,175
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	139,950
前受金	380,420,000
未払金	16,336,140
未払解約金	2,310,786,923
未払利息	33,617
受入担保金	59,432,159,979
流動負債合計	62,139,876,609
負債合計	62,139,876,609
純資産の部	
元本等	
元本	405,542,245,792
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	742,799,699,774
元本等合計	1,148,341,945,566
純資産合計	1,148,341,945,566
負債純資産合計	1,210,481,822,175

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11月12日現在]
1. 期首	2023年5月13日
期首元本額	392,461,590,302円
期中追加設定元本額	87,157,177,262円
期中一部解約元本額	74,076,521,772円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインドックスオープン	6,960,606,165円

三菱UFJ	ライフセレクトファンド (安定型)	851, 551, 595 円
三菱UFJ	ライフセレクトファンド (安定成長型)	3, 728, 049, 748 円
三菱UFJ	ライフセレクトファンド (成長型)	3, 550, 478, 000 円
三菱UFJ	トピックスオープン (確定拠出年金)	3, 533, 485, 638 円
三菱UFJ	プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	6, 523, 784, 192 円
三菱UFJ	プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	35, 868, 689, 248 円
三菱UFJ	プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	41, 733, 020, 394 円
三菱UFJ	6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	95, 544, 635 円
三菱UFJ	6資産バランスファンド (成長型)	266, 395, 201 円
	ファンド・マネジャー (国内株式)	658, 450, 774 円
eMAXIS	TOPIXインデックス	7, 605, 752, 470 円
eMAXIS	バランス (8資産均等型)	2, 144, 183, 924 円
eMAXIS	バランス (波乗り型)	87, 852, 973 円
三菱UFJ	プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	2, 828, 086, 864 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	884, 006, 551 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	1, 086, 199, 493 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	1, 034, 177, 054 円
eMAXIS	Slim 国内株式 (TOPIX)	34, 591, 674, 761 円
	国内株式セレクション (ラップ向け)	4, 630, 089, 569 円
eMAXIS	Slim バランス (8資産均等型)	10, 067, 990, 925 円
	つみたて日本株式 (TOPIX)	8, 600, 829, 501 円
	つみたて8資産均等バランス	4, 863, 587, 752 円
	つみたて4資産均等バランス	1, 722, 699, 375 円
eMAXIS	マイマネージャー 1970s	2, 694, 196 円
eMAXIS	マイマネージャー 1980s	4, 619, 498 円
eMAXIS	マイマネージャー 1990s	9, 520, 286 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	716, 120, 966 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	888, 269, 529 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	613, 088, 404 円
三菱UFJ	DC年金バランス (株式15)	565, 652, 038 円
三菱UFJ	DC年金バランス (株式40)	1, 742, 780, 823 円
三菱UFJ	DC年金バランス (株式65)	3, 789, 830, 599 円
eMAXIS	Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1, 081, 938, 623 円
三菱UFJ	DC年金インデックス (国内株式)	3, 723, 574, 158 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	539, 247, 508 円
三菱UFJ	DC年金バランス (株式25)	163, 527, 715 円
	国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	18, 680, 259, 762 円
三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	248, 340, 414 円
	ラップ向けインデックスf 国内株式	3, 860, 419, 698 円
MUFG	ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	138, 816, 109 円
MUFG	ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2, 219, 836, 069 円
MUFG	ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1, 216, 710, 050 円
三菱UFJ	DC年金バランス (株式80)	32, 167, 299 円
	ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3, 929, 619, 515 円
	ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	69, 233, 391 円
	ラップ向けアクティブアロケーションファンド	22, 831, 270 円
	アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	37, 591, 465 円

三菱UFJ	ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	1,634,945円
三菱UFJ	バランス・イノベーション (株式抑制型)	949,746,187円
三菱UFJ	バランス・イノベーション (株式重視型)	2,324,118,638円
三菱UFJ	バランス・イノベーション (新興国投資型)	214,469,989円
三菱UFJ	DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1,105,286,492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)	694,950,213円
eMAXIS	最適化バランス (マイゴールキーパー)	135,435,342円
eMAXIS	最適化バランス (マイディフェンダー)	164,084,152円
eMAXIS	最適化バランス (マイミッドフィルダー)	596,390,800円
eMAXIS	最適化バランス (マイフォワード)	496,329,945円
eMAXIS	最適化バランス (マイストライカー)	983,096,925円
三菱UFJ	トピックスオープン	1,025,732,066円
三菱UFJ	DCトピックスオープン	7,991,984,636円
三菱UFJ	トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	54,621,059円
三菱UFJ	トピックスインデックスファンドVA (適格機関投資家限定)	4,613,681,131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)	10,866円
三菱UFJ	バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,910,325円
三菱UFJ	バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,079,565,678円
三菱UFJ	バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	74,998,913円
三菱UFJ	バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,357,111,462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)	41,992,823,375円
三菱UFJ	バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	204,260,120円
三菱UFJ	バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	225,173円
三菱UFJ	バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	134,456円
三菱UFJ	バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	215,291,017円
三菱UFJ	バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	377,234,986円
MUAM	インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,219,136,976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)	2,879,857,169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)	889,917,967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)	458,793,322円
世界8資産	バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	84,815,840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)	3,447,918,352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)	140,663,959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)	3,007,126,651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)	286,530,039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)	15,953,508,512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)	77,600,521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）	190,789円
日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	122,250,671円
日本株式インデックスファンドS	2,380,735,644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）	328,661,570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）	705,762,192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	5,578,863,371円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,851,425円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	7,425,011円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,531,612円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	6,304,532円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	498,535,251円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	83,542,713円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	3,157,363円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	25,913,149円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,495,155円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	16,679,481円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,584,007,208円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド	350,396,110円



(安定型) 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)	1,491,965,569 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)	1,407,937,842 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)	1,317,954,258 円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	59,056,806,565 円
合計	405,542,245,792 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	57,648,749,250 円
3. 受益権の総数	405,542,245,792 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11月12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11月12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	13,692,360,000	—	14,115,480,000	423,120,000
合計		13,692,360,000	—	14,115,480,000	423,120,000

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報)

	[2023年11月12日現在]
1口当たり純資産額	2,8316円
(1万口当たり純資産額)	(28,316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11月12日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,471,480,091
コール・ローン	2,091,805,209
国債証券	484,935,081,817
派生商品評価勘定	1,962,976
未収利息	3,808,309,923
前払費用	318,170,376
流動資産合計	493,626,810,392
資産合計	493,626,810,392
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,253
未払金	445,934,224
未払解約金	398,282,229
未払利息	1,100
流動負債合計	844,248,806
負債合計	844,248,806
純資産の部	
元本等	
元本	195,706,643,162
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	297,075,918,424
元本等合計	492,782,561,586
純資産合計	492,782,561,586
負債純資産合計	493,626,810,392

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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11月12日現在]
1. 期首	2023年5月13日
期首元本額	187,414,503,873円
期中追加設定元本額	20,480,075,213円
期中一部解約元本額	12,187,935,924円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	279,636,012円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	630,666,771円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	396,415,033円
三菱UFJ 外国債券オープン	890,767,714円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,142,308,001円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,067,804,748円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,659,514,410円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	537,827,436円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	100,521,749円
ファンド・マネジャー(海外債券)	610,103,659円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,993,716,456円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,422,664,008円
eMAXIS バランス(波乗り型)	223,522,392円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	986,746,681円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	414,029,792円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	217,870,831円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	148,777,365円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	34,630,059,416円
海外債券セレクション(ラップ向け)	5,730,824,956円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,295,885,699円
つみたて8資産均等バランス	5,461,079,939円
つみたて4資産均等バランス	1,919,175,579円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4,351,822円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,287,641円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	635,789円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	224,673,618円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	142,029,394円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	79,875,550円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	789,439,832円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,167,490,279円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,670,280,226円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	1,942,743,092円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	67,149,906円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	171,168,435円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065(確定拠出年金)	31,304,087円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,703,507,952円
三菱UFJ DC年金バランス(株式80)	21,551,242円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	3,071,141,481円

ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	50,769,607円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	24,358,131円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	41,507,168円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070(確定拠出年金)	200,897円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	3,080,824,521円
三菱UFJ 外国債券オープン(毎月分配型)	17,254,842,609円
ワールド・インカムオープン	1,017,447,371円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15,352,126,635円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(毎月分配型)	415,287,607円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)	2,037,818,046円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	780,534,959円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	517,578,130円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	279,660,144円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	315,494,254円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	168,206,657円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	66,250,370円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	1,066,318,234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)	1,838円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2(適格機関投資家限定)	10,780,856円
MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)	523,199,281円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	11,029,507円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,541,389,522円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	1,150,866,251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)	39,415,229,903円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	461,487,482円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	376,730円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	102,993円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,284,914,086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)	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)	569,923,158円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	29,593,009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)	2,501,114,869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)	364,742,919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)	749,574,967円
海外債券インデックスファンドS	3,412,145,201円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	1,621,540円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	2,799,241円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	498,509円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	879,607円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	4,654,711円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	3,570,870円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	7,342,733円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	3,397,434円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	9,389,961円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,744,334,677円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド	197,933,989円

(安定型)		
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)		563,395,539 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)		457,801,397 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)		187,143,487 円
合計		195,706,643,162 円
2. 受益権の総数		195,706,643,162 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11月12日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2023年11月12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	1,574,505,500	—	1,576,443,280	1,937,780
		カナダドル	4,377,000	—	4,383,472	6,472
		イギリスポンド	7,414,600	—	7,399,792	△14,808
		中国元	9,953,664	—	9,971,376	17,712
		ユーロ	53,304,900	—	53,295,627	△9,273
	売建	アメリカドル	37,833,500	—	37,833,625	△125
		中国元	6,016,920	—	6,023,967	△7,047
		ユーロ	37,142,010	—	37,140,998	1,012
		合計	1,730,548,094	—	1,732,492,137	1,931,723

(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11月12日現在]
1口当たり純資産額	2,5180円
(1万口当たり純資産額)	(25,180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11月12日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	33,598,623,964
コール・ローン	19,000,480,985
株式	3,182,023,754,161
投資証券	62,492,141,545
派生商品評価勘定	1,712,871,445
未収入金	768,034,504
未収配当金	2,394,317,905
差入委託証拠金	44,973,828,449
流動資産合計	3,346,964,052,958
資産合計	3,346,964,052,958
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	218,587,955
未払金	763,691,906
未払解約金	4,381,507,242
未払利息	9,994
流動負債合計	5,363,797,097
負債合計	5,363,797,097
純資産の部	
元本等	
元本	586,219,505,335
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,755,380,750,526

元本等合計	3,341,600,255,861
純資産合計	3,341,600,255,861
負債純資産合計	3,346,964,052,958

## 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11月12日現在]
1. 期首	2023年5月13日
期首元本額	492,758,095,240円
期中追加設定元本額	129,133,229,694円
期中一部解約元本額	35,671,819,599円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	202,805,011円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	971,952,621円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	898,435,500円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,989,476,226円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	4,824,314,296円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	1,553,701,500円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	9,351,376,684円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	10,560,297,621円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	48,017,963円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	133,062,354円
ファンド・マネジャー(海外株式)	779,028円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,037,153,323円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,069,343,457円
eMAXIS バランス(波乗り型)	71,457,942円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,789,090,401円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	220,871,491円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	284,142,446円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	250,960,613円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	97,497,057,377円
海外株式セレクション(ラップ向け)	2,614,800,759円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	5,025,931,684円
つみたて先進国株式	29,060,749,383円
つみたて8資産均等バランス	2,447,142,642円
つみたて4資産均等バランス	857,645,107円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,038,456円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,634,598円

eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,107,353円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	179,927,203円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	224,456,691円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	149,052,595円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	71,567,177円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	529,197,625円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,362,786,820円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	51,627,382,690円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	542,393,919円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	4,188,817,898円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	239,648,420,573円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	138,291,030円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	46,552,234円
つみたて全世界株式	438,003,939円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	63,980,721円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,574,126,480円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	35,820,153円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	1,984,665,165円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	34,104,466円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	416,505円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	31,706,229,002円
eMAXIS 全世界株式インデックス	5,304,252,270円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	466,607,983円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	894,459,137円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	67,254,474円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	543,180,477円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	186,103,151円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	349,563,923円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	85,512,818円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	117,428,440円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	483,648,321円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	388,419,533円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	752,354,547円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,354,262,659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)	2,832円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	5,006,636円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,422,675,398円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	37,924,957円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	679,658,042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)	9,464,646,905円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	67,359円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	539,698,233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)	5,386,909,491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)	64,835,714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)	1,412,040,863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)	437,061,534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)	277,844,461円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	53,655,630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)	1,388,524,353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)	72,019,561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)	2,212,136,676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)	181,237,966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)	7,955,915,634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)	38,045,256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)	114,430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)	2,863,714,985円
海外株式インデックスファンドS	5,300,951,010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)	57,695,472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)	31,191,303円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,862,178,359円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	717,513円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	1,873,942円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	440,846円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,969,355円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	21,856,805円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	788,785円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	6,466,438円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	753,701円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	8,340,679円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,823,903,556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)	87,984,661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)	373,488,046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)	406,226,247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)	416,514,924円
合計	586,219,505,335円
2. 受益権の総数	586,219,505,335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11月12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。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。
	(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)  
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11月12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	97,311,618,234	—	98,782,616,771	1,470,998,537
合計		97,311,618,234	—	98,782,616,771	1,470,998,537

(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11月12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	12,721,818,580	—	12,748,639,883	26,821,303
	カナダドル	566,280,963	—	566,989,684	708,721
	オーストラリアドル	408,271,141	—	406,696,094	△1,575,047
	イギリスポンド	735,110,299	—	733,857,618	△1,252,681
	スイスフラン	475,843,328	—	475,175,560	△667,768
	香港ドル	65,110,422	—	65,318,351	207,929
	シンガポールドル	59,436,336	—	59,426,617	△9,719
	ニュージーランドドル	18,644,890	—	18,636,195	△8,695
	スウェーデンク	145,717,107	—	145,900,759	183,652

	ローネ			
	ノルウェークロ ーネ	33,059,565	—	33,063,240 3,675
	デンマーククロ ーネ	179,205,376	—	179,089,415 △115,961
	ユーロ	1,620,360,516	—	1,619,350,060 △1,010,456
	合計	17,028,858,523	—	17,052,143,476 23,284,953

(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11月12日現在]
1口当たり純資産額	5.7003円
(1万口当たり純資産額)	(57,003円)

## 2【ファンドの現況】

### 【三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）】

#### 【純資産額計算書】

2023年11月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	9,501,241,917
II 負債総額	31,075,161
III 純資産総額 (I - II)	9,470,166,756
IV 発行済口数	3,142,072,888口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.0140
(10,000口当たり)	(30,140)

(参考)

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11月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	788,777,448,469
II 負債総額	18,759,213,612
III 純資産総額 (I - II)	770,018,234,857
IV 発行済口数	602,690,573,630口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.2776
(10,000口当たり)	(12,776)

## TOPIXマザーファンド

### 純資産額計算書

2023年11月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,223,619,822,327
II 負債総額	59,364,852,989
III 純資産総額 (I - II)	1,164,254,969,338
IV 発行済口数	404,480,907,650口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.8784
(10,000口当たり)	(28,784)

## 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11月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	504,532,031,548
II 負債総額	4,023,187,995
III 純資産総額 (I - II)	500,508,843,553
IV 発行済口数	197,701,293,995口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.5316
(10,000口当たり)	(25,316)

## 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11月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	3,452,578,936,972
II 負債総額	16,163,697,129

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,436,415,239,843
Ⅳ 発行済口数	590,981,368,061口
Ⅴ 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	5.8148
（10,000口当たり）	（58,148）

#### 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11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ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、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11月30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	848	28,063,823
追加型公社債投資信託	16	1,558,226
単位型株式投資信託	100	442,223
単位型公社債投資信託	49	94,773
合計	1,013	30,159,044

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

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

# 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）

## 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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本債券インデックスマザーファンド受益証券、TOPIX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および外国株式インデックス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、内外の株式・公社債に直接投資することがあります。

#### (2) 投資態度

主として、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、TOPIX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および外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通して、国内債券・国内株式・外国債券・外国株式への分散投資を行います。

国内債券27%、国内株式40%、外国債券5%、外国株式25%および短期金融商品3%の比率で配分した基本ポートフォリオのもと、個別資産毎におけるパッシブ運用を行い、当社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマークとして、ベンチマークと同程度の投資成果をあげることをめざします。

(注) 当社が独自に指数化する合成インデックスとは、NOMURA-BPI総合インデックス27%、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)40%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)5%、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)25%、無担保コール翌日物レート(短資協会発表)の平均値3%を合成したものです。

長期的な運用環境の動向等により、基本ポートフォリオを見直す場合があります。

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。

株式以外の資産への実質投資割合(信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と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総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合)は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。

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。

#### (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80%未満とします。

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は、信託財産の純資産総額の45%未満とします。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑧外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

### 3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ③収益の分配にあてなか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

### 『三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金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3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第48条第7項、第49条第1項、第50条第1項、第51条第1項、第53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5条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

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

(受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については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8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8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

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を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額(以下「純資産総額」といいます。)を計算日における受益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③ 第28条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

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

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託の受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、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7条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、すでに信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、第7条第1項の規定により分割される受益権について、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と別に定める累積投資契約約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、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 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、前項による受益権の取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。
- ③ 委託者は、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。
- ④ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、

手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円とします。

- ⑤ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑥ 第4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4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12条の2 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12条の3 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

第13条 削除

第14条 削除

第15条 削除

第16条 削除

（投資の対象とする資産の種類等）

第17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条および第23条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18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日本債券インデックスマザーファンド、TOPIXマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンドおよび外国株式インデックスマザーファンド（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. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  22. 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。）
  23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  24. 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、前各号に該当するものを除きます。）
  25. 外国の者に対する権利で前2号の有価証券の性質を有するもの  
なお、第1号の証券または証書ならびに第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. 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。）
  7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
  8. 外国の者に対する権利で前3号の権利の性質を有するもの
- ③ 委託者は、信託財産に属する株式（株式を組入可能な投資信託証券、新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。以下本項および第4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80以上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（マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。）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。

(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54条第2項から第4項の規定を準用することとし、必要な技術的読替えは委託者と受託者の協議にて定めます。

(信用取引の指図範囲)

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

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券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24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。）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(先物取引等の運用指図)

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

- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすること

ができます。

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

(スワップ取引の運用指図)

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

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4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。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第24条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（この信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

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

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第25条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

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

(外貨建資産への投資制限)

第26条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（外貨建資産を組入可能な投資信託証券を含みます。以下本条において同じ。）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との合計額が信託財産の純資産総額の100分の45以上となる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の45以上となった場合には、速やかにこれを調整します。

- 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。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第27条 外貨建価値証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

④ 第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(信託業務の委託等)

第29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（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条において同じ。）を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限り、）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第30条 削除

(混蔵寄託)

第31条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

第32条 削除

(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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- 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5月13日から翌年5月12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」

といひます。)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2001年12月19日から2002年5月13日までとし、最終計算期間の終了日は第4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)

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。

(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」といひます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額は、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37.0以内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(以下「配当等収益」といひます。)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」といひます。)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総口数で除して得た額をいひます。以下同じ。)については第46条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金(第48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ひます。以下同じ。)については第46条第2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。

(収益分配金の再投資)

第45条 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、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、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。

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、別に定める契約に基づき、前項により交付された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10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 収益分配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、

(償還金および一部解約金の支払い)

第46条 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。

② 一部解約金は、第48条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

③ 前各項に規定する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、

④ 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、

(償還金の時効)

第47条 受益者が、信託終了による償還金については前条第1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48条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって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から当該基準価額に0.03%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

④ 信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとし、

⑤ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受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付けを取り消すことができます。

⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受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。

- ⑦ 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。

(信託契約の解約)

第49条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑥ 第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が1ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第50条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- 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54条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第51条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、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54条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第52条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- 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53条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第54条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第54条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第55条 第49条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第49条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第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56条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第57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および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3項および第46条第4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 2006年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条から第16条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

2001年12月19日

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント