

投資信託説明書  
(請求目論見書)

使用開始日 2023.12.27

三菱UFJ バランス・イノベーション  
(株式抑制型) / (株式重視型) / (新興国投資型)  
〈愛称:ファーストラップ(ささえ)〉

追加型投信 / 内外 / 資産複合

この目論見書により行う「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)」、「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)」、「三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)」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6月26日に関東財務局長に提出しており、2023年6月27日に効力が生じております。

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

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

## 目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行（売出）価額の総額】	1
(4)【発行（売出）価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	1
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	2
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	60
第3【ファンドの経理状況】	66
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	354
第三部【委託会社等の情報】	355
第1【委託会社等の概況】	355
約款	386

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）  
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）  
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）  
（以上を総称して、あるいは個別に「ファンド」といいます。）  
愛称として「ファーストラップ（ささえ）」を用いることがあります。

### (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】

各ファンドにつき、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】

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

申込手数料は販売会社にご確認ください。

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

### (6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

### (7)【申込期間】

2023年6月27日から2024年6月24日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と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、各ファンドについて、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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



各ファンドは、世界の株式や債券を主な投資対象とし、投資環境等の変化に合わせて組入比率を変更する投資信託です。

## ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

## ファンドの特色

三菱UFJ バランス・イノベーション  
(株式抑制型)

三菱UFJ バランス・イノベーション  
(株式重視型)

三菱UFJ バランス・イノベーション  
(新興国投資型)

### 投資対象

「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)」、「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)」は、マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。  
「三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)」は、上記に加え、マザーファンドへの投資を通じて、新興国の株式、債券にも実質的な投資を行います。

◆以下、各ファンドを「株式抑制型」、「株式重視型」、「新興国投資型」という場合があります。

### <各ファンドの特徴>

各ファンド	特徴
「株式抑制型」	<ul style="list-style-type: none"> <li>国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドです。</li> <li>国内株式、先進国株式の組入比率を抑えて、比較的安定的な基準価額の上昇をめざすファンドです。</li> </ul>
「株式重視型」	<ul style="list-style-type: none"> <li>国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドで、「株式抑制型」と比較して国内株式、先進国株式の組入比率を高めることが可能です。</li> <li>「株式抑制型」と比較して、株式相場上昇局面における株式の値上がり益の獲得をめざすファンドで、値動きはより大きくなる傾向があります。</li> </ul>
「新興国投資型」	<ul style="list-style-type: none"> <li>国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に加え、新興国の株式・債券にも投資するファンドです。</li> <li>より一層の値上がり益の獲得をめざすファンドで、3つのファンドの中では最も値動きが大きくなる傾向があります。</li> </ul>

1 運用期間、市況動向によっては、上記の傾向とならない場合があります。

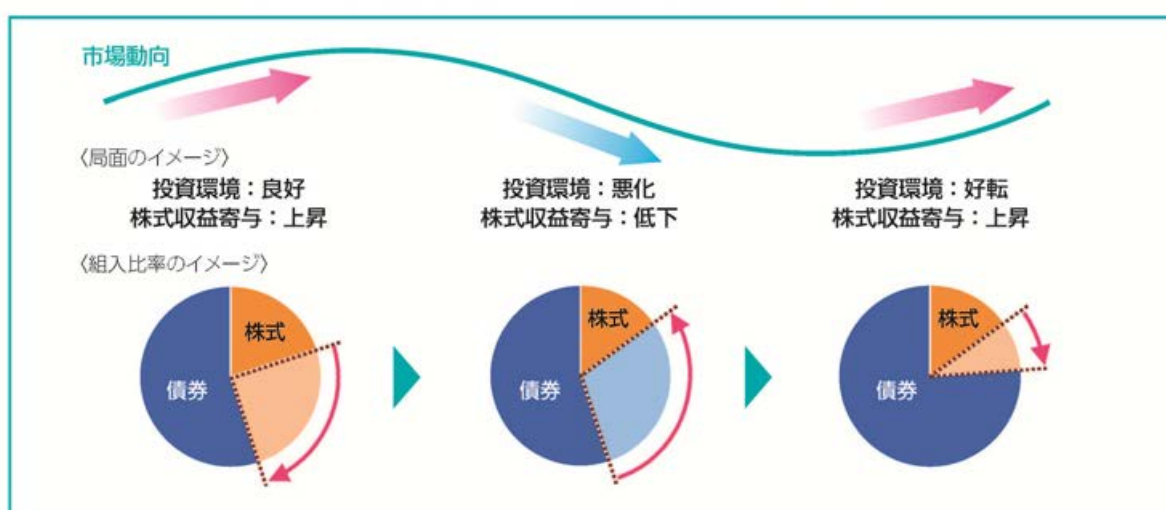
＜各ファンドが投資対象とするマザーファンドと運用目標＞

各ファンド	各マザーファンド	主要投資対象	運用目標
「株式抑制型」 および 「株式重視型」	TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
	外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式 (国内株式を除く)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
	国内債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券 (国内債券を除く)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
	マネー・マーケット・マザーファンド	国内の 短期公社債等	安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。
「新興国投資型」	新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動した投資成果をめざして運用を行います。
	ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ・円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

・「新興国投資型」のみ新興国株式および新興国債券への実質的な投資を行います。

■運用方法・運用プロセス

＜(ご参考)「株式抑制型」の組入比率変更のイメージ＞



❗ 上図はファンドの組入比率の変更をご理解いただくために、「株式抑制型」における組入比率の変更をイメージとして示したものであり、上記と同じ条件での「株式重視型」、「新興国投資型」の組入比率とは異なります。また、各投資環境における組入比率については実際の比率と異なり、投資環境等によっては、株式の組入れを行わない場合があります。

- 各資産の組入比率は以下の範囲で決定します。

#### <各資産の組入比率>

	「株式抑制型」	「株式重視型」	「新興国投資型」
国内株式	0.0%~22.0%	0.0%~42.5%	0.0%~33.0%
先進国株式	0.0%~22.0%	0.0%~42.5%	0.0%~33.0%
新興国株式	投資を行いません	投資を行いません	0.0%~32.0%
国内債券	0.0%~51.0%	0.0%~51.0%	0.0%~32.7%
先進国債券	0.0%~25.0% (原則、25.0%固定とします。)	0.0%~25.0% (原則、13.0%~25.0%とします。)	0.0%~32.7%
新興国債券	投資を行いません	投資を行いません	0.0%~32.7%

❗ 上記以外に短期金融資産を組み入れます。

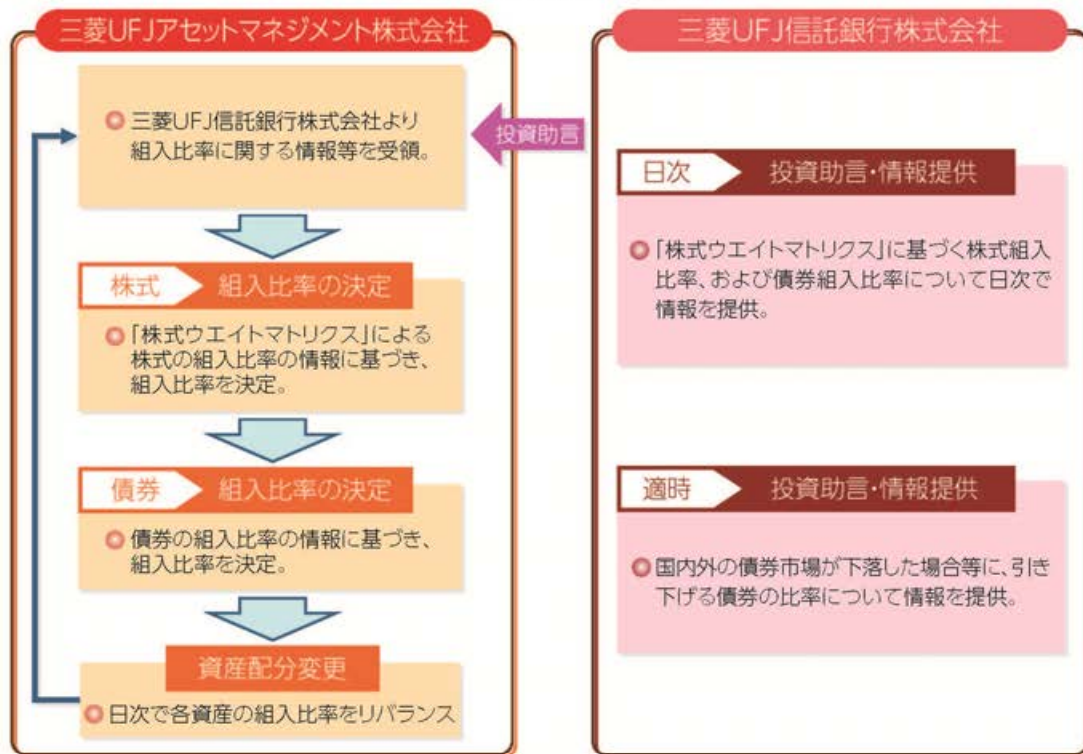
❗ 上記組入比率は、今後、変更となる場合があります。

- 三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、三菱UFJアセットマネジメント株式会社が各ファンドの運用を行います。

❗ 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。

- ファンドの運用プロセスは以下のとおりです。

#### <ファンドの運用プロセス>



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

・ファンドは、年金運用に実績のある三菱UFJ信託銀行株式会社による助言をもとに運営します。なお、ファンドのベースとなっている「下方リスク抑制バランス」は、内外株式下落による損失回避と中期的な収益確保をめざし、機動的に投資比率をコントロールする運用商品であり、三菱UFJ信託銀行株式会社が三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)のサポートを受け、独自に開発したモデルに基づく運用手法で年金顧客向けに提供されております。

- 株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウェイトマトリクス」を活用します。
- ◆ 「投資環境」は、株式市場や景気の方角性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。なお、「新興国投資型」は上記各指標に加え、新興国通貨の下落率を活用した指標も用います。
- ◆ 「株式部分の収益寄与」は、過去の株式の収益率に組入比率を勘案して算出します。
- ❗ 「株式ウェイトマトリクス」は、各ファンドごとおよび各資産(国内株式、先進国株式、新興国株式)ごとに異なります。また、「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。

### <株式ウェイトマトリクスのイメージ>



❗ 上記の株式ウェイトマトリクスはイメージであり、実際の運用に用いるものとは異なる場合があります。

- 「株式抑制型」は、株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、残りは国内債券等に投資します。  
「株式重視型」は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りは国内債券等に投資します。  
「新興国投資型」は、株式部分以外への投資については、国内債券、先進国債券、新興国債券の組入比率が均等になるよう投資を行います。
- なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。  
(<https://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>)

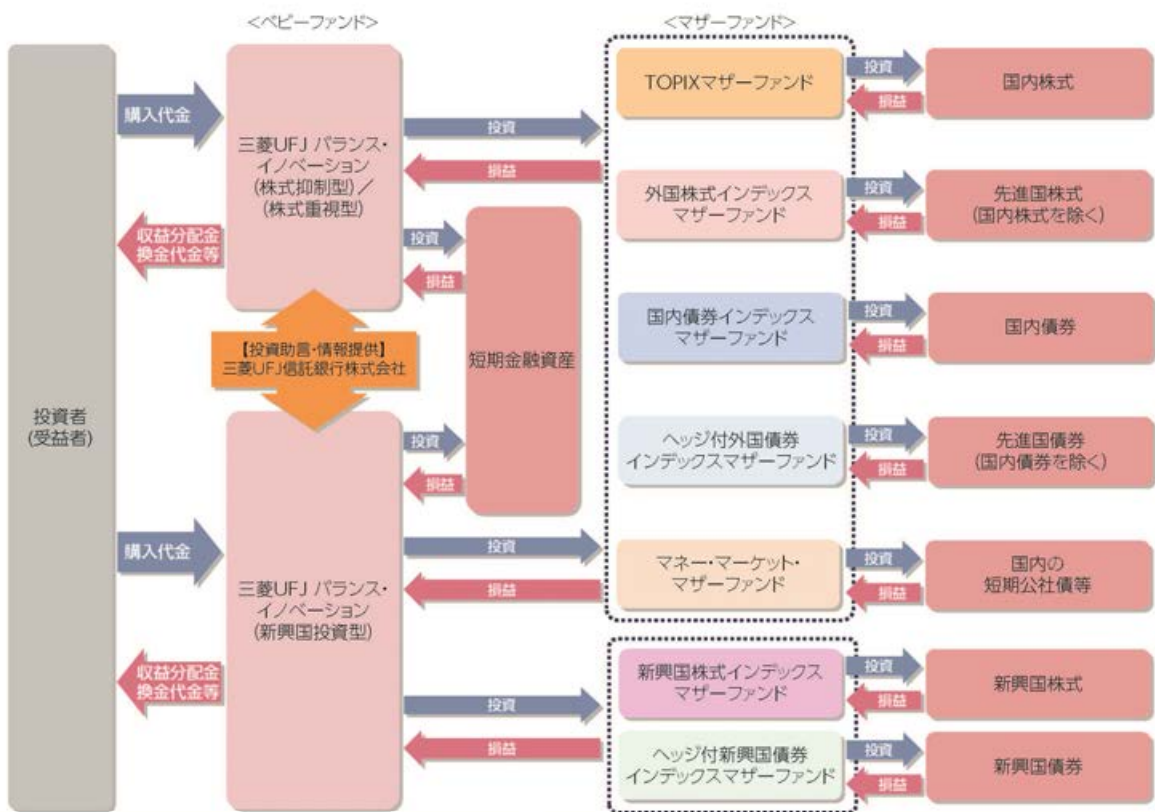


実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

- 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
  - その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないため、各ファンドは為替相場の変動による影響を受けます。
- ❗ 為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当以上のヘッジコストとなる場合があります。

## ■ ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンド等への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および国内の短期金融資産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。



- ❗ スイッチングの取扱いについては、スイッチングの取扱いを行わない販売会社もあるため、詳しくは、販売会社にご確認下さい。
- ❗ スイッチングの際の購入時手数料は、販売会社が定めるものとします。また、換金するファンドに対して税金がかかります。

## 分配方針

年1回の決算時(3月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■主な投資制限

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



## 指数について

- ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。  
MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。  
MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。  
MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。  
MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ・NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ・JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(米ドルベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している流動性の高い米ドル建ての新興国国債のパフォーマンスを表す代表的な指数です。JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ・円換算ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。  
JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスの著作権は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。

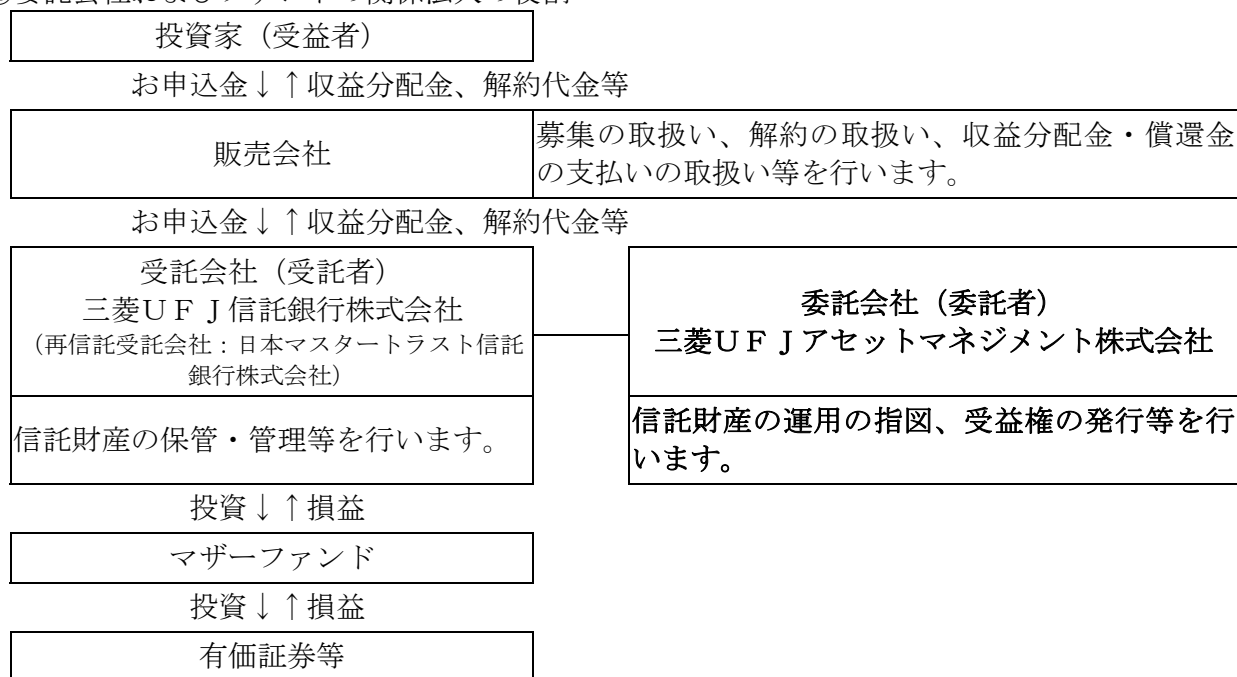
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

- 2013年10月25日 設定日、信託契約締結、運用開始
- 2020年6月25日 ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」を追加
- 2020年12月25日 ファンドの投資対象から「日本債券インデックスマザーファンド」を削除
- 2021年12月25日 信託期間を2023年3月24日までから2028年3月24日までに変更

(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



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10月1日現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社

2005年10月	が合併、商号を三菱投信株式会社に変更 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】

#### 「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

株式の実質組入比率は、株式組入れを比較的抑えつつ、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、原則として、先進国債券を一定の比率とし、残りの部分は国内債券等を組入れます。

国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### 「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りの部分は国内債券等を組入れます。

国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。



「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、原則として、国内債券、先進国債券および新興国債券を均等とします。

国内外の債券市場が下落した場合等に債券への実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

<ファンド共通>

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

### TOPIXマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑤外貨建資産への投資は行いません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

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

### 外国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

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

・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

(投資制限)

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

国内債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資は行いません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

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

③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

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

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

⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑩金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑪外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑫デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

マネー・マーケット・マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

②投資態度

わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。

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株式への投資は行いません。

②外貨建資産への投資は行いません。

③有価証券先物取引等を行うことができます。

④スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑤金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

⑥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減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

新興国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、M S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）と

連動した投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

⑤有価証券先物取引等を行うことができます。

⑥スワップ取引を行うことができます。

⑦金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

⑧外国為替予約取引を行うことができます。

⑨デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ・円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

新興国の米ドル建ての公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

新興国の米ドル建ての公社債を主要投資対象とし、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ・円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

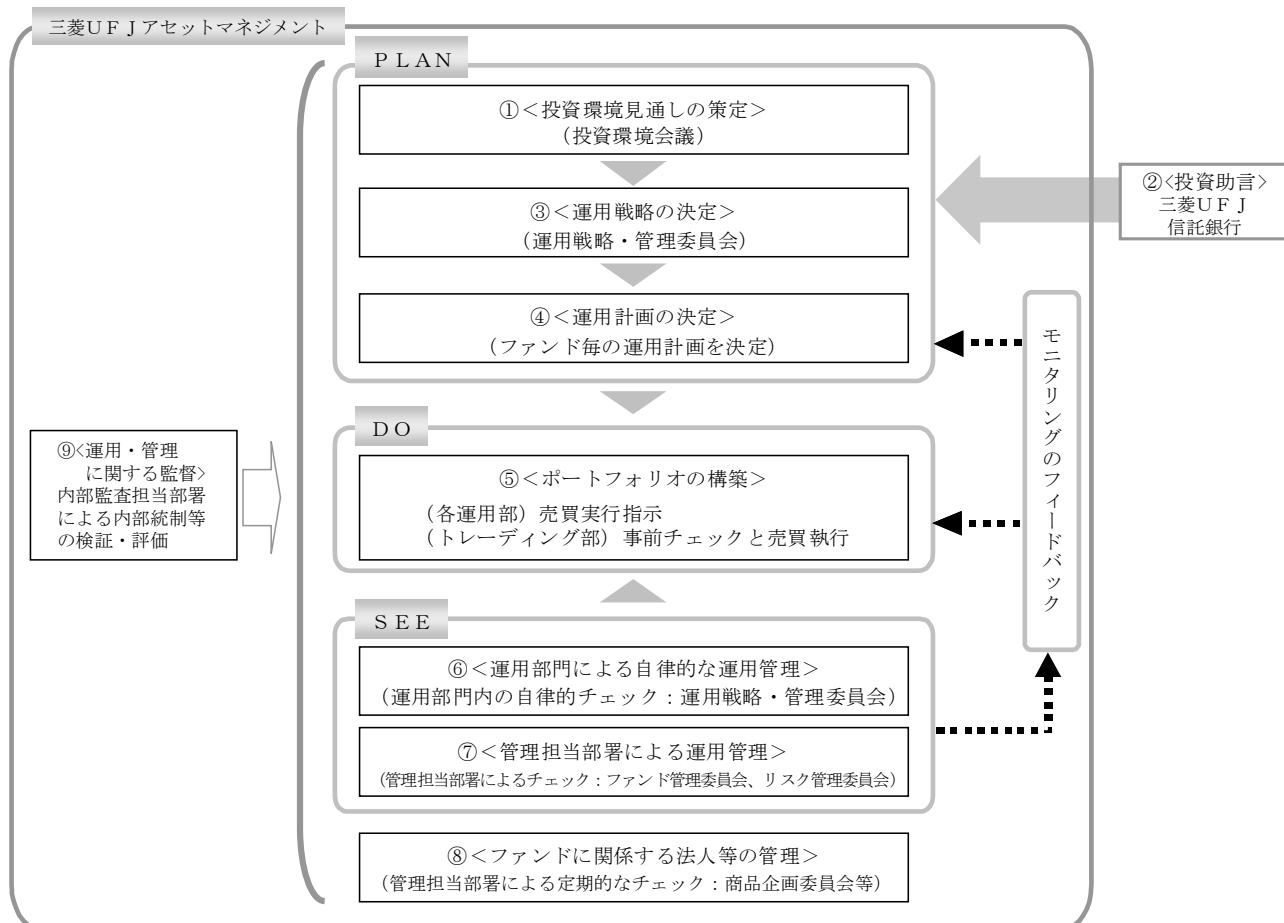
⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。
- ⑩金利先渡し取引および為替先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑫デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(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ファンドに關係する法人等の管理

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ③収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5)【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 委託会社は、信託財産に屬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屬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屬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屬するとみなした額とは、信託財産に屬するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

②投資信託証券

- a. 委託会社は、信託財産に屬する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下a. およびb. において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に屬する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に屬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屬するとみなした額とは、信託財産に屬するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を



乗じて得た額とします。

### ③同一銘柄の転換社債等

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

### ④スワップ取引

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

### ⑤信用取引

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

### ⑥外国為替予約取引

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

### ⑦有価証券の借入れ

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

ます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

#### ⑧資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

#### ⑨投資する株式等の範囲

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

#### ⑩金利先渡取引および為替先渡取引

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

#### ⑪有価証券の貸付

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

#### ⑫有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または⑦の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該

売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

#### ⑬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。

#### ⑭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。

#### ⑮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

組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。しかし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。そのため、為替相場の変動によっては、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。

なお、為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分がヘッジコストとなります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

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

### ⑤カントリーリスク

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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

## ※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。

## (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

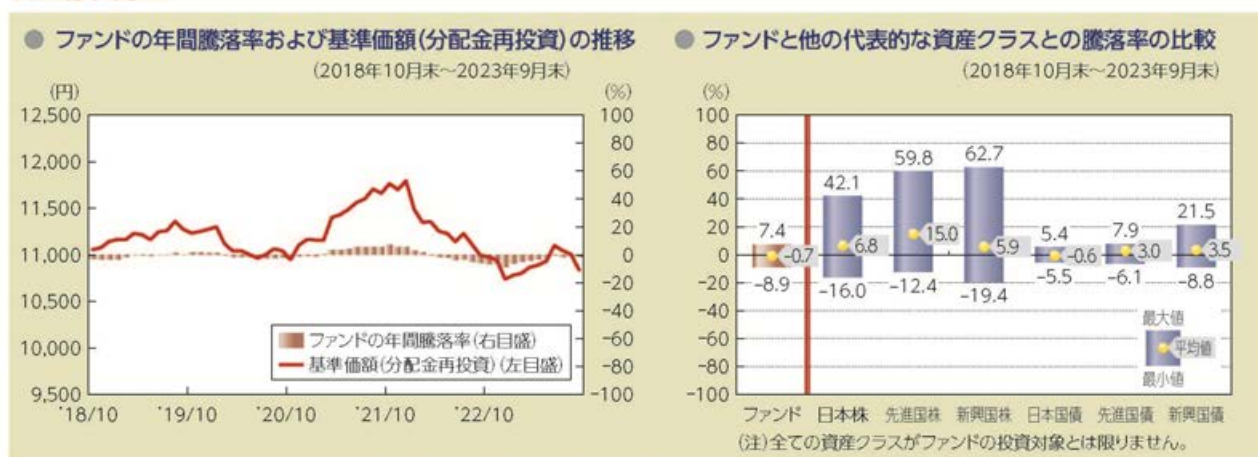
委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

\*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

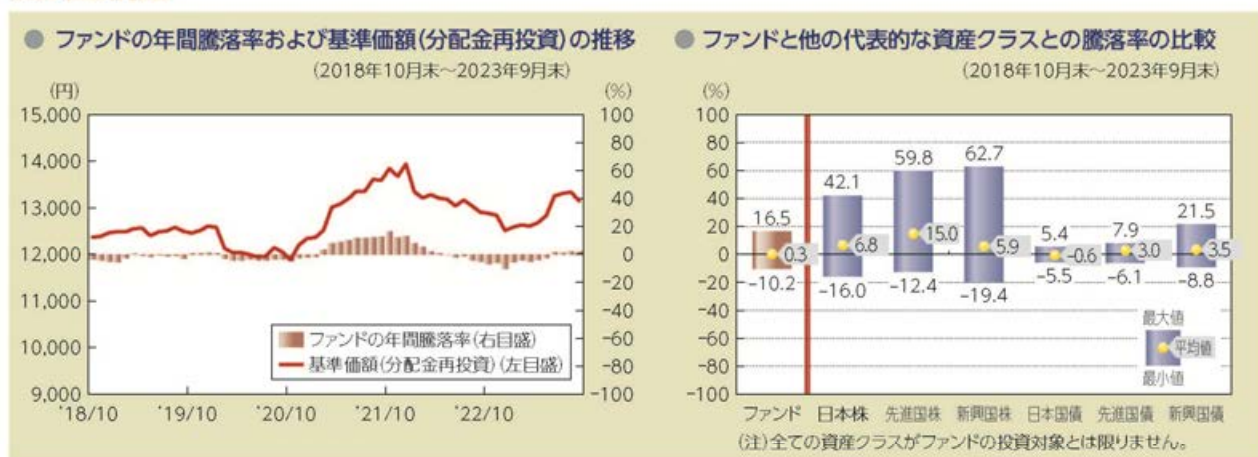
下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

株式抑制型



- 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ものとして計算しており、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。

株式重視型



- 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ものとして計算しており、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。

## 新興国投資型

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

(2018年10月末～2023年9月末)



### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2018年10月末～2023年9月末)



(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

- 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で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

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

申込手数料は販売会社にご確認ください。

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

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

##### (2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

##### (3) 【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年 1.43%（税抜 1.3%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の 6 ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.75%	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	0.5%	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、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

##### ①個人の受益者に対する課税

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

##### 1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

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

##### 2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

上記は2023年12月末までの制度となります。

※2024年1月1日以降、NISAの拡充・恒久化が図られ、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### ②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※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9月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5 【運用状況】

### 【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

#### （1）【投資状況】

2023年9月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	17,599,806,972	97.58
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	435,838,134	2.42
純資産総額		18,035,645,106	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9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックスマザーファンド	6,661,131,184	0.9408	6,267,107,946	0.9239	6,154,219,100	34.12
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	4,135,680,137	1.1649	4,817,653,791	1.0852	4,488,040,084	24.88
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	1,393,248,220	2.6727	3,723,734,518	2.8145	3,921,297,115	21.74
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	544,189,460	5.3913	2,933,888,636	5.5794	3,036,250,673	16.83

(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9月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.58
合計	97.58

(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9月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2014年3月25日)	941,919,658	941,919,658	10,168	10,168
第2計算期間末日 (2015年3月25日)	21,743,970,931	21,743,970,931	11,001	11,001
第3計算期間末日 (2016年3月25日)	52,322,002,817	52,322,002,817	10,915	10,915
第4計算期間末日 (2017年3月27日)	46,411,260,274	46,411,260,274	10,781	10,781
第5計算期間末日 (2018年3月26日)	27,872,022,932	27,872,022,932	11,124	11,124
第6計算期間末日 (2019年3月25日)	30,377,735,462	30,377,735,462	11,215	11,215
第7計算期間末日 (2020年3月25日)	28,457,787,754	28,457,787,754	11,015	11,015
第8計算期間末日 (2021年3月25日)	25,856,771,935	25,856,771,935	11,347	11,347
第9計算期間末日 (2022年3月25日)	21,812,432,808	21,812,432,808	11,322	11,322
第10計算期間末日 (2023年3月27日)	19,195,691,228	19,195,691,228	10,819	10,819
2022年9月末日	20,240,873,158	—	10,996	—
10月末日	20,076,004,961	—	10,977	—
11月末日	19,894,613,716	—	10,945	—
12月末日	19,405,518,548	—	10,740	—
2023年1月末日	19,379,366,670	—	10,780	—
2月末日	19,329,450,155	—	10,802	—
3月末日	19,225,091,223	—	10,866	—

4 月末日	19,083,536,233	—	10,889	—
5 月末日	18,952,425,326	—	10,931	—
6 月末日	18,915,674,201	—	11,100	—
7 月末日	18,729,479,938	—	11,045	—
8 月末日	18,499,955,620	—	11,006	—
9 月末日	18,035,645,106	—	10,837	—

## ②【分配の推移】

	1 万口当たりの分配金
第 1 計算期間	0 円
第 2 計算期間	0 円
第 3 計算期間	0 円
第 4 計算期間	0 円
第 5 計算期間	0 円
第 6 計算期間	0 円
第 7 計算期間	0 円
第 8 計算期間	0 円
第 9 計算期間	0 円
第 10 計算期間	0 円

## ③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 1 計算期間	1.68
第 2 計算期間	8.19
第 3 計算期間	△0.78
第 4 計算期間	△1.22
第 5 計算期間	3.18
第 6 計算期間	0.81
第 7 計算期間	△1.78
第 8 計算期間	3.01
第 9 計算期間	△0.22
第 10 計算期間	△4.44
第 11 中間計算期間	0.55

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

## (4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第 1 計算期間	941,256,105	14,895,373	926,360,732

第2計算期間	21,162,714,048	2,322,836,403	19,766,238,377
第3計算期間	35,213,444,969	7,042,824,390	47,936,858,956
第4計算期間	14,107,298,059	18,996,501,741	43,047,655,274
第5計算期間	4,023,376,097	22,015,232,045	25,055,799,326
第6計算期間	5,274,825,327	3,244,462,370	27,086,162,283
第7計算期間	1,987,264,985	3,238,817,169	25,834,610,099
第8計算期間	525,345,517	3,573,208,348	22,786,747,268
第9計算期間	519,013,721	4,040,116,658	19,265,644,331
第10計算期間	66,798,497	1,589,190,634	17,743,252,194
第11中間計算期間	13,112,251	1,102,342,631	16,654,021,814

【三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)】

(1) 【投資状況】

2023年9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	19,271,258,411	98.11
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	372,084,820	1.89
純資産総額		19,643,343,231	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9月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	2,946,466,972	2.6364	7,768,065,525	2.8145	8,292,831,292	42.22
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	1,209,850,904	5.3420	6,463,048,947	5.5794	6,750,242,133	34.36
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	3,896,226,490	1.1327	4,413,526,060	1.0852	4,228,184,986	21.52

(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9月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.11
合計	98.11

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

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9月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2014年3月25日)	1,343,219,066	1,343,219,066	10,292	10,292
第2計算期間末日 (2015年3月25日)	24,655,190,688	24,655,190,688	11,765	11,765
第3計算期間末日 (2016年3月25日)	61,738,348,442	61,738,348,442	11,488	11,488
第4計算期間末日 (2017年3月27日)	43,553,330,759	43,553,330,759	11,535	11,535
第5計算期間末日 (2018年3月26日)	27,531,362,672	27,531,362,672	12,321	12,321
第6計算期間末日 (2019年3月25日)	31,437,259,282	31,437,259,282	12,534	12,534
第7計算期間末日 (2020年3月25日)	28,750,760,854	28,750,760,854	12,010	12,010
第8計算期間末日 (2021年3月25日)	26,855,099,280	26,855,099,280	12,862	12,862
第9計算期間末日 (2022年3月25日)	22,691,860,863	22,691,860,863	13,219	13,219
第10計算期間末日 (2023年3月27日)	19,985,923,195	19,985,923,195	12,488	12,488
2022年9月末日	21,311,754,248	—	12,907	—
10月末日	21,209,849,447	—	12,884	—
11月末日	20,985,444,188	—	12,838	—
12月末日	20,272,332,491	—	12,515	—
2023年1月末日	20,325,573,718	—	12,586	—
2月末日	20,321,055,346	—	12,635	—
3月末日	20,157,372,519	—	12,608	—
4月末日	20,065,665,781	—	12,683	—
5月末日	20,029,984,646	—	12,830	—
6月末日	20,314,175,095	—	13,256	—
7月末日	20,186,118,447	—	13,310	—
8月末日	20,093,289,314	—	13,338	—
9月末日	19,643,343,231	—	13,151	—

②【分配の推移】

	1 万口当たりの分配金
第 1 計算期間	0 円
第 2 計算期間	0 円
第 3 計算期間	0 円
第 4 計算期間	0 円
第 5 計算期間	0 円
第 6 計算期間	0 円
第 7 計算期間	0 円
第 8 計算期間	0 円
第 9 計算期間	0 円
第 10 計算期間	0 円

### ③ 【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 1 計算期間	2.92
第 2 計算期間	14.31
第 3 計算期間	△2.35
第 4 計算期間	0.40
第 5 計算期間	6.81
第 6 計算期間	1.72
第 7 計算期間	△4.18
第 8 計算期間	7.09
第 9 計算期間	2.77
第 10 計算期間	△5.52
第 11 中間計算期間	5.77

(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 1 計算期間	1,311,088,736	5,967,768	1,305,120,968
第 2 計算期間	25,095,132,460	5,444,511,240	20,955,742,188
第 3 計算期間	43,638,216,569	10,852,980,012	53,740,978,745
第 4 計算期間	5,975,078,368	21,959,271,960	37,756,785,153
第 5 計算期間	5,921,593,950	21,334,148,864	22,344,230,239
第 6 計算期間	5,496,470,932	2,758,727,653	25,081,973,518
第 7 計算期間	2,340,829,162	3,484,699,835	23,938,102,845
第 8 計算期間	424,139,994	3,482,947,344	20,879,295,495
第 9 計算期間	528,655,909	4,242,306,956	17,165,644,448
第 10 計算期間	255,946,355	1,417,067,402	16,004,523,401

第 11 中間計算期間	66,969,048	1,116,942,763	14,954,549,686
-------------	------------	---------------	----------------

【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

(1) 【投資状況】

2023年9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	3,793,475,628	87.12
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	561,030,327	12.88
純資産総額		4,354,505,955	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9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	491,557,811	2.6661	1,310,542,280	2.8145	1,383,489,459	31.77
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	549,583,153	1.0989	603,988,168	1.0852	596,407,637	13.70
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド	706,946,953	0.8515	601,981,501	0.8344	589,876,537	13.55
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックスマザーファンド	525,888,821	0.9290	488,567,976	0.9239	485,868,681	11.16
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	85,593,158	5.2970	453,386,958	5.5794	477,558,465	10.97
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	78,348,841	3.3544	262,813,353	3.3220	260,274,849	5.98

(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9月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	87.12
合計	87.12

(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9月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (2014年3月25日)	125,120,227	125,120,227	10,035	10,035
第2計算期間末日 (2015年3月25日)	1,066,640,671	1,066,640,671	10,816	10,816
第3計算期間末日 (2016年3月25日)	1,296,388,956	1,296,388,956	10,811	10,811
第4計算期間末日 (2017年3月27日)	1,185,983,561	1,185,983,561	11,276	11,276
第5計算期間末日 (2018年3月26日)	8,838,464,673	8,838,464,673	12,488	12,488
第6計算期間末日 (2019年3月25日)	9,471,549,757	9,471,549,757	12,185	12,185
第7計算期間末日 (2020年3月25日)	8,417,184,461	8,417,184,461	11,099	11,099
第8計算期間末日 (2021年3月25日)	7,842,260,783	7,842,260,783	12,768	12,768
第9計算期間末日 (2022年3月25日)	5,200,930,166	5,200,930,166	12,033	12,033
第10計算期間末日 (2023年3月27日)	4,350,134,203	4,350,134,203	11,131	11,131
2022年9月末日	4,628,091,115	—	11,307	—
10月末日	4,595,276,073	—	11,291	—
11月末日	4,651,109,049	—	11,517	—
12月末日	4,509,247,274	—	11,280	—
2023年1月末日	4,567,640,328	—	11,482	—
2月末日	4,484,389,861	—	11,373	—
3月末日	4,390,105,671	—	11,238	—
4月末日	4,362,645,640	—	11,234	—
5月末日	4,350,866,718	—	11,316	—
6月末日	4,484,912,742	—	11,765	—
7月末日	4,500,868,645	—	11,879	—
8月末日	4,474,707,863	—	11,863	—
9月末日	4,354,505,955	—	11,640	—

② 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円



第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円

### ③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	0.35
第2計算期間	7.78
第3計算期間	△0.04
第4計算期間	4.30
第5計算期間	10.74
第6計算期間	△2.42
第7計算期間	△8.91
第8計算期間	15.03
第9計算期間	△5.75
第10計算期間	△7.49
第11中間計算期間	5.16

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

### (4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	128,985,856	4,305,586	124,680,270
第2計算期間	1,152,904,287	291,375,437	986,209,120
第3計算期間	551,196,595	338,236,484	1,199,169,231
第4計算期間	468,990,819	616,395,704	1,051,764,346
第5計算期間	7,312,217,505	1,286,533,821	7,077,448,030
第6計算期間	1,589,895,766	894,060,789	7,773,283,007
第7計算期間	619,203,622	808,866,213	7,583,620,416
第8計算期間	97,832,324	1,539,250,882	6,142,201,858
第9計算期間	79,829,486	1,899,825,819	4,322,205,525
第10計算期間	31,065,353	445,103,881	3,908,166,997
第11中間計算期間	8,872,708	176,032,719	3,741,006,986

(参考)

投資状況

2023年9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	1,137,984,604,510	98.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	23,238,179,214	2.00
純資産総額		1,161,222,783,724	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9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	15,451,275,000	1.33

(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9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	18,972,900	1,856.95	35,231,875,956	2,677.50	50,799,939,750	4.37
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,444,200	11,665.98	28,513,999,531	12,240.00	29,917,008,000	2.58
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	21,312,300	857.68	18,279,237,978	1,268.50	27,034,652,550	2.33
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	111,011,000	160.55	17,823,528,816	176.60	19,604,542,600	1.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	345,700	62,411.38	21,575,617,192	55,500.00	19,186,350,000	1.65
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,418,500	5,293.20	12,801,612,599	7,347.00	17,768,719,500	1.53
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,228,900	4,908.15	10,939,778,024	7,128.00	15,887,599,200	1.37
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,697,000	7,259.91	12,320,081,512	9,275.00	15,739,675,000	1.36
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	731,300	16,679.27	12,197,555,892	20,440.00	14,947,772,000	1.29
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,066,900	4,328.17	13,274,069,143	4,641.00	14,233,482,900	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	8,426,100	1,175.88	9,908,141,348	1,682.00	14,172,700,200	1.22
日本	株式	三井物産	卸売業	2,557,200	3,964.94	10,139,164,970	5,423.00	13,867,695,600	1.19
日本	株式	任天堂	その他製品	2,181,500	5,243.75	11,439,252,632	6,230.00	13,590,745,000	1.17
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,921,500	1,900.26	9,352,175,766	2,541.00	12,505,531,500	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	2,877,000	4,236.45	12,188,274,120	4,343.00	12,494,811,000	1.08
日本	株式	第一三共	医薬品	3,019,000	4,671.83	14,104,275,000	4,106.00	12,396,014,000	1.07

日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,677,900	4,128.69	11,056,241,237	4,577.00	12,256,748,300	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,252,700	4,345.07	9,788,140,916	5,406.00	12,178,096,200	1.05
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,629,700	3,828.54	10,067,934,953	4,609.00	12,120,287,300	1.04
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,363,700	2,614.77	8,795,311,791	3,465.00	11,655,220,500	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	732,000	14,265.81	10,442,576,676	15,325.00	11,217,900,000	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,709,500	5,140.48	8,787,657,500	6,335.00	10,829,682,500	0.93
日本	株式	ダイキン工業	機械	416,600	23,559.25	9,814,786,411	23,475.00	9,779,685,000	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	5,570,700	1,557.12	8,674,289,306	1,690.50	9,417,268,350	0.81
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,879,700	4,499.99	8,458,633,048	4,909.00	9,227,447,300	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,143,700	2,617.11	8,227,416,810	2,734.00	8,594,875,800	0.74
日本	株式	SMC	機械	113,200	69,273.72	7,841,786,080	66,980.00	7,582,136,000	0.65
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,259,900	5,881.08	7,409,575,204	5,855.00	7,376,714,500	0.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,067,400	2,791.80	5,771,787,632	3,440.00	7,111,856,000	0.61
日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	4,121,900	1,211.34	4,993,035,280	1,682.00	6,933,035,800	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9月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.40
	建設業	2.10
	食料品	3.33
	繊維製品	0.41
	パルプ・紙	0.18
	化学	5.67
	医薬品	5.00
	石油・石炭製品	0.49
	ゴム製品	0.70
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.99
	非鉄金属	0.65
	金属製品	0.50
	機械	5.23
	電気機器	16.34
	輸送用機器	8.67
	精密機器	2.24
	その他製品	2.20
	電気・ガス業	1.37

	陸運業	2.86
	海運業	0.66
	空運業	0.47
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.91
	卸売業	6.65
	小売業	4.24
	銀行業	6.99
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.39
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.90
	サービス業	4.61
	小計	98.00
合計		98.00

(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。

#### 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9月29日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 23年12月限	買建	665	円	15,684,595,750	15,451,275,000	1.33

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

#### 外国株式インデックスマザーファンド

#### 投資状況

2023年9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	アメリカ	2,232,545,422,164	71.28
	イギリス	134,196,102,826	4.28
	カナダ	104,413,396,554	3.33
	フランス	96,517,832,085	3.08
	スイス	88,279,865,014	2.82
	ドイツ	72,306,393,635	2.31
	オーストラリア	60,867,254,722	1.94
	オランダ	50,729,736,658	1.62

	デンマーク	28,596,236,354	0.91
	スウェーデン	27,346,995,278	0.87
	スペイン	22,658,409,026	0.72
	香港	18,363,464,670	0.59
	イタリア	16,524,201,645	0.53
	シンガポール	10,215,844,364	0.33
	フィンランド	7,614,065,904	0.24
	ベルギー	6,636,053,529	0.21
	ノルウェー	6,234,369,424	0.20
	アイルランド	4,765,211,703	0.15
	イスラエル	3,402,598,782	0.11
	オーストリア	1,672,156,876	0.05
	ニュージーランド	1,660,159,741	0.05
	ルクセンブルグ	1,648,082,183	0.05
	ポルトガル	1,605,363,708	0.05
	小計	2,998,799,216,845	95.74
投資証券	アメリカ	51,038,671,070	1.63
	オーストラリア	3,566,115,990	0.11
	シンガポール	1,246,708,418	0.04
	フランス	1,080,116,822	0.03
	イギリス	867,920,601	0.03
	香港	705,549,608	0.02
	カナダ	297,170,347	0.01
	ベルギー	255,973,752	0.01
	小計	59,058,226,608	1.89
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	74,294,737,327	2.37
純資産総額		3,132,152,180,780	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9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	59,787,219,487	1.91
	買建	カナダ	2,874,079,516	0.09
	買建	ドイツ	9,790,476,320	0.31
	買建	オーストラリア	2,337,082,164	0.07
	買建	イギリス	3,687,098,698	0.12
	買建	スイス	2,202,164,177	0.07

(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9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,287,334	26,223.62	164,876,659,833	25,531.81	160,527,018,352	5.13
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2,823,327	46,781.78	132,080,284,142	46,914.27	132,454,328,564	4.23
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	3,691,361	17,157.60	63,334,905,265	18,844.08	69,560,333,000	2.22
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	987,425	45,593.62	45,020,289,069	64,452.52	63,642,035,683	2.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	2,373,602	17,652.61	41,900,278,310	19,790.92	46,975,790,555	1.50
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	2,114,297	17,710.83	37,445,972,940	19,913.58	42,103,233,870	1.34
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,140,272	27,596.52	31,467,544,150	36,853.52	42,023,037,414	1.34
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	884,258	36,399.93	32,186,929,531	45,466.33	40,203,972,046	1.28
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1,614,445	15,877.13	25,632,764,762	17,870.32	28,850,652,970	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	371,819	73,099.87	27,179,921,836	76,300.75	28,370,071,539	0.91
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	517,751	48,789.88	25,261,009,481	53,409.03	27,652,581,177	0.88
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	322,518	66,311.73	21,386,728,732	81,438.83	26,265,488,896	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,168,319	20,553.37	24,012,902,969	22,076.51	25,792,408,657	0.82
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	962,197	24,146.05	23,233,258,980	23,466.11	22,579,021,029	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	646,843	34,691.87	22,440,196,438	34,651.70	22,414,211,394	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	941,875	23,079.41	21,737,921,504	21,889.53	20,617,207,850	0.66
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	165,020	98,305.60	16,222,391,538	124,450.55	20,536,831,411	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	338,256	57,553.65	19,467,870,398	59,748.23	20,210,199,046	0.65

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	724,356	23,447.06	16,984,025,108	25,516.85	18,483,284,992	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービ流通・小売り	401,968	43,643.21	17,543,177,009	45,396.03	18,247,753,075	0.58
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,067,157	18,642.73	19,894,721,253	16,820.03	17,949,617,023	0.57
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,283,454	12,251.28	15,723,959,958	13,805.28	17,718,448,255	0.57
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	705,314	21,886.19	15,436,640,337	22,773.55	16,062,507,171	0.51
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	1,014,150	17,422.09	17,668,618,305	15,601.19	15,821,950,895	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	177,058	75,862.51	13,432,065,657	85,055.67	15,059,787,775	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	591,934	23,006.59	13,618,384,359	24,312.73	14,391,533,414	0.46
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	161,204	94,534.76	15,239,381,517	87,026.40	14,029,003,786	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	549,843	28,993.82	15,942,049,353	25,353.81	13,940,614,952	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	182,047	54,238.19	9,873,899,941	75,488.53	13,742,461,987	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	1,640,790	9,489.11	15,569,649,757	8,348.05	13,697,413,039	0.44

(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9月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	5.46
	素材	3.94
	資本財	6.50
	商業・専門サービス	1.54
	運輸	1.78
	自動車・自動車部品	2.17
	耐久消費財・アパレル	1.47
	消費者サービス	2.05
	メディア・娯楽	6.03

	一般消費財・サービス流通・小売り	4.31
	生活必需品流通・小売り	1.69
	食品・飲料・タバコ	3.71
	家庭用品・パーソナル用品	1.69
	ヘルスケア機器・サービス	4.42
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.43
	銀行	5.26
	金融サービス	6.44
	保険	3.10
	ソフトウェア・サービス	9.20
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.59
	電気通信サービス	1.15
	公益事業	2.64
	半導体・半導体製造装置	5.84
	不動産管理・開発	0.33
	小計	95.74
投資証券	—	1.89
合計		97.63

(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9月29日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額 (円)	評価金額	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2312	買建	1,843	アメリカドル	411,834,843.44	61,602,255,881	399,700,625	59,787,219,487	1.91
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602312	買建	110	カナダドル	26,564,382.5	2,941,739,718	25,953,400	2,874,079,516	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2312	買建	1,481	ユーロ	62,892,802.83	9,937,062,847	61,965,040	9,790,476,320	0.31
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2312	買建	138	オーストラリアドル	25,042,879.5	2,405,619,005	24,329,400	2,337,082,164	0.07
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2312	買建	264	イギリスポンド	20,329,210	3,710,690,701	20,199,960	3,687,098,698	0.12
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2312	買建	123	スイスフラン	13,619,167.55	2,226,189,127	13,472,190	2,202,164,177	0.07

(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。



## 投資状況

2023年9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	香港	109,510,852,019	21.30
	インド	77,629,939,543	15.10
	台湾	72,866,520,168	14.17
	韓国	60,349,359,563	11.74
	ブラジル	26,423,022,291	5.14
	中国	23,752,373,924	4.62
	サウジアラビア	20,531,696,879	3.99
	南アフリカ	14,785,787,074	2.88
	アメリカ	13,727,053,313	2.67
	メキシコ	11,876,417,165	2.31
	インドネシア	9,829,212,115	1.91
	タイ	9,281,906,122	1.81
	マレーシア	6,990,591,709	1.36
	アラブ首長国連邦	6,751,781,285	1.31
	カタール	4,584,169,912	0.89
	クウェート	4,092,628,732	0.80
	トルコ	3,704,065,428	0.72
	ポーランド	3,663,605,327	0.71
	フィリピン	3,132,369,149	0.61
	チリ	2,436,902,840	0.47
	ギリシャ	2,204,938,528	0.43
	ハンガリー	1,178,779,812	0.23
	チェコ	827,625,680	0.16
	コロンビア	497,172,874	0.10
小計		490,628,771,452	95.43
投資証券	メキシコ	446,703,427	0.09
	南アフリカ	135,653,404	0.03
	小計	582,356,831	0.11
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	22,923,293,200	4.46
純資産総額		514,134,421,483	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9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	23,796,794,385	4.63

(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9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	12,498,000	2,350.76	29,379,859,505	2,424.05	30,295,810,645	5.89
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3,401,400	6,260.36	21,293,990,986	5,683.31	19,331,224,240	3.76
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,423,049	7,220.19	17,494,896,152	7,599.24	18,413,330,883	3.58
香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	8,331,400	1,590.55	13,251,586,923	1,586.13	13,214,683,482	2.57
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1,543,866	4,121.07	6,362,383,818	4,224.72	6,522,403,111	1.27
香港	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	2,573,120	2,457.47	6,323,380,077	2,117.38	5,448,293,411	1.06
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	2,620,166	1,703.43	4,463,282,120	1,706.10	4,470,280,934	0.87
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	1,685,989	2,302.18	3,881,459,801	2,605.40	4,392,683,328	0.85
アメリカ	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	303,337	10,745.09	3,259,384,338	14,301.34	4,338,126,724	0.84
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	48,278,550	102.24	4,936,202,803	83.31	4,022,549,475	0.78
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	1,412,319	2,971.95	4,197,346,695	2,757.89	3,895,030,333	0.76
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	277,278	10,023.49	2,779,294,157	12,743.16	3,533,400,691	0.69
ブラジル	株式	VALE SA	素材	1,729,729	2,018.22	3,490,984,212	1,980.30	3,425,387,511	0.67
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,311,272	488.24	3,081,446,069	482.02	3,042,219,918	0.59
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	462,807	5,951.90	2,754,581,637	6,401.51	2,962,667,110	0.58
香港	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	982,195	2,690.04	2,642,151,279	2,889.43	2,837,985,663	0.55
香港	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	1,147,074	2,254.86	2,586,492,371	2,461.36	2,823,371,237	0.55

香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	3,312,500	1,085.20	3,594,756,040	840.84	2,785,282,500	0.54
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	991,254	3,003.58	2,977,314,318	2,712.60	2,688,880,557	0.52
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	771,236	3,076.33	2,372,583,835	3,406.65	2,627,332,276	0.51
香港	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	1,191,033	2,595.10	3,090,854,859	2,123.12	2,528,707,174	0.49
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	415,364	6,198.04	2,574,446,082	6,054.95	2,515,008,252	0.49
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	2,419,200	771.36	1,866,078,082	1,022.81	2,474,382,351	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	28,209,500	85.96	2,425,110,816	86.08	2,428,485,331	0.47
香港	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	528,000	4,712.88	2,488,402,648	4,490.85	2,371,168,800	0.46
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	99,538	25,389.92	2,527,261,960	23,706.23	2,359,670,881	0.46
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	33,262,350	81.35	2,706,132,461	70.70	2,351,880,981	0.46
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	36,518	41,145.47	1,502,550,295	59,438.50	2,170,575,143	0.42
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	1,155,198	1,631.38	1,884,573,996	1,865.92	2,155,517,449	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	1,890,800	861.52	1,628,971,270	1,113.66	2,105,709,551	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9月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	5.06
	素材	7.61
	資本財	4.45
	商業・専門サービス	0.06
	運輸	1.94
	自動車・自動車部品	3.61
	耐久消費財・アパレル	1.26
	消費者サービス	2.59
	メディア・娯楽	6.30
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.46
	生活必需品流通・小売り	1.47
	食品・飲料・タバコ	3.62
	家庭用品・パーソナル用品	0.79
	ヘルスケア機器・サービス	1.04

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.58
	銀行	15.82
	金融サービス	2.77
	保険	2.72
	ソフトウェア・サービス	2.44
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.53
	電気通信サービス	2.68
	公益事業	2.48
	半導体・半導体製造装置	8.58
	不動産管理・開発	1.56
	小計	95.43
投資証券	—	0.11
合計		95.54

(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9月29日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額(円)	評価金額	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 2312	買建	3,330	アメリカドル	163,166,868	24,406,500,115	159,090,750	23,796,794,385	4.63

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

#### 国内債券インデックスマザーファンド

#### 投資状況

2023年9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	138,294,149,860	82.28
地方債証券	日本	9,043,825,220	5.38
特殊債券	日本	9,079,419,116	5.40
社債券	日本	11,010,177,600	6.55
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	642,273,276	0.39
純資産総額		168,069,845,072	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9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	289,920,000	0.17

(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9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
日本	国債証券	第147回利付国債 (5年)	3,530,000,000	100.00	3,530,079,000	99.85	3,524,775,600	0.005000	2026/3/20	2.10
日本	国債証券	第144回利付国債 (5年)	2,540,000,000	100.34	2,548,636,000	100.15	2,543,911,600	0.100000	2025/6/20	1.51
日本	国債証券	第154回利付国債 (5年)	2,390,000,000	100.29	2,396,953,300	99.54	2,379,173,300	0.100000	2027/9/20	1.42
日本	国債証券	第148回利付国債 (5年)	2,210,000,000	100.01	2,210,279,100	99.78	2,205,204,300	0.005000	2026/6/20	1.31
日本	国債証券	第160回利付国債 (5年)	2,160,000,000	99.78	2,155,375,800	99.48	2,148,940,800	0.200000	2028/6/20	1.28
日本	国債証券	第153回利付国債 (5年)	2,120,000,000	99.66	2,112,954,300	99.33	2,105,902,000	0.005000	2027/6/20	1.25
日本	国債証券	第143回利付国債 (5年)	1,800,000,000	100.32	1,805,814,000	100.16	1,802,880,000	0.100000	2025/3/20	1.07
日本	国債証券	第357回利付国債 (10年)	1,820,000,000	99.64	1,813,448,000	97.97	1,783,090,400	0.100000	2029/12/20	1.06
日本	国債証券	第146回利付国債 (5年)	1,750,000,000	100.32	1,755,728,100	100.12	1,752,117,500	0.100000	2025/12/20	1.04
日本	国債証券	第452回利付国債 (2年)	1,600,000,000	99.95	1,599,298,000	99.95	1,599,232,000	0.005000	2025/9/1	0.95
日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	1,540,000,000	98.73	1,520,511,500	96.80	1,490,858,600	0.100000	2030/12/20	0.89
日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	1,540,000,000	97.38	1,499,786,400	96.20	1,481,572,400	0.100000	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第368回利付国債 (10年)	1,510,000,000	97.07	1,465,850,700	95.66	1,444,466,000	0.200000	2032/9/20	0.86
日本	国債証券	第354回利付国債 (10年)	1,450,000,000	99.70	1,445,679,800	98.60	1,429,801,500	0.100000	2029/3/20	0.85
日本	国債証券	第147回利付国債 (20年)	1,300,000,000	110.59	1,437,724,600	107.91	1,402,856,000	1.600000	2033/12/20	0.83
日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	1,400,000,000	100.02	1,400,296,000	99.22	1,389,192,000	0.100000	2028/3/20	0.83
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	1,350,000,000	100.43	1,355,832,000	99.90	1,348,690,500	0.100000	2026/12/20	0.80
日本	国債証券	第369回利付国債 (10年)	1,360,000,000	99.74	1,356,525,500	98.05	1,333,561,600	0.500000	2032/12/20	0.79
日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	1,300,000,000	98.80	1,284,517,000	96.49	1,254,461,000	0.100000	2031/3/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債	1,250,000,000	98.15	1,226,908,400	97.14	1,214,287,500	0.100000	2030/9/20	0.72

		債(10年)								
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	1,240,000,000	98.47	1,221,028,000	97.43	1,208,156,800	0.100000	2030/6/20	0.72
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	1,240,000,000	97.29	1,206,424,900	96.69	1,199,067,600	0.400000	2033/6/20	0.71
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	1,200,000,000	100.16	1,201,920,000	99.39	1,192,728,000	0.100000	2027/12/20	0.71
日本	国債証券	第116回利付国債(20年)	1,050,000,000	113.85	1,195,467,000	111.06	1,166,130,000	2.200000	2030/3/20	0.69
日本	国債証券	第143回利付国債(20年)	1,080,000,000	111.68	1,206,156,500	107.93	1,165,741,200	1.600000	2033/3/20	0.69
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	1,180,000,000	99.04	1,168,785,200	98.40	1,161,190,800	0.100000	2029/6/20	0.69
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	1,160,000,000	100.13	1,161,530,000	99.70	1,156,566,400	0.005000	2026/9/20	0.69
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,070,000,000	98.65	1,055,562,200	98.19	1,050,675,800	0.100000	2029/9/20	0.63
日本	国債証券	第450回利付国債(2年)	1,050,000,000	99.99	1,049,913,000	99.97	1,049,716,500	0.005000	2025/7/1	0.62
日本	国債証券	第156回利付国債(5年)	1,030,000,000	100.59	1,036,077,000	99.81	1,028,063,600	0.200000	2027/12/20	0.61

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

#### b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2023年9月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	82.28
地方債証券	5.38
特殊債券	5.40
社債券	6.55
合計	99.62

(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9月29日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物23年12月限	買建	2	円	292,001,870	289,920,000	0.17

(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。

#### ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

#### 投資状況

2023年9月29日現在

(単位:円)

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

国債証券	アメリカ	150,401,636,609	48.68
	フランス	25,374,394,565	8.21
	イタリア	22,651,133,925	7.33
	中国	20,374,823,825	6.59
	ドイツ	19,698,889,168	6.38
	イギリス	15,215,330,167	4.92
	スペイン	14,804,378,679	4.79
	カナダ	6,312,961,314	2.04
	ベルギー	5,645,064,614	1.83
	オーストラリア	4,508,188,849	1.46
	オランダ	4,478,525,405	1.45
	オーストリア	3,479,245,819	1.13
	メキシコ	3,013,216,123	0.98
	アイルランド	1,798,727,290	0.58
	マレーシア	1,685,021,347	0.55
	フィンランド	1,663,110,579	0.54
	ポーランド	1,549,014,594	0.50
	シンガポール	1,405,695,272	0.45
	デンマーク	903,261,689	0.29
	イスラエル	877,659,510	0.28
	ニュージーランド	658,996,123	0.21
スウェーデン	587,691,876	0.19	
ノルウェー	491,400,664	0.16	
	小計	307,578,368,006	99.56
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	1,374,131,586	0.44
純資産総額		308,952,499,592	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9月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限(年/月/日)	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	11,590,000	15,824.06	1,834,009,505	14,425.70	1,671,939,268	4.125000	2032/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280630	12,200,000	13,147.72	1,604,022,486	12,800.48	1,561,659,023	1.250000	2028/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	10,700,000	14,337.24	1,534,085,001	13,128.56	1,404,756,609	2.875000	2032/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	10,600,000	14,054.92	1,489,821,960	12,951.52	1,372,861,607	2.750000	2032/8/15	0.44

アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	9,650,000	14,755.24	1,423,881,338	13,726.30	1,324,588,161	3.500000	2033/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	9,730,000	14,420.35	1,403,100,630	13,567.37	1,320,105,435	3.375000	2033/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	11,260,000	12,590.14	1,417,650,733	11,685.93	1,315,836,563	1.250000	2031/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	11,130,000	12,687.37	1,412,104,905	11,718.65	1,304,286,649	1.375000	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	11,200,000	12,258.37	1,372,937,980	11,474.42	1,285,135,275	0.625000	2030/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	10,890,000	12,667.93	1,379,537,599	11,792.86	1,284,242,875	1.125000	2031/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	10,400,000	13,133.12	1,365,844,896	12,148.11	1,263,404,101	1.875000	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	10,280,000	12,973.01	1,333,625,963	12,139.93	1,247,985,434	1.625000	2031/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	10,300,000	12,260.46	1,262,828,403	11,632.18	1,198,114,765	0.875000	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 250131	7,200,000	15,002.87	1,080,206,928	14,727.20	1,060,358,594	4.125000	2025/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 250815	7,300,000	14,730.72	1,075,342,586	14,428.62	1,053,289,778	3.125000	2025/8/15	0.34
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	7,000,000	15,777.66	1,104,436,558	15,031.17	1,052,181,918	2.500000	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 250228	7,000,000	15,013.34	1,050,934,122	14,822.73	1,037,591,468	4.625000	2025/2/28	0.34
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280531	7,950,000	13,396.38	1,065,012,592	12,835.54	1,020,425,558	1.250000	2028/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	8,550,000	12,211.62	1,044,094,278	11,569.66	989,206,133	0.625000	2030/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	7,200,000	13,818.20	994,910,429	13,462.20	969,278,400	1.500000	2027/1/31	0.31
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 260930	7,000,000	13,595.11	951,658,015	13,338.91	933,723,933	0.875000	2026/9/30	0.30
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280930	7,300,000	13,203.94	963,887,682	12,703.49	927,354,803	1.250000	2028/9/30	0.30
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	6,650,000	14,395.32	957,288,917	13,824.46	919,326,859	2.750000	2028/2/15	0.30
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	6,600,000	14,416.42	951,484,363	13,854.26	914,381,373	2.875000	2028/5/15	0.30
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280430	7,100,000	13,305.99	944,725,556	12,868.55	913,667,361	1.250000	2028/4/30	0.30
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	6,400,000	14,312.35	915,990,526	14,127.71	904,173,706	2.250000	2025/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 260731	6,700,000	13,531.65	906,621,159	13,305.60	891,475,765	0.625000	2026/7/31	0.29
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 260131	6,600,000	13,496.96	890,799,734	13,458.10	888,235,251	0.375000	2026/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 250315	6,200,000	14,246.91	883,308,465	14,221.20	881,714,503	1.750000	2025/3/15	0.29
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 300215	7,050,000	13,089.67	922,822,172	12,394.10	873,784,423	1.500000	2030/2/15	0.28

(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9月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.56
合計	99.56

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



## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

## 投資状況

2023年9月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	9,124,169,832	100.10
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	△8,851,100	△0.10
純資産総額		9,115,318,732	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9月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	4.817 QATAR 490314	1,400,000	14,681.41	205,539,853	12,866.15	180,126,151	4.817000	2049/3/14	1.98
アメリカ	国債証券	4 QATAR 290314	1,200,000	14,750.89	177,010,758	14,207.67	170,492,099	4.000000	2029/3/14	1.87
アメリカ	国債証券	3.875 BRAZIL 300612	1,000,000	13,274.43	132,744,387	13,019.84	130,198,434	3.875000	2030/6/12	1.43
アメリカ	国債証券	4.4 QATAR 500416	1,000,000	13,989.91	139,899,182	12,049.82	120,498,208	4.400000	2050/4/16	1.32
アメリカ	国債証券	5.6 TURKEY 241114	800,000	14,437.91	115,503,282	14,687.26	117,498,081	5.600000	2024/11/14	1.29
アメリカ	国債証券	6 OMAN GOV INTERN 290801	800,000	14,974.53	119,796,259	14,628.92	117,031,392	6.000000	2029/8/1	1.28
アメリカ	国債証券	FRN ECUADOR 350731	2,100,000	5,322.19	111,766,176	5,537.41	116,285,776	3.500000	2035/7/31	1.28
アメリカ	国債証券	4.375 SAUDI INTER 290416	800,000	15,030.56	120,244,550	14,242.22	113,937,839	4.375000	2029/4/16	1.25
アメリカ	国債証券	2.783 PERU 310123	900,000	12,860.88	115,747,996	12,267.47	110,407,242	2.783000	2031/1/23	1.21
アメリカ	国債証券	0.55 CHINA GOVT I 251021	800,000	13,751.37	110,010,974	13,590.00	108,720,009	0.550000	2025/10/21	1.19
アメリカ	国債証券	FRN ARGENTINA 300709	2,450,000	3,900.67	95,566,521	4,392.50	107,616,312	0.750000	2030/7/9	1.18
アメリカ	国債証券	4.75 BRAZIL 500114	1,000,000	11,006.99	110,069,939	10,355.06	103,550,670	4.750000	2050/1/14	1.14
アメリカ	国債証券	FRN ARGENTINA 350709	2,550,000	3,510.64	89,521,386	3,876.35	98,847,038	3.625000	2035/7/9	1.08
アメリカ	国債証券	9.875 TURKEY 280115	600,000	15,746.28	94,477,720	15,699.91	94,199,502	9.875000	2028/1/15	1.03
アメリカ	国債証券	4.875 DOMINICAN 320923	750,000	12,679.29	95,094,738	12,209.24	91,569,306	4.875000	2032/9/23	1.00

アメリカ	国債証券	2. 125 HUNGARY 310922	800,000	11,522.29	92,178,376	11,028.30	88,226,472	2.125000	2031/9/22	0.97
アメリカ	国債証券	3. 4 QATAR 250416	600,000	14,664.82	87,988,939	14,493.76	86,962,581	3.400000	2025/4/16	0.95
アメリカ	国債証券	6. 4 PANAMA 350214	600,000	15,690.94	94,145,652	14,477.59	86,865,598	6.400000	2035/2/14	0.95
アメリカ	国債証券	2. 252 PANAMA 320929	800,000	11,349.75	90,798,051	10,818.88	86,551,104	2.252000	2032/9/29	0.95
アメリカ	国債証券	2. 5 ABU DHABI GOV 250416	600,000	14,501.78	87,010,686	14,284.21	85,705,301	2.500000	2025/4/16	0.94
アメリカ	国債証券	7. 625 TURKEY 290426	600,000	14,422.02	86,532,150	14,282.45	85,694,711	7.625000	2029/4/26	0.94
アメリカ	国債証券	4. 375 URUGUAY 310123	600,000	15,040.95	90,245,759	14,278.00	85,668,031	4.375000	2031/1/23	0.94
アメリカ	国債証券	7. 5 COLOMBIA 340202	600,000	14,358.86	86,153,177	14,180.49	85,082,992	7.500000	2034/2/2	0.93
アメリカ	国債証券	4. 875 SAUDI INTER 330718	600,000	14,850.70	89,104,207	14,160.18	84,961,110	4.875000	2033/7/18	0.93
アメリカ	国債証券	6 BRAZIL 331020	600,000	14,726.15	88,356,906	14,093.72	84,562,362	6.000000	2033/10/20	0.93
アメリカ	国債証券	4. 5 BRAZIL 290530	600,000	14,160.72	84,964,332	13,927.76	83,566,618	4.500000	2029/5/30	0.92
アメリカ	国債証券	3. 75 QATAR 300416	600,000	14,606.38	87,638,323	13,918.47	83,510,873	3.750000	2030/4/16	0.92
アメリカ	国債証券	6. 338 MEXICO 530504	600,000	15,267.13	91,602,792	13,590.04	81,540,278	6.338000	2053/5/4	0.89
アメリカ	国債証券	3. 85 INDONESIA 301015	600,000	13,704.02	82,224,126	13,424.78	80,548,713	3.850000	2030/10/15	0.88
アメリカ	国債証券	5. 875 DOMINICAN 600130	750,000	11,336.06	85,020,523	10,717.30	80,379,798	5.875000	2060/1/30	0.88

(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9月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	100.10
合計	100.10

(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。

《参考情報》

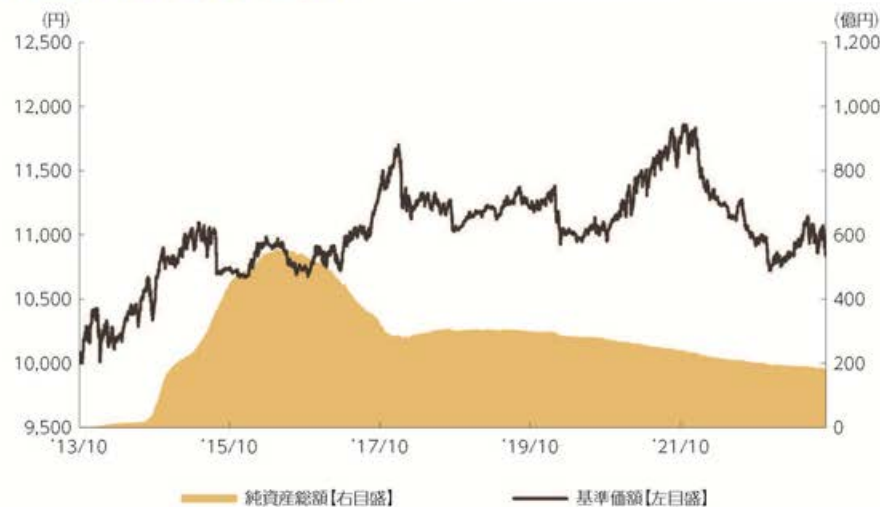


# 運用実績

2023年9月29日現在

## 株式抑制型

### ■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2023年9月29日



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

### ■基準価額・純資産

基準価額	10,837円
純資産総額	180.3億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

2023年 3月	0円
2022年 3月	0円
2021年 3月	0円
2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
2018年 3月	0円
設定来累計	0円

•分配金は1万口当たり、税引前

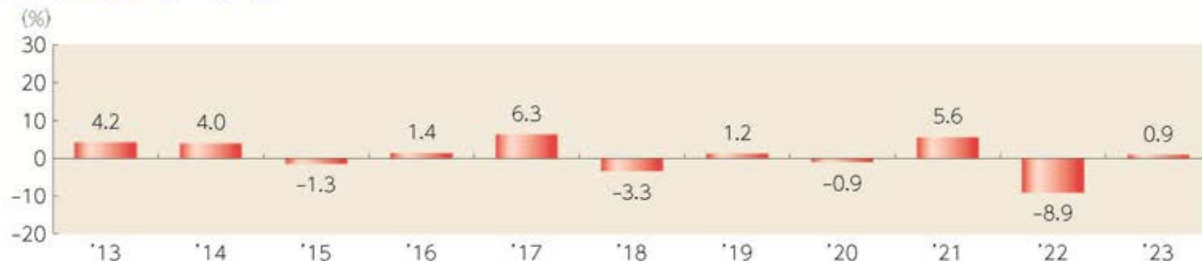
## ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
国内株式	21.3%	1 円	82.9%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	1.0%
国内債券	34.0%	2 アメリカドル	12.8%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.9%
外国株式	16.4%	3 ユーロ	1.6%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	0.7%
外国債券	24.8%	4 イギリスポンド	0.7%	ソニーグループ	株式	電気機器	0.6%
		5 カナダドル	0.6%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	0.5%
		6 スイスフラン	0.5%	第147回利付国債(5年)	債券	国債	0.7%
		7 オーストラリアドル	0.4%	第144回利付国債(5年)	債券	国債	0.5%
		8 デンマーククローネ	0.2%	第154回利付国債(5年)	債券	国債	0.5%
		9 スウェーデンクローネ	0.2%	第148回利付国債(5年)	債券	国債	0.4%
		10 香港ドル	0.1%	第160回利付国債(5年)	債券	国債	0.4%
コールローン他 (負債控除後)	3.5%						
合計	100.0%						

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	0.7%
債券先物取引 (買建)	0.1%

- 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。

## ■年間収益率の推移

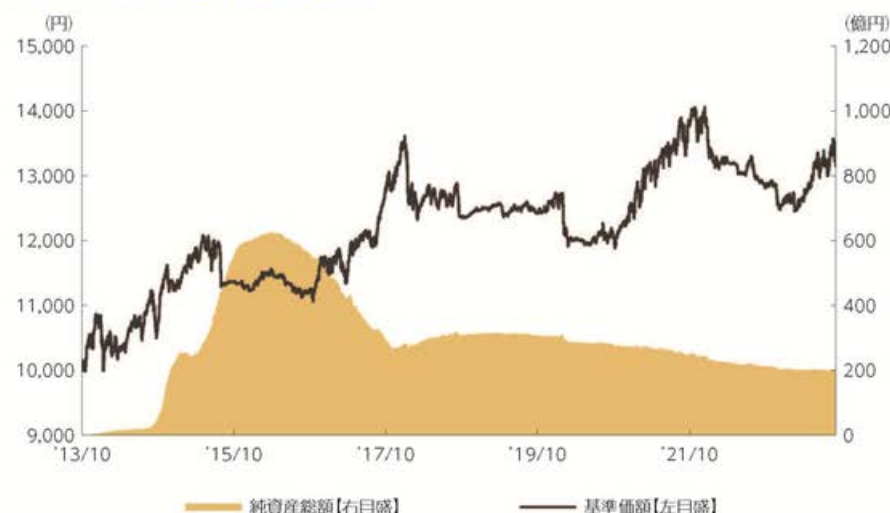


- 収益率は基準価額で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2023年は年初から9月29日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

## 株式重視型

### ■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2023年9月29日



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

### ■基準価額・純資産

基準価額	13,151円
純資産総額	196.4億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

2023年 3月	0円
2022年 3月	0円
2021年 3月	0円
2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
2018年 3月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

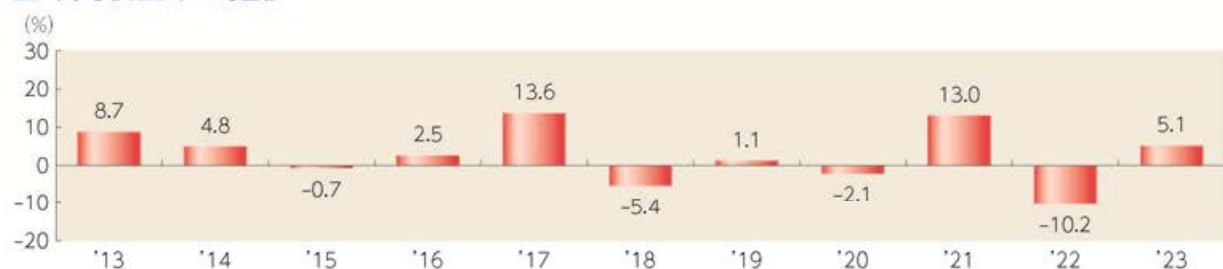
## ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
国内株式	41.4%	1 円	65.4%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	1.8%
外国株式	33.5%	2 アメリカドル	25.9%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.8%
外国債券	21.4%	3 ユーロ	3.3%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	1.5%
		4 イギリスポンド	1.5%	ソニーグループ	株式	電気機器	1.1%
		5 カナダドル	1.2%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	1.0%
		6 スイスフラン	1.0%	4.125 T-NOTE 321115	債券	国債	0.1%
		7 オーストラリアドル	0.7%	1.25 T-NOTE 280630	債券	国債	0.1%
		8 デンマーククローネ	0.3%	2.875 T-NOTE 320515	債券	国債	0.1%
		9 スウェーデンクローネ	0.3%	2.75 T-NOTE 320815	債券	国債	0.1%
		10 香港ドル	0.2%	3.5 T-NOTE 330215	債券	国債	0.1%
コールローン他 (負債控除後)	3.7%						
合計	100.0%						

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.4%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 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。

## ■年間収益率の推移

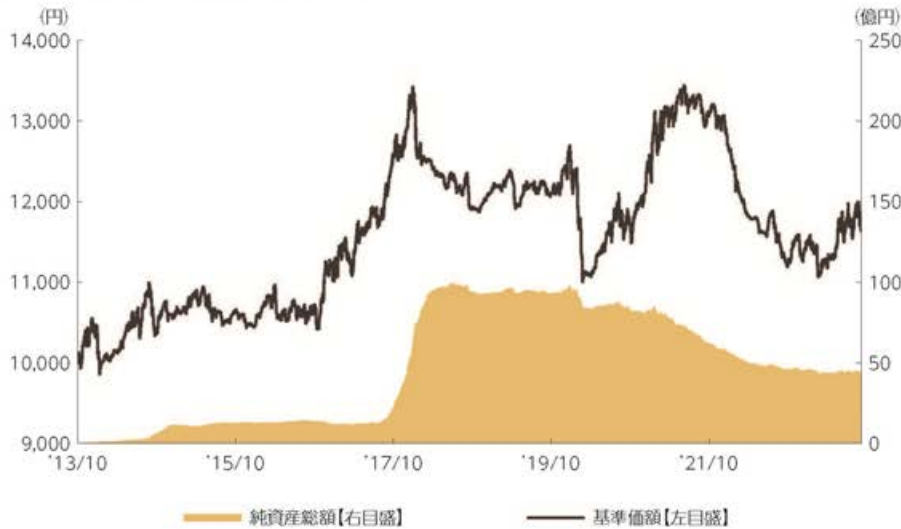


- 収益率は基準価額で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2023年は年初から9月29日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

## 新興国投資型

### ■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2023年9月29日



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

### ■基準価額・純資産

基準価額	11,640円
純資産総額	43.5億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

2023年 3月	0円
2022年 3月	0円
2021年 3月	0円
2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
2018年 3月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

### ■主要な資産の状況

資産別構成	比率
国内株式	31.1%
国内債券	11.1%
外国株式	16.4%
外国債券	27.2%
コールローン他 (負債控除後)	14.2%
合計	100.0%

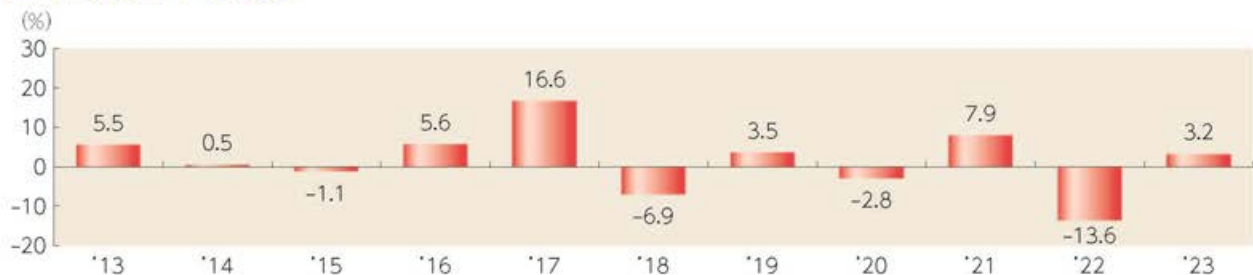
組入上位通貨	比率
1 円	82.8%
2 アメリカドル	8.7%
3 香港ドル	1.4%
4 ユーロ	1.1%
5 インドルピー	0.9%
6 ニュー台湾ドル	0.9%
7 韓国ウォン	0.7%
8 イギリスポンド	0.5%
9 カナダドル	0.4%
10 スイスフラン	0.3%

組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
トヨタ自動車	株式	輸送用機器	1.4%
ソニーグループ	株式	電気機器	0.8%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	0.7%
APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.6%
日本電信電話	株式	情報・通信業	0.5%
4.817 QATAR 490314	債券	国債	0.3%
4 QATAR 290314	債券	国債	0.3%
第147回利付国債(5年)	債券	国債	0.2%
3.875 BRAZIL 300612	債券	国債	0.2%
4.4 QATAR 500416	債券	国債	0.2%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.0%
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。

### ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2023年は年初から9月29日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### ②申込単位

販売会社が定める単位

#### ③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

#### ④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### ⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

#### ⑥申込手数料

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

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

#### ⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

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

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

#### ⑧申込受付時間

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

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ アセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

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

解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受

付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

#### ⑨解約請求受付の中止および取消し

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。

その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

##### ①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

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



原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

(受付時間：営業日の9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2028年3月24日まで(2013年10月25日設定)

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

(4)【計算期間】

毎年3月26日から翌年3月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

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

・各ファンドについて、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

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

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

②信託約款の変更等

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または

併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

### ③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。）、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

### ④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

### ⑤関係法人との契約の更改

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

### ⑥運用報告書

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

### ⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

### ⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

### ⑨信託事務の再信託

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

います。

#### ⑩公告

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

###### ①分配金受取コース（一般コース）

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

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

###### ②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

##### (2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

##### (3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、当期（令和 4 年 3 月 26 日から令和 5 年 3 月 27 日まで）の財務諸表について、PwC あらた有限責任監査法人により監査を受けております。

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所  
指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 西郷 篤

#### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の令和4年3月26日から令和5年3月27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 バランス・イノベーション（株式抑制型）の令和5年3月27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 バランス・イノベーション（株式抑制型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 [ 令和4年3月25日現在 ]	第10期 [ 令和5年3月27日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,887,901,492	1,664,777,430
親投資信託受益証券	19,162,055,402	17,273,657,493
未収入金	-	422,000,000
流動資産合計	22,049,956,894	19,360,434,923
資産合計	22,049,956,894	19,360,434,923
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	73,280,141	23,203,307
未払受託者報酬	6,299,635	5,428,812
未払委託者報酬	157,490,621	135,720,202
未払利息	179	555
その他未払費用	453,510	390,819
流動負債合計	237,524,086	164,743,695
負債合計	237,524,086	164,743,695
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	19,265,644,331	17,743,252,194
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,546,788,477	1,452,439,034
（分配準備積立金）	704,506,102	646,516,838
元本等合計	21,812,432,808	19,195,691,228
純資産合計	21,812,432,808	19,195,691,228
負債純資産合計	22,049,956,894	19,360,434,923

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日	第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2,764	19,230
有価証券売買等損益	380,593,706	△637,762,998
営業収益合計	380,596,470	△637,743,768
<b>営業費用</b>		
支払利息	138,071	2,189,086
受託者報酬	13,245,875	11,273,533

委託者報酬	331,146,453	281,838,188
その他費用	953,572	811,574
営業費用合計	345,483,971	296,112,381
営業利益又は営業損失(△)	35,112,499	△933,856,149
経常利益又は経常損失(△)	35,112,499	△933,856,149
当期純利益又は当期純損失(△)	35,112,499	△933,856,149
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(△)	98,735,312	△42,038,652
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,070,024,667	2,546,788,477
剰余金増加額又は欠損金減少額	85,775,660	7,505,366
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	85,775,660	7,505,366
剰余金減少額又は欠損金増加額	545,389,037	210,037,312
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	545,389,037	210,037,312
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,546,788,477	1,452,439,034

### (3)【注記表】

#### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和4年3月26日から令和5年3月27日までとなっております。

#### (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

#### (貸借対照表に関する注記)

	第9期 [令和4年3月25日現在]	第10期 [令和5年3月27日現在]
1. 期首元本額	22,786,747,268円	19,265,644,331円
期中追加設定元本額	519,013,721円	66,798,497円
期中一部解約元本額	4,040,116,658円	1,589,190,634円
2. 受益権の総数	19,265,644,331口	17,743,252,194口

#### (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日			第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27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	—円	費用控除後の配当等収益額	A	—円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	1,842,282,375円	収益調整金額	C	805,922,196円
分配準備積立金額	D	704,506,102円	分配準備積立金額	D	646,516,838円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,546,788,477円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,452,439,034円
当ファンドの期末残存口数	F	19,265,644,331口	当ファンドの期末残存口数	F	17,743,252,194口



1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,321 円
1 万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円

1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	818 円
1 万口当たり分配金額	H	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第 9 期 自 令和 3 年 3 月 26 日 至 令和 4 年 3 月 25 日	第 10 期 自 令和 4 年 3 月 26 日 至 令和 5 年 3 月 27 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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 9 期 [令和 4 年 3 月 25 日現在]	第 10 期 [令和 5 年 3 月 27 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9期 [令和4年3月25日現在]	第10期 [令和5年3月27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	△347,215,253	△130,369,462
合計	△347,215,253	△130,369,462

(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9期 [令和4年3月25日現在]	第10期 [令和5年3月27日現在]
1口当たり純資産額	1.1322円	1.0819円
(1万口当たり純資産額)	(11,322円)	(10,819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	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	4,135,680,137	4,817,653,791	
	国内債券インデックスマザーファンド	10,354,398,012	9,793,189,639	
	TOPIXマザーファンド	501,702,306	1,165,303,946	
	外国株式インデックスマザーファンド	329,492,424	1,497,510,117	
合計		15,321,272,879	17,273,657,493	

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。

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所  
指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 西郷 篤

#### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の令和4年3月26日から令和5年3月27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 バランス・イノベーション（株式重視型）の令和5年3月27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。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 [ 令和4年3月25日現在 ]	第10期 [ 令和5年3月27日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,840,697,872	428,473,405
親投資信託受益証券	19,866,376,595	19,281,578,605
未収入金	168,000,000	446,000,000
流動資産合計	22,875,074,467	20,156,052,010
資産合計	22,875,074,467	20,156,052,010
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,404,947	21,350,277
未払受託者報酬	6,551,420	5,706,450
未払委託者報酬	163,785,421	142,661,139
未払利息	176	142
その他未払費用	471,640	410,807
流動負債合計	183,213,604	170,128,815
負債合計	183,213,604	170,128,815
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,165,644,448	16,004,523,401
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,526,216,415	3,981,399,794
（分配準備積立金）	1,970,857,297	1,809,391,171
元本等合計	22,691,860,863	19,985,923,195
純資産合計	22,691,860,863	19,985,923,195
負債純資産合計	22,875,074,467	20,156,052,010

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日	第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,743	13,271
有価証券売買等損益	1,198,204,450	△889,409,081
営業収益合計	1,198,206,193	△889,395,810
<b>営業費用</b>		
支払利息	119,472	1,982,024
受託者報酬	13,836,225	11,814,017
委託者報酬	345,905,446	295,350,205
その他費用	996,078	850,490

営業費用合計	360,857,221	309,996,736
営業利益又は営業損失(△)	837,348,972	△1,199,392,546
経常利益又は経常損失(△)	837,348,972	△1,199,392,546
当期純利益又は当期純損失(△)	837,348,972	△1,199,392,546
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(△)	258,965,913	△34,078,052
期首剰余金又は期首欠損金(△)	5,975,803,785	5,526,216,415
剰余金増加額又は欠損金減少額	188,796,845	76,556,467
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	188,796,845	76,556,467
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,216,767,274	456,058,594
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,216,767,274	456,058,594
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	5,526,216,415	3,981,399,794

### (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和4年3月26日から令和5年3月27日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 [令和4年3月25日現在]	第10期 [令和5年3月27日現在]
1. 期首元本額	20,879,295,495円	17,165,644,448円
期中追加設定元本額	528,655,909円	255,946,355円
期中一部解約元本額	4,242,306,956円	1,417,067,402円
2. 受益権の総数	17,165,644,448口	16,004,523,401口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日			第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27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	257,408,724円	費用控除後の配当等収益額	A	—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	320,974,335円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	3,555,359,118円	収益調整金額	C	2,172,008,623円
分配準備積立金額	D	1,392,474,238円	分配準備積立金額	D	1,809,391,171円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,526,216,415円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,981,399,794円
当ファンドの期末残存口数	F	17,165,644,448口	当ファンドの期末残存口数	F	16,004,523,401口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,219円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,487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9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日	第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 [令和4年3月25日現在]	第10期 [令和5年3月27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9期	第10期
----	-----	------

	[令和 4 年 3 月 25 日現在]	[令和 5 年 3 月 27 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	△250,041,287	△52,289,875
合計	△250,041,287	△52,289,875

(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9期 [令和 4 年 3 月 25 日現在]	第10期 [令和 5 年 3 月 27 日現在]
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3219円 (13,219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	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	4,296,990,755	5,005,564,530	
	国内債券インデックスマザーファンド	9,476,234,696	8,962,622,775	
	TOPIXマザーファンド	1,103,441,785	2,562,964,234	
	外国株式インデックスマザーファンド	605,167,785	2,750,427,066	
合計		15,481,835,021	19,281,578,605	

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。



# 独立監査人の監査報告書

令和5年5月31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  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 西郷 篤

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の令和4年3月26日から令和5年3月27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 バランス・イノベーション（新興国投資型）の令和5年3月27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。

【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 [ 令和4年3月25日現在 ]	第10期 [ 令和5年3月27日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,848,315,429	89,469,385
親投資信託受益証券	3,402,438,844	4,089,503,973
未収入金	-	205,000,000
流動資産合計	5,250,754,273	4,383,973,358
資産合計	5,250,754,273	4,383,973,358
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,359,677	1,032,768
未払受託者報酬	1,590,385	1,258,298
未払委託者報酬	39,759,488	31,457,523
未払利息	114	29
その他未払費用	114,443	90,537
流動負債合計	49,824,107	33,839,155
負債合計	49,824,107	33,839,155
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,322,205,525	3,908,166,997
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	878,724,641	441,967,206
(分配準備積立金)	218,196,370	197,797,272
元本等合計	5,200,930,166	4,350,134,203
純資産合計	5,200,930,166	4,350,134,203
負債純資産合計	5,250,754,273	4,383,973,358

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日	第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	415	1,682
有価証券売買等損益	△165,851,316	△301,096,937
営業収益合計	△165,850,901	△301,095,255
<b>営業費用</b>		
支払利息	33,730	251,133
受託者報酬	3,605,770	2,616,874
委託者報酬	90,144,174	65,421,836
その他費用	259,489	188,292

営業費用合計	94,043,163	68,478,135
営業利益又は営業損失(△)	△259,894,064	△369,573,390
経常利益又は経常損失(△)	△259,894,064	△369,573,390
当期純利益又は当期純損失(△)	△259,894,064	△369,573,390
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(△)	60,108,385	△18,328,226
期首剰余金又は期首欠損金(△)	1,700,058,925	878,724,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,055,906	4,925,553
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,055,906	4,925,553
剰余金減少額又は欠損金増加額	526,387,741	90,437,824
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	526,387,741	90,437,824
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	878,724,641	441,967,206

### (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和4年3月26日から令和5年3月27日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 [令和4年3月25日現在]	第10期 [令和5年3月27日現在]
1. 期首元本額	6,142,201,858円	4,322,205,525円
期中追加設定元本額	79,829,486円	31,065,353円
期中一部解約元本額	1,899,825,819円	445,103,881円
2. 受益権の総数	4,322,205,525口	3,908,166,997口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日			第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27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	24,321,401円	費用控除後の配当等収益額	A	1,993,257円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	660,528,271円	収益調整金額	C	328,305,956円
分配準備積立金額	D	193,874,969円	分配準備積立金額	D	195,804,015円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	878,724,641円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	526,103,228円
当ファンドの期末残存口数	F	4,322,205,525口	当ファンドの期末残存口数	F	3,908,166,997口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,033円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,346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9期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日	第10期 自 令和4年3月26日 至 令和5年3月27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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 [令和4年3月25日現在]	第10期 [令和5年3月27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9期	第10期
----	-----	------

	[令和 4 年 3 月 25 日現在]	[令和 5 年 3 月 27 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	△133,129,448	1,553,524
合計	△133,129,448	1,553,524

(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9期 [令和 4 年 3 月 25 日現在]	第10期 [令和 5 年 3 月 27 日現在]
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2033円 (12,033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	新興国株式インデックスマザーファンド	87,650,708	257,228,532	
	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	890,046,889	1,036,815,620	
	ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド	1,174,090,936	1,033,904,478	
	国内債券インデックスマザーファンド	1,007,917,035	953,287,931	
	TOPIXマザーファンド	146,021,159	339,163,346	
	外国株式インデックスマザーファンド	103,215,487	469,104,066	
合計		3,408,942,214	4,089,503,973	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 5 年 3 月 27 日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	51,758,002,649
株式	862,140,675,060
派生商品評価勘定	53,257,950
未収配当金	1,266,685,464
未収利息	794,231
前払金	196,845,000
その他未収収益	54,635,526
差入委託証拠金	424,320,000
流動資産合計	915,895,215,880
資産合計	915,895,215,880
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	219,641,300
未払金	18,280,450,849
未払解約金	569,155,505
未払利息	17,257
受入担保金	41,951,505,535
流動負債合計	61,020,770,446
負債合計	61,020,770,446
純資産の部	
元本等	
元本	368,050,508,229
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	486,823,937,205
元本等合計	854,874,445,434
純資産合計	854,874,445,434
負債純資産合計	915,895,215,880

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)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 期首	令和 4 年 3 月 26 日
期首元本額	323,925,697,289 円
期中追加設定元本額	175,107,546,693 円
期中一部解約元本額	130,982,735,753 円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	7,676,918,036 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	945,147,224 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,897,427,490 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,581,056,554 円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,427,654,813 円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	7,335,641,950 円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	38,502,991,405 円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	42,213,759,113 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	106,974,398 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	277,294,372 円
ファンド・マネジャー(国内株式)	634,945,965 円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,386,886,105 円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,237,038,000 円
eMAXIS バランス(波乗り型)	160,701,797 円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,887,783,335 円
コアバランス	213,831 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	992,480,155 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	1,110,565,458 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	948,645,098 円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	27,782,563,574 円
国内株式セレクション(ラップ向け)	4,224,379,838 円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	9,574,549,071 円
つみたて日本株式(TOPIX)	7,557,227,401 円
つみたて8資産均等バランス	4,496,427,105 円
つみたて4資産均等バランス	1,528,825,144 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,591,906 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,229,397 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,683,280 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	765,366,163 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	833,513,276 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	535,773,138 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	469,620,490 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,524,461,549 円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	2,963,070,522 円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	951,556,158 円
三菱UFJ DC年金インデックス(国内株式)	2,432,321,387 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	444,719,553 円



三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	143,875,949円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	18,024,377,534円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	173,292,744円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,904,520,892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)	1,382,183,934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)	14,678,858円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	7,838,889,024円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	60,131,019円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	11,878,435円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	35,083,406円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	501,702,306円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,103,441,785円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	146,021,159円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	487,092,747円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	290,071,871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)	115,318,127円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	655,665,493円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	148,423,928円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	162,546,668円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	585,738,745円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	468,700,199円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	908,357,638円
三菱UFJ トピックスオープン	983,119,651円
三菱UFJ DCトピックスオープン	8,007,179,410円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	63,773,458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)	5,318,526,795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)	56,534円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	9,996,720円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	5,036,974,076円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	98,045,148円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,623,574,463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)	32,916,222,762円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	247,870,237円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	263,431円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	1,184,580円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	259,191,462円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	478,984,073円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,780,955,914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)	1,429,481,445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)	443,070,181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)	608,379,349円

世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	87,257,716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)	829,973,257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)	98,524,693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)	3,269,450,249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)	605,539,391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)	37,426,460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)	233,613円
日米コアバランス (FOF s用) (適格機関投資家限定)	170,810,686円
日本株式インデックスファンドS	803,018,008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)	117,460,290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)	456,343,616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)	906,746,798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	5,072,549,657円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	3,311,246円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	9,587,982円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	2,812,810円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	6,687,385円

三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	574,318,112円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	98,774,266円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	4,663,008円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	39,043,668円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	3,305,801円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	30,558,435円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,607,827,539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)	406,582,112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)	1,659,362,488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)	1,525,704,563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)	1,373,859,266円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	56,729,592,054円
合計	368,050,508,229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	40,127,302,550円
3. 受益権の総数	368,050,508,229円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

### 1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 4 年 3 月 26 日 至 令和 5 年 3 月 27 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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。

### 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	[令和 5 年 3 月 27 日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
株式		△728, 118, 937
合計		△728, 118, 937

(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

[令和 5 年 3 月 27 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	11, 753, 825, 000	—	11, 587, 770, 000	△166, 055, 000
合計		11, 753, 825, 000	—	11, 587, 770, 000	△166, 055, 000

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1口当たり純資産額	2. 3227 円
(1万口当たり純資産額)	(23, 227 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	16,300	3,480.00	56,724,000	
1332	ニッスイ	429,100	549.00	235,575,900	
1333	マルハニチロ	63,800	2,388.00	152,354,400	貸付有価証券 1,000株
1375	雪国まいたけ	36,500	1,018.00	37,157,000	
1376	カネコ種苗	13,100	1,642.00	21,510,200	貸付有価証券 1,800株
1377	サカタのタネ	48,800	3,855.00	188,124,000	貸付有価証券 7,200株
1379	ホクト	38,200	1,875.00	71,625,000	貸付有価証券 900株
1384	ホクリョウ	3,900	816.00	3,182,400	貸付有価証券 1,100株
1514	住石ホールディングス	51,000	347.00	17,697,000	貸付有価証券 23,200株
1515	日鉄鉱業	17,200	3,485.00	59,942,000	
1518	三井松島ホールディングス	19,400	3,690.00	71,586,000	貸付有価証券 2,400株
1605	I N P E X	1,587,100	1,344.00	2,133,062,400	貸付有価証券 382,300株
1662	石油資源開発	49,700	4,475.00	222,407,500	
1663	K&Oエナジーグループ	19,500	2,034.00	39,663,000	貸付有価証券 2,900株
1414	ショーボンドホールディングス	58,500	5,340.00	312,390,000	貸付有価証券 10,300株
1417	ミライト・ワン	148,800	1,646.00	244,924,800	貸付有価証券 8,300株
1419	タマホーム	27,000	3,520.00	95,040,000	貸付有価証券 3,500株
1420	サンヨーホームズ	3,300	770.00	2,541,000	貸付有価証券 900株
1429	日本アクア	11,600	889.00	10,312,400	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	880.00	6,248,000	貸付有価証券 1,900株
1433	ベステラ	6,000	891.00	5,346,000	貸付有価証券 1,000株
1435	R o b o t H o m e	73,000	206.00	15,038,000	貸付有価証券 13,200株
1446	キャンディル	4,300	527.00	2,266,100	貸付有価証券 400株
1712	ダイセキ環境ソリューション	5,600	906.00	5,073,600	貸付有価証券 1,200株
1716	第一カッター興業	11,000	1,150.00	12,650,000	貸付有価証券 1,600株
1719	安藤・間	248,600	867.00	215,536,200	
1720	東急建設	122,200	680.00	83,096,000	貸付有価証券

					500株
1721	コムシスホールディングス	145,200	2,448.00	355,449,600	
1726	ビーアールホールディングス	68,100	358.00	24,379,800	
1762	高松コンストラクショングループ	27,900	2,011.00	56,106,900	貸付有価証券 100株
1766	東建コーポレーション	12,300	7,600.00	93,480,000	貸付有価証券 1,800株
1768	ソネック	3,000	988.00	2,964,000	
1780	ヤマウラ	21,700	1,112.00	24,130,400	貸付有価証券 1,100株
1786	オリエンタル白石	154,200	318.00	49,035,600	
1801	大成建設	298,800	4,010.00	1,198,188,000	
1802	大林組	1,073,500	1,002.00	1,075,647,000	
1803	清水建設	902,500	743.00	670,557,500	
1805	飛島建設	33,200	1,070.00	35,524,000	
1808	長谷工コーポレーション	309,800	1,533.00	474,923,400	
1810	松井建設	28,000	667.00	18,676,000	貸付有価証券 700株
1811	銭高組	2,500	3,015.00	7,537,500	貸付有価証券 900株
1812	鹿島建設	665,600	1,574.00	1,047,654,400	
1813	不動テトラ	20,800	1,605.00	33,384,000	
1814	大末建設	7,100	1,178.00	8,363,800	貸付有価証券 500株
1815	鉄建建設	21,500	1,850.00	39,775,000	
1820	西松建設	50,900	3,435.00	174,841,500	貸付有価証券 5,600株
1821	三井住友建設	242,000	384.00	92,928,000	
1822	大豊建設	12,400	3,795.00	47,058,000	
1826	佐田建設	14,500	495.00	7,177,500	
1827	ナカノフドー建設	16,100	364.00	5,860,400	貸付有価証券 3,800株
1833	奥村組	48,700	3,240.00	157,788,000	
1835	東鉄工業	41,300	2,696.00	111,344,800	貸付有価証券 2,700株
1847	イチケン	4,900	1,820.00	8,918,000	
1848	富士ピー・エス	8,700	449.00	3,906,300	貸付有価証券 800株
1852	浅沼組	24,000	3,305.00	79,320,000	貸付有価証券 1,000株
1860	戸田建設	369,300	700.00	258,510,000	
1861	熊谷組	52,000	2,717.00	141,284,000	

1866	北野建設	4,100	3,020.00	12,382,000	貸付有価証券 800株
1867	植木組	5,500	1,347.00	7,408,500	
1870	矢作建設工業	40,800	836.00	34,108,800	
1871	ピーエス三菱	38,000	675.00	25,650,000	
1873	日本ハウスホールディングス	59,500	388.00	23,086,000	貸付有価証券 13,700株
1879	新日本建設	42,100	907.00	38,184,700	貸付有価証券 5,900株
1882	東亜道路工業	6,000	7,260.00	43,560,000	
1884	日本道路	6,000	7,340.00	44,040,000	
1885	東亜建設工業	25,700	2,645.00	67,976,500	貸付有価証券 800株
1887	日本国土開発	90,000	596.00	53,640,000	貸付有価証券 15,500株
1888	若築建設	13,400	3,655.00	48,977,000	貸付有価証券 200株
1890	東洋建設	97,200	940.00	91,368,000	
1893	五洋建設	425,600	624.00	265,574,400	貸付有価証券 23,000株
1898	世紀東急工業	39,600	838.00	33,184,800	
1899	福田組	11,300	4,495.00	50,793,500	貸付有価証券 1,600株
1911	住友林業	230,300	2,587.00	595,786,100	貸付有価証券 58,000株
1914	日本基礎技術	15,700	513.00	8,054,100	貸付有価証券 4,900株
1921	巴コーポレーション	24,500	429.00	10,510,500	貸付有価証券 6,700株
1925	大和ハウス工業	838,900	3,107.00	2,606,462,300	
1926	ライト工業	57,200	1,961.00	112,169,200	
1928	積水ハウス	940,400	2,647.00	2,489,238,800	貸付有価証券 294,800株
1929	日特建設	28,600	970.00	27,742,000	
1930	北陸電気工事	20,600	772.00	15,903,200	貸付有価証券 1,000株
1934	ユアテック	66,100	802.00	53,012,200	
1938	日本リーテック	19,800	897.00	17,760,600	
1939	四電工	12,600	1,914.00	24,116,400	
1941	中電工	46,600	2,191.00	102,100,600	
1942	関電工	164,500	914.00	150,353,000	貸付有価証券 30,200株
1944	きんでん	211,300	1,574.00	332,586,200	貸付有価証券 7,400株

1945	東京エネシス	29,900	890.00	26,611,000	
1946	トーエネック	10,000	3,400.00	34,000,000	貸付有価証券 700株
1949	住友電設	28,600	2,480.00	70,928,000	貸付有価証券 1,200株
1950	日本電設工業	49,300	1,563.00	77,055,900	貸付有価証券 8,900株
1951	エクシオグループ	138,300	2,401.00	332,058,300	
1952	新日本空調	16,700	1,900.00	31,730,000	貸付有価証券 6,500株
1959	九電工	73,000	3,360.00	245,280,000	貸付有価証券 700株
1961	三機工業	66,600	1,453.00	96,769,800	貸付有価証券 400株
1963	日揮ホールディングス	296,900	1,600.00	475,040,000	
1964	中外炉工業	9,800	1,819.00	17,826,200	
1967	ヤマト	16,100	865.00	13,926,500	貸付有価証券 6,900株
1968	太平電業	18,600	3,980.00	74,028,000	貸付有価証券 3,300株
1969	高砂熱学工業	72,400	2,035.00	147,334,000	
1972	三晃金属工業	2,700	3,855.00	10,408,500	
1975	朝日工業社	12,500	2,136.00	26,700,000	
1976	明星工業	51,600	771.00	39,783,600	
1979	大気社	36,100	3,605.00	130,140,500	貸付有価証券 3,300株
1980	ダイダン	19,700	2,384.00	46,964,800	
1982	日比谷総合設備	25,800	2,070.00	53,406,000	
3267	フィル・カンパニー	5,300	1,010.00	5,353,000	貸付有価証券 900株
5074	テスホールディングス	32,300	1,059.00	34,205,700	貸付有価証券 2,800株
5076	インフロニア・ホールディングス	314,600	1,035.00	325,611,000	貸付有価証券 72,300株
6330	東洋エンジニアリング	39,700	539.00	21,398,300	貸付有価証券 5,800株
6379	レイズネクスト	43,400	1,483.00	64,362,200	
2001	ニッポン	81,200	1,655.00	134,386,000	
2002	日清製粉グループ本社	278,700	1,569.00	437,280,300	
2003	日東富士製粉	5,400	4,400.00	23,760,000	貸付有価証券 100株
2004	昭和産業	26,300	2,551.00	67,091,300	貸付有価証券 1,100株
2009	鳥越製粉	15,600	598.00	9,328,800	貸付有価証券 5,300株



2053	中部飼料	41,700	1,042.00	43,451,400	貸付有価証券 200株
2060	フィード・ワン	44,000	674.00	29,656,000	
2107	東洋精糖	3,700	923.00	3,415,100	貸付有価証券 800株
2108	日本甜菜製糖	17,500	1,691.00	29,592,500	貸付有価証券 1,000株
2109	DM三井製糖ホールディングス	29,900	2,044.00	61,115,600	貸付有価証券 200株
2112	塩水港精糖	25,700	205.00	5,268,500	貸付有価証券 5,400株
2117	ウェルネオシュガー	15,600	1,692.00	26,395,200	
2201	森永製菓	55,800	3,835.00	213,993,000	
2204	中村屋	7,500	3,160.00	23,700,000	貸付有価証券 100株
2206	江崎グリコ	86,200	3,310.00	285,322,000	貸付有価証券 19,700株
2207	名糖産業	11,900	1,688.00	20,087,200	
2209	井村屋グループ	16,500	2,239.00	36,943,500	貸付有価証券 1,300株
2211	不二家	20,700	2,462.00	50,963,400	貸付有価証券 2,500株
2212	山崎製パン	201,700	1,580.00	318,686,000	貸付有価証券 39,600株
2215	第一屋製パン	3,700	394.00	1,457,800	貸付有価証券 900株
2217	モロゾフ	9,700	3,405.00	33,028,500	貸付有価証券 1,600株
2220	亀田製菓	19,200	4,335.00	83,232,000	貸付有価証券 4,500株
2222	寿スピリッツ	32,100	8,860.00	284,406,000	
2229	カルビー	138,000	2,822.00	389,436,000	貸付有価証券 7,000株
2264	森永乳業	54,800	4,935.00	270,438,000	
2266	六甲バター	22,100	1,339.00	29,591,900	貸付有価証券 3,900株
2267	ヤクルト本社	215,300	9,470.00	2,038,891,000	
2269	明治ホールディングス	186,800	6,410.00	1,197,388,000	
2270	雪印メグミルク	72,900	1,817.00	132,459,300	
2281	プリマハム	40,500	2,228.00	90,234,000	貸付有価証券 7,400株
2282	日本ハム	117,800	3,930.00	462,954,000	
2286	林兼産業	6,500	481.00	3,126,500	貸付有価証券 1,500株
2288	丸大食品	30,300	1,463.00	44,328,900	

2292	S Foods	33,200	2,842.00	94,354,400	貸付有価証券 4,500株
2294	柿安本店	11,800	2,148.00	25,346,400	貸付有価証券 2,200株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	234,200	718.00	168,155,600	貸付有価証券 5,700株
2501	サッポロホールディングス	99,200	3,355.00	332,816,000	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	696,300	4,810.00	3,349,203,000	貸付有価証券 192,000株
2503	キリンホールディングス	1,359,900	2,064.00	2,806,833,600	貸付有価証券 304,200株
2531	宝ホールディングス	205,700	1,045.00	214,956,500	
2533	オエノンホールディングス	90,100	266.00	23,966,600	貸付有価証券 18,100株
2540	養命酒製造	9,900	1,874.00	18,552,600	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	236,100	1,395.00	329,359,500	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	212,200	4,855.00	1,030,231,000	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	17,100	4,870.00	83,277,000	貸付有価証券 3,500株
2593	伊藤園	102,100	4,325.00	441,582,500	貸付有価証券 14,900株
2594	キーコーヒー	33,800	2,037.00	68,850,600	貸付有価証券 1,800株
2597	ユニカフェ	6,500	895.00	5,817,500	貸付有価証券 1,200株
2599	ジャパンフーズ	3,100	1,103.00	3,419,300	貸付有価証券 300株
2602	日清オイリオグループ	42,400	3,285.00	139,284,000	貸付有価証券 100株
2607	不二製油グループ本社	70,200	1,878.00	131,835,600	
2612	かどや製油	1,900	3,670.00	6,973,000	貸付有価証券 200株
2613	J-オイルミルズ	30,700	1,535.00	47,124,500	
2801	キッコーマン	199,700	6,620.00	1,322,014,000	
2802	味の素	737,500	4,445.00	3,278,187,500	
2804	ブルドックソース	12,000	1,921.00	23,052,000	貸付有価証券 900株
2809	キューピー	162,000	2,222.00	359,964,000	貸付有価証券 39,700株
2810	ハウス食品グループ本社	92,300	2,762.00	254,932,600	貸付有価証券 7,400株
2811	カゴメ	140,400	3,075.00	431,730,000	貸付有価証券 28,200株
2812	焼津水産化学工業	8,700	887.00	7,716,900	貸付有価証券

					300株
2815	アリアケジャパン	26,300	4,770.00	125,451,000	貸付有価証券 2,100株
2818	ピエトロ	2,800	1,877.00	5,255,600	貸付有価証券 200株
2819	エバラ食品工業	8,100	3,130.00	25,353,000	貸付有価証券 400株
2820	やまみ	1,900	1,322.00	2,511,800	貸付有価証券 200株
2871	ニチレイ	138,100	2,708.00	373,974,800	
2875	東洋水産	152,300	5,530.00	842,219,000	貸付有価証券 1,800株
2882	イトアンドホールディングス	12,800	2,233.00	28,582,400	貸付有価証券 1,500株
2883	大冷	2,400	1,919.00	4,605,600	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	19,100	1,082.00	20,666,200	貸付有価証券 2,400株
2897	日清食品ホールディングス	106,000	11,870.00	1,258,220,000	貸付有価証券 5,600株
2899	永谷園ホールディングス	14,800	2,097.00	31,035,600	
2904	一正蒲鉾	8,300	726.00	6,025,800	貸付有価証券 1,700株
2908	フジッコ	31,000	1,866.00	57,846,000	貸付有価証券 6,500株
2910	ロック・フィールド	33,700	1,540.00	51,898,000	貸付有価証券 6,400株
2914	日本たばこ産業	1,983,900	2,738.00	5,431,918,200	貸付有価証券 484,200株
2915	ケンコーマヨネーズ	20,700	1,218.00	25,212,600	
2918	わらべや日洋ホールディングス	22,200	1,773.00	39,360,600	貸付有価証券 4,600株
2922	なとり	18,900	1,968.00	37,195,200	貸付有価証券 1,600株
2924	イフジ産業	3,700	1,027.00	3,799,900	
2929	ファーマフーズ	46,600	1,410.00	65,706,000	貸付有価証券 5,500株
2931	ユーグレナ	194,000	931.00	180,614,000	貸付有価証券 23,000株
2933	紀文食品	23,500	964.00	22,654,000	貸付有価証券 4,000株
2935	ピクルスホールディングス	17,700	1,189.00	21,045,300	貸付有価証券 2,000株
4404	ミヨシ油脂	6,900	947.00	6,534,300	貸付有価証券 1,800株
4526	理研ビタミン	26,000	1,926.00	50,076,000	
3001	片倉工業	28,200	1,780.00	50,196,000	貸付有価証券 5,600株

3002	グンゼ	23,000	4,530.00	104,190,000	貸付有価証券 3,000株
3101	東洋紡	132,500	1,032.00	136,740,000	
3103	ユニチカ	92,500	215.00	19,887,500	貸付有価証券 14,800株
3104	富士紡ホールディングス	12,100	3,210.00	38,841,000	
3106	倉敷紡績	22,900	2,424.00	55,509,600	貸付有価証券 900株
3109	シキボウ	11,000	1,027.00	11,297,000	貸付有価証券 2,000株
3201	日本毛織	80,800	967.00	78,133,600	貸付有価証券 14,300株
3202	ダイトウボウ	34,200	84.00	2,872,800	貸付有価証券 10,200株
3204	トーア紡コーポレーション	7,700	352.00	2,710,400	貸付有価証券 1,600株
3205	ダイドーリミテッド	30,100	303.00	9,120,300	貸付有価証券 7,100株
3302	帝国繊維	34,600	1,650.00	57,090,000	貸付有価証券 5,600株
3401	帝人	294,500	1,359.00	400,225,500	
3402	東レ	2,054,000	747.80	1,535,981,200	
3501	住江織物	3,600	1,999.00	7,196,400	貸付有価証券 1,200株
3512	日本フェルト	11,900	416.00	4,950,400	貸付有価証券 1,000株
3513	イチカワ	2,500	1,362.00	3,405,000	
3524	日東製網	2,300	1,600.00	3,680,000	貸付有価証券 500株
3529	アツギ	15,000	394.00	5,910,000	貸付有価証券 3,600株
3551	ダイニック	6,800	787.00	5,351,600	貸付有価証券 1,600株
3569	セーレン	59,200	2,287.00	135,390,400	貸付有価証券 14,200株
3571	ソトー	7,700	808.00	6,221,600	貸付有価証券 1,700株
3577	東海染工	2,400	1,110.00	2,664,000	
3580	小松マテーレ	44,400	684.00	30,369,600	貸付有価証券 1,400株
3591	ワコールホールディングス	59,100	2,448.00	144,676,800	
3593	ホギメディカル	41,100	3,160.00	129,876,000	
3607	クラウディアホールディングス	4,500	384.00	1,728,000	貸付有価証券 1,300株
3608	T S Iホールディングス	103,200	594.00	61,300,800	貸付有価証券 19,700株

3611	マツオカコーポレーション	6,100	1,382.00	8,430,200	貸付有価証券 1,200株
3612	ワールド	39,400	1,419.00	55,908,600	貸付有価証券 2,300株
8011	三陽商会	9,300	1,441.00	13,401,300	貸付有価証券 2,300株
8013	ナイガイ	7,100	261.00	1,853,100	貸付有価証券 2,800株
8016	オンワードホールディングス	198,800	367.00	72,959,600	貸付有価証券 26,100株
8029	ルックホールディングス	5,700	2,231.00	12,716,700	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	54,300	11,750.00	638,025,000	貸付有価証券 300株
8114	デサント	52,800	4,110.00	217,008,000	貸付有価証券 2,800株
8118	キング	9,900	503.00	4,979,700	貸付有価証券 2,100株
8127	ヤマトインターナショナル	15,600	256.00	3,993,600	貸付有価証券 3,500株
3708	特種東海製紙	13,700	2,979.00	40,812,300	貸付有価証券 300株
3861	王子ホールディングス	1,277,100	527.00	673,031,700	
3863	日本製紙	159,700	1,011.00	161,456,700	貸付有価証券 38,500株
3864	三菱製紙	26,900	350.00	9,415,000	
3865	北越コーポレーション	193,700	858.00	166,194,600	貸付有価証券 39,600株
3877	中越パルプ工業	8,000	998.00	7,984,000	貸付有価証券 200株
3878	巴川製紙所	6,200	681.00	4,222,200	貸付有価証券 1,300株
3880	大王製紙	135,400	1,024.00	138,649,600	
3896	阿波製紙	4,700	688.00	3,233,600	貸付有価証券 1,500株
3941	レンゴー	279,200	844.00	235,644,800	
3946	トーモク	17,700	1,569.00	27,771,300	
3950	ザ・パック	22,800	2,977.00	67,875,600	貸付有価証券 3,300株
2930	北の達人コーポレーション	129,200	333.00	43,023,600	貸付有価証券 20,400株
3405	クラレ	487,400	1,174.00	572,207,600	貸付有価証券 99,500株
3407	旭化成	1,914,500	912.30	1,746,598,350	
3553	共和レザー	11,400	538.00	6,133,200	

4004	レゾナック・ホールディングス	296,300	2,087.00	618,378,100	貸付有価証券 48,000株
4005	住友化学	2,274,200	438.00	996,099,600	
4008	住友精化	12,800	4,360.00	55,808,000	
4021	日産化学	145,600	5,960.00	867,776,000	
4022	ラサ工業	11,800	2,103.00	24,815,400	
4023	クレハ	26,200	8,300.00	217,460,000	貸付有価証券 1,000株
4025	多木化学	11,900	4,610.00	54,859,000	貸付有価証券 1,300株
4027	テイカ	20,600	1,170.00	24,102,000	貸付有価証券 1,700株
4028	石原産業	55,500	1,107.00	61,438,500	
4031	片倉コープアグリ	4,700	1,741.00	8,182,700	貸付有価証券 1,800株
4041	日本曹達	32,900	4,645.00	152,820,500	
4042	東ソー	409,300	1,782.00	729,372,600	
4043	トクヤマ	99,000	2,093.00	207,207,000	
4044	セントラル硝子	49,200	2,939.00	144,598,800	
4045	東亜合成	153,700	1,197.00	183,978,900	貸付有価証券 25,600株
4046	大阪ソーダ	18,400	4,120.00	75,808,000	貸付有価証券 200株
4047	関東電化工業	59,300	1,013.00	60,070,900	
4061	デンカ	111,500	2,715.00	302,722,500	
4063	信越化学工業	509,700	20,960.00	10,683,312,000	
4064	日本カーバイド工業	7,500	1,330.00	9,975,000	
4078	堺化学工業	23,300	1,750.00	40,775,000	貸付有価証券 2,800株
4082	第一稀元素化学工業	27,900	999.00	27,872,100	貸付有価証券 3,500株
4088	エア・ウォーター	289,300	1,651.00	477,634,300	
4091	日本酸素ホールディングス	297,400	2,344.00	697,105,600	
4092	日本化学工業	10,200	1,920.00	19,584,000	
4093	東邦アセチレン	4,200	1,319.00	5,539,800	貸付有価証券 900株
4095	日本パーカライジング	151,800	980.00	148,764,000	貸付有価証券 15,000株
4097	高圧ガス工業	44,500	699.00	31,105,500	
4098	チタン工業	2,400	1,475.00	3,540,000	貸付有価証券 500株
4099	四国化成ホールディングス	36,400	1,373.00	49,977,200	貸付有価証券 6,700株

4100	戸田工業	7,000	2,569.00	17,983,000	貸付有価証券 1,300株
4109	ステラ ケミファ	18,100	2,599.00	47,041,900	
4112	保土谷化学工業	8,700	2,941.00	25,586,700	
4114	日本触媒	46,700	5,230.00	244,241,000	
4116	大日精化工業	21,300	1,762.00	37,530,600	貸付有価証券 900株
4118	カネカ	70,000	3,345.00	234,150,000	
4182	三菱瓦斯化学	228,900	1,935.00	442,921,500	
4183	三井化学	252,800	3,300.00	834,240,000	
4185	J S R	286,200	3,120.00	892,944,000	
4186	東京応化工業	53,600	7,510.00	402,536,000	貸付有価証券 7,400株
4187	大阪有機化学工業	23,100	2,134.00	49,295,400	貸付有価証券 4,000株
4188	三菱ケミカルグループ	2,068,800	765.70	1,584,080,160	
4189	KHネオケム	51,000	2,258.00	115,158,000	貸付有価証券 7,600株
4202	ダイセル	450,800	972.00	438,177,600	
4203	住友ベークライト	45,400	4,900.00	222,460,000	
4204	積水化学工業	627,000	1,843.00	1,155,561,000	
4205	日本ゼオン	183,900	1,389.00	255,437,100	
4206	アイカ工業	77,400	3,015.00	233,361,000	
4208	U B E	158,000	2,015.00	318,370,000	貸付有価証券 12,000株
4212	積水樹脂	44,600	2,047.00	91,296,200	
4215	タキロンシーアイ	67,000	495.00	33,165,000	
4216	旭有機材	20,400	3,115.00	63,546,000	
4218	ニチバン	19,000	1,888.00	35,872,000	貸付有価証券 1,000株
4220	リケンテクノス	66,000	574.00	37,884,000	
4221	大倉工業	14,200	1,979.00	28,101,800	貸付有価証券 2,000株
4228	積水化成成品工業	43,000	412.00	17,716,000	
4229	群栄化学工業	7,200	2,529.00	18,208,800	
4231	タイガースポリマー	10,100	449.00	4,534,900	貸付有価証券 300株
4238	ミライアル	6,700	1,628.00	10,907,600	貸付有価証券 1,500株
4245	ダイキアクシス	7,300	697.00	5,088,100	貸付有価証券 1,600株
4246	ダイキョーニシカワ	67,700	638.00	43,192,600	

4248	竹本容器	6,700	835.00	5,594,500	貸付有価証券 1,600株
4249	森六ホールディングス	15,500	1,840.00	28,520,000	
4251	恵和	19,800	1,489.00	29,482,200	貸付有価証券 2,400株
4272	日本化薬	234,200	1,176.00	275,419,200	
4275	カーリットホールディングス	27,500	685.00	18,837,500	貸付有価証券 800株
4362	日本精化	17,400	2,524.00	43,917,600	
4368	扶桑化学工業	28,500	3,695.00	105,307,500	
4369	トリケミカル研究所	40,900	2,389.00	97,710,100	貸付有価証券 5,900株
4401	ADEKA	106,900	2,181.00	233,148,900	
4403	日油	94,800	5,970.00	565,956,000	
4406	新日本理化	29,800	208.00	6,198,400	貸付有価証券 7,500株
4410	ハリマ化成グループ	13,900	911.00	12,662,900	貸付有価証券 3,600株
4452	花王	746,500	5,121.00	3,822,826,500	貸付有価証券 158,400株
4461	第一工業製薬	11,000	1,870.00	20,570,000	
4462	石原ケミカル	14,000	1,390.00	19,460,000	
4463	日華化学	8,000	824.00	6,592,000	貸付有価証券 1,500株
4465	ニイタカ	3,900	2,042.00	7,963,800	貸付有価証券 700株
4471	三洋化成工業	18,900	4,370.00	82,593,000	
4531	有機合成薬品工業	14,700	292.00	4,292,400	貸付有価証券 4,600株
4611	大日本塗料	37,400	841.00	31,453,400	貸付有価証券 4,000株
4612	日本ペイントホールディングス	1,356,600	1,193.00	1,618,423,800	貸付有価証券 176,400株
4613	関西ペイント	280,800	1,776.00	498,700,800	
4615	神東塗料	16,500	135.00	2,227,500	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	50,400	1,066.00	53,726,400	
4619	日本特殊塗料	12,600	932.00	11,743,200	貸付有価証券 500株
4620	藤倉化成	41,200	430.00	17,716,000	
4626	太陽ホールディングス	46,600	2,473.00	115,241,800	
4631	D I C	119,800	2,321.00	278,055,800	貸付有価証券 25,200株
4633	サカティンクス	68,200	1,007.00	68,677,400	貸付有価証券 13,700株



4634	東洋インキSCホールディングス	60,000	1,991.00	119,460,000	貸付有価証券 9,200株
4636	T&K TOKA	27,200	1,079.00	29,348,800	貸付有価証券 1,400株
4901	富士フイルムホールディングス	589,000	6,493.00	3,824,377,000	
4911	資生堂	640,900	6,008.00	3,850,527,200	貸付有価証券 120,900株
4912	ライオン	368,300	1,449.00	533,666,700	貸付有価証券 55,600株
4914	高砂香料工業	20,800	2,618.00	54,454,400	
4917	マンダム	66,300	1,469.00	97,394,700	貸付有価証券 2,700株
4919	ミルボン	45,500	5,450.00	247,975,000	貸付有価証券 5,700株
4921	ファンケル	134,300	2,492.00	334,675,600	
4922	コーセー	62,400	15,530.00	969,072,000	貸付有価証券 8,300株
4923	コタ	25,700	1,715.00	44,075,500	貸付有価証券 2,900株
4926	シーボン	2,800	1,616.00	4,524,800	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	157,400	1,709.00	268,996,600	貸付有価証券 18,900株
4928	ノエビアホールディングス	27,400	5,380.00	147,412,000	貸付有価証券 4,700株
4929	アジュバンホールディングス	4,800	981.00	4,708,800	貸付有価証券 1,500株
4931	新日本製薬	17,500	1,462.00	25,585,000	
4936	アクシージア	10,500	1,143.00	12,001,500	
4951	エステー	23,700	1,567.00	37,137,900	
4955	アグロ カネショウ	12,300	1,640.00	20,172,000	貸付有価証券 1,700株
4956	コニシ	51,300	1,849.00	94,853,700	貸付有価証券 1,000株
4958	長谷川香料	63,500	2,798.00	177,673,000	
4963	星光PMC	10,100	530.00	5,353,000	貸付有価証券 2,500株
4967	小林製薬	89,300	8,020.00	716,186,000	貸付有価証券 19,800株
4968	荒川化学工業	26,000	999.00	25,974,000	貸付有価証券 1,400株
4971	メック	25,300	2,463.00	62,313,900	貸付有価証券 3,000株
4973	日本高純度化学	7,600	2,667.00	20,269,200	
4974	タカラバイオ	82,700	1,751.00	144,807,700	
4975	JCU	34,700	3,305.00	114,683,500	

4977	新田ゼラチン	12,300	869.00	10,688,700	
4979	OATアグリオ	8,100	1,412.00	11,437,200	貸付有価証券 1,600株
4980	デクセリアルズ	88,600	2,651.00	234,878,600	
4985	アース製薬	27,800	4,670.00	129,826,000	貸付有価証券 4,700株
4992	北興化学工業	30,900	807.00	24,936,300	貸付有価証券 5,600株
4994	大成ラミック	9,700	2,898.00	28,110,600	
4996	クミアイ化学工業	121,900	837.00	102,030,300	貸付有価証券 17,500株
4997	日本農薬	56,300	666.00	37,495,800	貸付有価証券 7,900株
5142	アキレス	20,000	1,366.00	27,320,000	
5208	有沢製作所	49,700	1,336.00	66,399,200	
6988	日東電工	222,800	8,430.00	1,878,204,000	
7874	レック	43,700	843.00	36,839,100	貸付有価証券 500株
7888	三光合成	38,600	569.00	21,963,400	貸付有価証券 5,400株
7908	きもと	32,900	200.00	6,580,000	
7917	藤森工業	24,300	3,135.00	76,180,500	貸付有価証券 500株
7925	前澤化成工業	19,800	1,470.00	29,106,000	
7931	未来工業	11,000	1,714.00	18,854,000	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	7,900	609.00	4,811,100	貸付有価証券 400株
7942	J S P	21,600	1,574.00	33,998,400	貸付有価証券 1,700株
7947	エフピコ	58,100	3,155.00	183,305,500	
7958	天馬	26,100	2,304.00	60,134,400	
7970	信越ポリマー	56,700	1,460.00	82,782,000	
7971	東リ	49,000	272.00	13,328,000	貸付有価証券 3,300株
7988	ニフコ	110,700	3,620.00	400,734,000	
7995	バルカー	25,700	3,475.00	89,307,500	貸付有価証券 1,400株
8113	ユニ・チャーム	639,500	5,338.00	3,413,651,000	貸付有価証券 88,700株
9385	ショーエイコーポレーション	5,700	580.00	3,306,000	貸付有価証券 600株
4151	協和キリン	370,800	2,870.00	1,064,196,000	貸付有価証券 82,700株
4502	武田薬品工業	2,716,500	4,295.00	11,667,367,500	

4503	アステラス製薬	2,941,700	1,866.50	5,490,683,050	
4506	住友ファーマ	227,700	809.00	184,209,300	
4507	塩野義製薬	392,300	5,961.00	2,338,500,300	
4512	わかもと製薬	20,900	239.00	4,995,100	貸付有価証券 6,800株
4516	日本新薬	72,400	5,900.00	427,160,000	貸付有価証券 1,100株
4519	中外製薬	960,900	3,271.00	3,143,103,900	貸付有価証券 281,900株
4521	科研製薬	52,600	3,765.00	198,039,000	貸付有価証券 200株
4523	エーザイ	373,400	7,303.00	2,726,940,200	
4527	ロート製薬	297,300	2,649.00	787,547,700	
4528	小野薬品工業	592,200	2,749.00	1,627,957,800	
4530	久光製薬	68,200	3,690.00	251,658,000	貸付有価証券 14,400株
4534	持田製薬	36,800	3,335.00	122,728,000	
4536	参天製薬	577,700	1,142.00	659,733,400	
4538	扶桑薬品工業	9,700	2,012.00	19,516,400	
4539	日本ケミファ	2,300	1,803.00	4,146,900	貸付有価証券 1,100株
4540	ツムラ	96,600	2,619.00	252,995,400	
4547	キッセイ薬品工業	47,400	2,623.00	124,330,200	
4548	生化学工業	58,500	796.00	46,566,000	貸付有価証券 2,300株
4549	栄研化学	49,800	1,563.00	77,837,400	
4551	鳥居薬品	16,500	3,070.00	50,655,000	貸付有価証券 2,700株
4552	JCRファーマ	103,900	1,543.00	160,317,700	貸付有価証券 3,900株
4553	東和薬品	47,200	1,904.00	89,868,800	
4554	富士製薬工業	19,800	1,122.00	22,215,600	
4559	ゼリア新薬工業	42,600	2,201.00	93,762,600	貸付有価証券 5,800株
4565	そーせいグループ	84,800	2,141.00	181,556,800	
4568	第一三共	2,674,200	4,694.00	12,552,694,800	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	66,600	1,709.00	113,819,400	貸付有価証券 1,600株
4574	大幸薬品	55,600	378.00	21,016,800	貸付有価証券 6,500株
4577	ダイト	21,500	2,449.00	52,653,500	貸付有価証券 2,600株
4578	大塚ホールディングス	702,300	4,018.00	2,821,841,400	貸付有価証券

					180,900株
4581	大正製薬ホールディングス	68,200	5,480.00	373,736,000	貸付有価証券 600株
4587	ペプチドリーム	148,800	1,789.00	266,203,200	貸付有価証券 22,400株
4886	あすか製薬ホールディングス	31,500	1,180.00	37,170,000	貸付有価証券 1,000株
4887	サワイグループホールディングス	70,200	3,660.00	256,932,000	
3315	日本コークス工業	276,800	83.00	22,974,400	貸付有価証券 49,600株
5011	ニチレキ	36,300	1,523.00	55,284,900	貸付有価証券 400株
5013	ユシロ化学工業	15,900	833.00	13,244,700	
5015	ビービー・カストロール	7,700	895.00	6,891,500	貸付有価証券 1,600株
5017	富士石油	62,600	260.00	16,276,000	
5018	MORESCO	7,100	1,156.00	8,207,600	貸付有価証券 1,600株
5019	出光興産	340,900	2,903.00	989,632,700	
5020	ENEOSホールディングス	5,545,800	464.30	2,574,914,940	
5021	コスモエネルギーホールディングス	121,300	4,020.00	487,626,000	
5101	横浜ゴム	174,700	2,615.00	456,840,500	貸付有価証券 42,200株
5105	TOYO TIRE	176,400	1,477.00	260,542,800	貸付有価証券 25,400株
5108	ブリヂストン	980,200	5,217.00	5,113,703,400	貸付有価証券 243,100株
5110	住友ゴム工業	301,100	1,139.00	342,952,900	貸付有価証券 41,100株
5121	藤倉コンポジット	17,200	984.00	16,924,800	
5122	オカモト	17,000	3,865.00	65,705,000	
5185	フコク	16,100	1,019.00	16,405,900	
5186	ニッタ	31,200	2,927.00	91,322,400	
5191	住友理工	59,500	661.00	39,329,500	
5192	三ツ星ベルト	44,800	3,965.00	177,632,000	貸付有価証券 1,000株
5195	バンドー化学	48,600	1,059.00	51,467,400	
3110	日東紡績	34,500	2,020.00	69,690,000	
5201	AGC	312,400	4,795.00	1,497,958,000	貸付有価証券 82,000株
5202	日本板硝子	156,500	594.00	92,961,000	貸付有価証券 24,600株
5204	石塚硝子	3,400	1,496.00	5,086,400	貸付有価証券 1,100株

5210	日本山村硝子	7,400	638.00	4,721,200	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	125,300	2,477.00	310,368,100	貸付有価証券 30,600株
5218	オハラ	14,600	1,116.00	16,293,600	貸付有価証券 1,700株
5232	住友大阪セメント	43,200	3,660.00	158,112,000	貸付有価証券 2,500株
5233	太平洋セメント	195,500	2,433.00	475,651,500	貸付有価証券 16,800株
5262	日本ヒューム	26,900	704.00	18,937,600	貸付有価証券 1,000株
5269	日本コンクリート工業	59,500	249.00	14,815,500	貸付有価証券 7,600株
5273	三谷セキサン	12,900	4,345.00	56,050,500	貸付有価証券 100株
5288	アジアパイルホールディングス	48,000	729.00	34,992,000	
5301	東海カーボン	257,500	1,209.00	311,317,500	貸付有価証券 62,000株
5302	日本カーボン	17,600	3,955.00	69,608,000	貸付有価証券 2,300株
5310	東洋炭素	19,200	3,910.00	75,072,000	貸付有価証券 2,600株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	15,300	4,550.00	69,615,000	貸付有価証券 500株
5332	TOTO	202,600	4,385.00	888,401,000	貸付有価証券 15,000株
5333	日本碍子	363,200	1,740.00	631,968,000	
5334	日本特殊陶業	233,700	2,762.00	645,479,400	貸付有価証券 3,000株
5337	ダントーホールディングス	14,000	514.00	7,196,000	貸付有価証券 3,300株
5344	MARUWA	11,300	17,650.00	199,445,000	
5351	品川リフラクトリーズ	8,600	4,485.00	38,571,000	
5352	黒崎播磨	6,300	6,380.00	40,194,000	
5357	ヨータイ	20,500	1,457.00	29,868,500	貸付有価証券 1,000株
5363	東京窯業	21,200	327.00	6,932,400	貸付有価証券 600株
5367	ニッカトー	8,900	639.00	5,687,100	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	24,400	6,920.00	168,848,000	
5388	クニミネ工業	6,700	934.00	6,257,800	
5391	エーアンドエーマテリアル	3,600	924.00	3,326,400	貸付有価証券 800株
5393	ニチアス	77,600	2,629.00	204,010,400	貸付有価証券 100株

7943	ニチハ	38,400	2,653.00	101,875,200	貸付有価証券 6,900株
5401	日本製鉄	1,414,000	2,998.00	4,239,172,000	
5406	神戸製鋼所	635,100	1,006.00	638,910,600	
5408	中山製鋼所	65,000	918.00	59,670,000	
5410	合同製鐵	15,700	3,215.00	50,475,500	
5411	J F Eホールディングス	843,900	1,607.00	1,356,147,300	
5423	東京製鐵	88,700	1,321.00	117,172,700	貸付有価証券 14,400株
5440	共英製鋼	36,000	1,558.00	56,088,000	貸付有価証券 4,900株
5444	大和工業	52,100	5,260.00	274,046,000	貸付有価証券 700株
5445	東京鐵鋼	15,000	1,720.00	25,800,000	
5449	大阪製鐵	14,500	1,242.00	18,009,000	
5451	淀川製鋼所	35,900	2,659.00	95,458,100	貸付有価証券 700株
5461	中部鋼板	25,900	2,275.00	58,922,500	貸付有価証券 3,700株
5463	丸一鋼管	96,100	2,820.00	271,002,000	
5464	モリ工業	5,200	3,500.00	18,200,000	貸付有価証券 400株
5471	大同特殊鋼	39,800	5,080.00	202,184,000	
5476	日本高周波鋼業	7,800	367.00	2,862,600	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	23,100	4,095.00	94,594,500	貸付有価証券 500株
5481	山陽特殊製鋼	31,200	2,418.00	75,441,600	貸付有価証券 1,100株
5482	愛知製鋼	18,200	2,222.00	40,440,400	
5491	日本金属	5,300	920.00	4,876,000	貸付有価証券 1,000株
5541	大平洋金属	22,400	1,872.00	41,932,800	
5563	新日本電工	201,800	340.00	68,612,000	貸付有価証券 34,900株
5602	栗本鐵工所	15,000	1,983.00	29,745,000	
5603	虹技	2,700	1,014.00	2,737,800	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	2,200	981.00	2,158,200	貸付有価証券 500株
5632	三菱製鋼	19,800	1,152.00	22,809,600	
5658	日亜鋼業	24,100	289.00	6,964,900	貸付有価証券 7,400株
5659	日本精線	4,300	4,620.00	19,866,000	貸付有価証券 700株

5698	エンビプロ・ホールディングス	14,100	596.00	8,403,600	貸付有価証券 3,200株
6319	シンニッタン	25,700	253.00	6,502,100	貸付有価証券 4,500株
7305	新家工業	4,400	2,289.00	10,071,600	
5702	大紀アルミニウム工業所	44,900	1,427.00	64,072,300	
5703	日本軽金属ホールディングス	85,100	1,455.00	123,820,500	
5706	三井金属鉱業	91,900	3,235.00	297,296,500	
5707	東邦亜鉛	18,700	2,011.00	37,605,700	貸付有価証券 1,800株
5711	三菱マテリアル	210,700	2,084.00	439,098,800	
5713	住友金属鉱山	366,100	4,951.00	1,812,561,100	
5714	DOWAホールディングス	70,900	4,185.00	296,716,500	
5715	古河機械金属	46,300	1,283.00	59,402,900	
5721	エス・サイエンス	94,300	25.00	2,357,500	貸付有価証券 28,200株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	46,300	3,190.00	147,697,000	貸付有価証券 4,600株
5727	東邦チタニウム	57,100	2,257.00	128,874,700	貸付有価証券 8,600株
5741	UACJ	44,300	2,566.00	113,673,800	貸付有価証券 1,100株
5757	CKサンエツ	7,600	4,195.00	31,882,000	
5801	古河電気工業	105,100	2,384.00	250,558,400	
5802	住友電気工業	1,090,400	1,641.00	1,789,346,400	
5803	フジクラ	338,600	905.00	306,433,000	
5805	昭和電線ホールディングス	35,300	1,838.00	64,881,400	
5809	タツタ電線	64,200	710.00	45,582,000	貸付有価証券 8,700株
5819	カナレ電気	3,100	1,241.00	3,847,100	貸付有価証券 700株
5821	平河ヒューテック	18,200	1,479.00	26,917,800	貸付有価証券 1,000株
5851	リョービ	33,600	1,454.00	48,854,400	貸付有価証券 6,000株
5852	アーレスティ	22,600	484.00	10,938,400	
5857	アサヒホールディングス	127,700	2,010.00	256,677,000	
3421	稲葉製作所	18,500	1,432.00	26,492,000	貸付有価証券 2,500株
3431	宮地エンジニアリンググループ	8,700	3,690.00	32,103,000	
3433	トーカロ	86,800	1,284.00	111,451,200	
3434	アルファC o	7,500	1,009.00	7,567,500	

3436	SUMCO	601,200	1,948.00	1,171,137,600	貸付有価証券 86,700株
3443	川田テクノロジーズ	7,400	3,735.00	27,639,000	
3445	RS Technologies	21,100	3,155.00	66,570,500	貸付有価証券 3,000株
3446	ジェイテックコーポレーション	2,700	2,675.00	7,222,500	貸付有価証券 700株
3447	信和	13,100	730.00	9,563,000	貸付有価証券 300株
5901	東洋製罐グループホールディングス	209,000	1,765.00	368,885,000	
5902	ホッカンホールディングス	17,000	1,364.00	23,188,000	
5909	コロナ	17,600	916.00	16,121,600	
5911	横河ブリッジホールディングス	41,700	2,101.00	87,611,700	
5915	駒井ハルテック	3,300	1,714.00	5,656,200	貸付有価証券 1,100株
5923	高田機工	1,800	2,750.00	4,950,000	貸付有価証券 100株
5929	三和ホールディングス	290,800	1,398.00	406,538,400	貸付有価証券 6,800株
5930	文化シャッター	90,900	1,093.00	99,353,700	貸付有価証券 7,100株
5932	三協立山	36,100	699.00	25,233,900	貸付有価証券 6,400株
5933	アルインコ	24,100	1,040.00	25,064,000	貸付有価証券 4,100株
5936	東洋シャッター	4,700	520.00	2,444,000	貸付有価証券 1,200株
5938	LIXIL	460,100	2,119.00	974,951,900	
5942	日本フィルコン	13,300	456.00	6,064,800	貸付有価証券 5,000株
5943	ノーリツ	46,500	1,698.00	78,957,000	貸付有価証券 11,900株
5946	長府製作所	31,800	2,126.00	67,606,800	貸付有価証券 5,300株
5947	リンナイ	57,300	9,520.00	545,496,000	
5951	ダイニチ工業	10,100	681.00	6,878,100	貸付有価証券 600株
5957	日東精工	45,800	548.00	25,098,400	貸付有価証券 6,100株
5958	三洋工業	2,600	1,879.00	4,885,400	
5959	岡部	50,800	759.00	38,557,200	貸付有価証券 8,900株
5970	ジーテクト	35,200	1,406.00	49,491,200	
5975	東プレ	55,600	1,173.00	65,218,800	貸付有価証券 8,200株
5976	高周波熱錬	51,500	682.00	35,123,000	貸付有価証券



					12,800株
5981	東京製綱	18,600	1,150.00	21,390,000	
5985	サンコール	18,100	591.00	10,697,100	
5986	モリテック スチール	16,500	314.00	5,181,000	貸付有価証券 4,500株
5988	パイオラックス	43,600	1,891.00	82,447,600	
5989	エイチワン	32,500	619.00	20,117,500	貸付有価証券 300株
5991	日本発條	279,300	921.00	257,235,300	貸付有価証券 1,500株
5992	中央発條	17,500	711.00	12,442,500	貸付有価証券 800株
5998	アドバネクス	2,800	1,175.00	3,290,000	貸付有価証券 600株
7989	立川ブラインド工業	14,300	1,286.00	18,389,800	貸付有価証券 1,900株
8155	三益半導体工業	24,400	2,816.00	68,710,400	貸付有価証券 3,900株
1909	日本ドライケミカル	4,800	1,755.00	8,424,000	
5631	日本製鋼所	85,100	2,453.00	208,750,300	
6005	三浦工業	129,100	3,310.00	427,321,000	貸付有価証券 2,100株
6013	タクマ	95,000	1,308.00	124,260,000	
6101	ツガミ	68,700	1,400.00	96,180,000	貸付有価証券 4,500株
6103	オークマ	30,900	5,760.00	177,984,000	
6104	芝浦機械	30,900	3,005.00	92,854,500	貸付有価証券 1,500株
6113	アマダ	493,200	1,226.00	604,663,200	
6118	アイダエンジニアリング	63,600	815.00	51,834,000	
6121	TAKISAWA	6,100	1,220.00	7,442,000	
6134	FUJ I	134,400	2,191.00	294,470,400	
6135	牧野フライス製作所	34,200	4,700.00	160,740,000	
6136	オーエスジー	147,600	1,923.00	283,834,800	貸付有価証券 20,200株
6138	ダイジェット工業	2,200	836.00	1,839,200	貸付有価証券 100株
6140	旭ダイヤモンド工業	86,300	898.00	77,497,400	
6141	DMG森精機	187,400	2,112.00	395,788,800	貸付有価証券 42,600株
6143	ソディック	85,200	741.00	63,133,200	貸付有価証券 10,600株
6146	ディスコ	49,600	44,400.00	2,202,240,000	
6151	日東工器	15,000	1,820.00	27,300,000	

6157	日進工具	25,800	1,032.00	26,625,600	貸付有価証券 1,500株
6165	パンチ工業	18,200	445.00	8,099,000	貸付有価証券 1,300株
6167	富士ダイス	10,700	886.00	9,480,200	貸付有価証券 3,500株
6203	豊和工業	10,900	881.00	9,602,900	貸付有価証券 3,400株
6208	石川製作所	5,500	1,361.00	7,485,500	貸付有価証券 1,000株
6210	東洋機械金属	13,800	598.00	8,252,400	貸付有価証券 300株
6217	津田駒工業	3,600	521.00	1,875,600	貸付有価証券 900株
6218	エンシュウ	4,700	671.00	3,153,700	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	49,200	1,837.00	90,380,400	貸付有価証券 2,500株
6235	オプトラン	45,700	2,157.00	98,574,900	貸付有価証券 4,900株
6236	NCホールディングス	5,400	1,910.00	10,314,000	貸付有価証券 1,700株
6237	イワキポンプ	20,600	1,277.00	26,306,200	
6238	フリー	32,400	1,205.00	39,042,000	貸付有価証券 500株
6240	ヤマシンフィルタ	73,700	333.00	24,542,100	貸付有価証券 1,500株
6247	日阪製作所	30,000	894.00	26,820,000	貸付有価証券 3,200株
6250	やまびこ	50,500	1,270.00	64,135,000	貸付有価証券 8,500株
6254	野村マイクロ・サイエンス	10,500	4,155.00	43,627,500	貸付有価証券 400株
6258	平田機工	14,800	6,620.00	97,976,000	貸付有価証券 500株
6262	ペガサスマシン製造	34,100	632.00	21,551,200	
6264	マルマエ	14,900	1,844.00	27,475,600	貸付有価証券 2,500株
6266	タツモ	17,000	2,159.00	36,703,000	貸付有価証券 2,000株
6268	ナプテスコ	194,000	3,145.00	610,130,000	貸付有価証券 25,800株
6269	三井海洋開発	38,700	1,348.00	52,167,600	貸付有価証券 4,700株
6272	レオン自動機	32,500	1,307.00	42,477,500	
6273	SMC	100,200	68,510.00	6,864,702,000	
6277	ホソカワミクロン	23,700	2,843.00	67,379,100	貸付有価証券 3,200株

6278	ユニオンツール	13,600	3,210.00	43,656,000	貸付有価証券 1,600株
6282	オイレス工業	43,200	1,678.00	72,489,600	貸付有価証券 8,500株
6284	日精エー・エス・ビー機械	14,100	3,870.00	54,567,000	
6287	サトーホールディングス	44,000	2,192.00	96,448,000	貸付有価証券 6,200株
6289	技研製作所	32,300	2,699.00	87,177,700	貸付有価証券 3,800株
6291	日本エアージェット	15,600	1,115.00	17,394,000	貸付有価証券 1,600株
6292	カワタ	6,300	847.00	5,336,100	貸付有価証券 1,900株
6293	日精樹脂工業	22,900	1,011.00	23,151,900	貸付有価証券 2,500株
6294	オカダアイヨン	6,700	1,754.00	11,751,800	貸付有価証券 1,700株
6298	ワイエイシイホールディングス	8,500	2,735.00	23,247,500	
6301	小松製作所	1,448,400	3,238.00	4,689,919,200	
6302	住友重機械工業	182,900	3,100.00	566,990,000	貸付有価証券 25,300株
6305	日立建機	123,100	2,963.00	364,745,300	
6306	日工	45,800	641.00	29,357,800	
6309	巴工業	13,300	2,376.00	31,600,800	貸付有価証券 1,900株
6310	井関農機	28,900	1,150.00	33,235,000	貸付有価証券 5,200株
6315	TOWA	31,500	2,070.00	65,205,000	貸付有価証券 2,300株
6316	丸山製作所	3,300	1,773.00	5,850,900	貸付有価証券 1,000株
6317	北川鉄工所	12,200	1,062.00	12,956,400	貸付有価証券 1,300株
6323	ローツェ	16,200	11,490.00	186,138,000	貸付有価証券 2,700株
6325	タカキタ	6,500	415.00	2,697,500	貸付有価証券 2,300株
6326	クボタ	1,635,800	1,913.00	3,129,285,400	貸付有価証券 327,600株
6328	荏原実業	14,800	2,723.00	40,300,400	貸付有価証券 2,100株
6331	三菱化工機	10,000	2,270.00	22,700,000	
6332	月島機械	41,800	1,090.00	45,562,000	
6333	帝国電機製作所	22,400	2,450.00	54,880,000	貸付有価証券 2,600株
6335	東京機械製作所	6,200	507.00	3,143,400	貸付有価証券 1,900株

6339	新東工業	62,500	811.00	50,687,500	
6340	澁谷工業	29,000	2,380.00	69,020,000	貸付有価証券 4,000株
6345	アイチ コーポレーション	43,700	815.00	35,615,500	
6349	小森コーポレーション	71,600	946.00	67,733,600	貸付有価証券 11,100株
6351	鶴見製作所	23,600	2,008.00	47,388,800	
6356	日本ギア工業	7,600	511.00	3,883,600	貸付有価証券 1,300株
6358	酒井重工業	3,500	3,970.00	13,895,000	
6361	荏原製作所	126,500	5,950.00	752,675,000	貸付有価証券 28,600株
6362	石井鐵工所	2,500	2,285.00	5,712,500	
6363	西島製作所	26,700	1,535.00	40,984,500	貸付有価証券 2,100株
6364	北越工業	31,100	1,358.00	42,233,800	貸付有価証券 700株
6367	ダイキン工業	369,000	23,050.00	8,505,450,000	貸付有価証券 25,700株
6368	オルガノ	42,400	3,405.00	144,372,000	
6369	トーヨーカネツ	11,700	2,699.00	31,578,300	
6370	栗田工業	172,900	5,920.00	1,023,568,000	貸付有価証券 2,200株
6371	椿本チエイン	43,800	3,210.00	140,598,000	
6373	大同工業	8,700	752.00	6,542,400	貸付有価証券 2,100株
6378	木村化工機	23,600	657.00	15,505,200	貸付有価証券 4,900株
6381	アネスト岩田	52,600	982.00	51,653,200	
6383	ダイフク	159,400	7,210.00	1,149,274,000	
6387	サムコ	10,100	4,310.00	43,531,000	貸付有価証券 1,500株
6390	加藤製作所	10,200	969.00	9,883,800	貸付有価証券 2,400株
6393	油研工業	3,300	2,007.00	6,623,100	
6395	タダノ	163,000	996.00	162,348,000	貸付有価証券 27,500株
6406	フジテック	113,200	3,010.00	340,732,000	貸付有価証券 8,000株
6407	CKD	85,500	2,144.00	183,312,000	貸付有価証券 1,600株
6412	平和	102,800	2,558.00	262,962,400	
6413	理想科学工業	27,500	2,346.00	64,515,000	貸付有価証券 1,200株
6417	SANKYO	60,700	5,520.00	335,064,000	

6418	日本金銭機械	34,000	1,141.00	38,794,000	貸付有価証券 1,100株
6419	マースグループホールディングス	18,200	3,015.00	54,873,000	
6420	フクシマガリレイ	22,700	4,610.00	104,647,000	
6428	オーイズミ	7,500	495.00	3,712,500	貸付有価証券 1,900株
6430	ダイコク電機	16,900	3,035.00	51,291,500	
6432	竹内製作所	56,100	2,831.00	158,819,100	貸付有価証券 8,500株
6436	アマノ	87,700	2,509.00	220,039,300	貸付有価証券 4,300株
6440	JUKI	47,900	609.00	29,171,100	貸付有価証券 6,200株
6444	サンデン	29,800	204.00	6,079,200	貸付有価証券 9,500株
6445	ジャノメ	31,300	621.00	19,437,300	貸付有価証券 2,600株
6454	マックス	38,100	2,107.00	80,276,700	
6457	グローリー	80,100	2,876.00	230,367,600	
6458	新晃工業	31,100	1,645.00	51,159,500	貸付有価証券 1,000株
6459	大和冷機工業	47,400	1,304.00	61,809,600	貸付有価証券 6,400株
6460	セガサミーホールディングス	248,500	2,434.00	604,849,000	
6461	日本ピストンリング	7,800	1,389.00	10,834,200	貸付有価証券 400株
6462	リケン	12,200	2,554.00	31,158,800	
6463	T P R	35,300	1,326.00	46,807,800	貸付有価証券 300株
6464	ツバキ・ナカシマ	76,200	957.00	72,923,400	貸付有価証券 11,400株
6465	ホシザキ	199,000	4,755.00	946,245,000	貸付有価証券 36,200株
6470	大豊工業	26,700	624.00	16,660,800	
6471	日本精工	567,900	734.00	416,838,600	
6472	N T N	609,400	319.00	194,398,600	
6473	ジェイテクト	275,000	971.00	267,025,000	
6474	不二越	22,800	3,825.00	87,210,000	貸付有価証券 3,900株
6480	日本トムソン	75,700	576.00	43,603,200	
6481	T H K	178,400	2,964.00	528,777,600	貸付有価証券 25,800株
6482	ユーシン精機	24,500	738.00	18,081,000	貸付有価証券 1,400株
6485	前澤給装工業	21,700	966.00	20,962,200	

6486	イーグル工業	34,200	1,156.00	39,535,200	
6489	前澤工業	12,900	662.00	8,539,800	貸付有価証券 3,000株
6490	日本ビラー工業	28,700	3,690.00	105,903,000	貸付有価証券 2,700株
6498	キッツ	113,800	918.00	104,468,400	貸付有価証券 18,000株
6586	マキタ	384,600	3,270.00	1,257,642,000	
7003	三井E&Sホールディングス	142,100	405.00	57,550,500	貸付有価証券 17,100株
7004	日立造船	253,300	851.00	215,558,300	貸付有価証券 15,500株
7011	三菱重工業	540,600	4,655.00	2,516,493,000	
7013	I H I	194,700	3,205.00	624,013,500	
7022	サノヤスホールディングス	24,300	131.00	3,183,300	貸付有価証券 5,400株
7718	スター精密	58,300	1,774.00	103,424,200	貸付有価証券 6,900株
3105	日清紡ホールディングス	251,600	976.00	245,561,600	貸付有価証券 29,500株
4062	イビデン	177,300	4,880.00	865,224,000	貸付有価証券 700株
4902	コニカミノルタ	690,400	560.00	386,624,000	
6448	ブラザー工業	413,000	1,968.00	812,784,000	
6479	ミネベアミツミ	537,700	2,432.00	1,307,686,400	貸付有価証券 3,800株
6501	日立製作所	1,503,100	6,990.00	10,506,669,000	
6502	東芝	594,900	4,357.00	2,591,979,300	
6503	三菱電機	3,194,800	1,551.00	4,955,134,800	
6504	富士電機	188,000	5,080.00	955,040,000	貸付有価証券 16,100株
6505	東洋電機製造	7,100	900.00	6,390,000	貸付有価証券 1,700株
6506	安川電機	366,300	5,610.00	2,054,943,000	貸付有価証券 109,700株
6507	シンフォニアテクノロジー	34,100	1,620.00	55,242,000	
6508	明電舎	46,900	1,881.00	88,218,900	
6513	オリジン	4,900	1,305.00	6,394,500	
6516	山洋電気	13,400	5,930.00	79,462,000	貸付有価証券 1,400株
6517	デンヨー	23,500	1,660.00	39,010,000	貸付有価証券 1,300株
6523	PHCホールディングス	43,000	1,424.00	61,232,000	貸付有価証券 3,400株
6526	ソシオネクスト	31,800	9,780.00	311,004,000	

6588	東芝テック	46,200	3,755.00	173,481,000	貸付有価証券 1,200株
6590	芝浦メカトロニクス	5,900	16,160.00	95,344,000	
6592	マブチモーター	76,800	3,725.00	286,080,000	貸付有価証券 11,200株
6594	日本電産	752,100	6,785.00	5,102,998,500	
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	22,700	468.00	10,623,600	貸付有価証券 3,000株
6616	トレックス・セミコンダクター	14,500	2,376.00	34,452,000	貸付有価証券 2,100株
6617	東光高岳	18,600	2,297.00	42,724,200	
6619	ダブル・スコープ	101,100	1,253.00	126,678,300	貸付有価証券 7,600株
6622	ダイヘン	27,900	4,335.00	120,946,500	
6630	ヤーマン	53,400	1,061.00	56,657,400	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	281,600	384.00	108,134,400	貸付有価証券 22,000株
6638	ミマキエンジニアリング	29,300	644.00	18,869,200	貸付有価証券 1,300株
6640	IPEX	17,100	1,329.00	22,725,900	貸付有価証券 1,600株
6641	日新電機	72,500	1,697.00	123,032,500	
6644	大崎電気工業	73,300	524.00	38,409,200	
6645	オムロン	283,300	7,485.00	2,120,500,500	
6651	日東工業	41,700	2,643.00	110,213,100	
6652	IDEC	45,600	3,355.00	152,988,000	
6653	正興電機製作所	7,500	987.00	7,402,500	貸付有価証券 1,300株
6654	不二電機工業	4,000	1,094.00	4,376,000	貸付有価証券 700株
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	101,500	2,285.00	231,927,500	
6675	サクサホールディングス	5,000	1,754.00	8,770,000	貸付有価証券 100株
6676	メルコホールディングス	8,200	3,220.00	26,404,000	
6678	テクノメディカ	7,500	1,817.00	13,627,500	貸付有価証券 300株
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	10,400	850.00	8,840,000	貸付有価証券 1,300株
6701	日本電気	437,200	5,000.00	2,186,000,000	
6702	富士通	308,000	17,555.00	5,406,940,000	貸付有価証券 4,700株
6703	沖電気工業	139,800	707.00	98,838,600	
6704	岩崎通信機	8,700	803.00	6,986,100	貸付有価証券 2,400株

6706	電気興業	12,500	2,170.00	27,125,000	貸付有価証券 1,600株
6707	サンケン電気	28,700	10,480.00	300,776,000	貸付有価証券 3,200株
6715	ナカヨ	3,500	1,150.00	4,025,000	貸付有価証券 900株
6718	アイホン	18,800	2,009.00	37,769,200	
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,016,900	1,773.50	3,576,972,150	貸付有価証券 218,300株
6724	セイコーエプソン	411,700	1,870.00	769,879,000	
6727	ワコム	244,800	695.00	170,136,000	貸付有価証券 2,000株
6728	アルバック	73,400	5,540.00	406,636,000	貸付有価証券 12,800株
6730	アクセル	8,200	1,792.00	14,694,400	貸付有価証券 2,400株
6737	E I Z O	22,600	3,935.00	88,931,000	貸付有価証券 2,300株
6740	ジャパンディスプレイ	1,186,800	38.00	45,098,400	貸付有価証券 163,000株
6741	日本信号	70,400	1,055.00	74,272,000	
6742	京三製作所	64,700	426.00	27,562,200	貸付有価証券 1,500株
6744	能美防災	41,800	1,679.00	70,182,200	貸付有価証券 1,800株
6745	ホーチキ	23,100	1,535.00	35,458,500	貸付有価証券 1,500株
6748	星和電機	7,900	457.00	3,610,300	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	73,900	1,248.00	92,227,200	
6752	パナソニック ホールディングス	3,651,400	1,148.00	4,191,807,200	
6753	シャープ	372,200	946.00	352,101,200	貸付有価証券 80,900株
6754	アンリツ	217,700	1,220.00	265,594,000	
6755	富士通ゼネラル	87,600	3,685.00	322,806,000	貸付有価証券 20,100株
6758	ソニーグループ	2,165,000	11,450.00	24,789,250,000	貸付有価証券 12,500株
6762	T D K	489,500	4,665.00	2,283,517,500	
6763	帝国通信工業	13,900	1,481.00	20,585,900	貸付有価証券 600株
6768	タムラ製作所	132,600	793.00	105,151,800	貸付有価証券 4,800株
6770	アルプスアルパイン	276,100	1,272.00	351,199,200	
6771	池上通信機	6,300	629.00	3,962,700	貸付有価証券 1,400株



6779	日本電波工業	37,100	1,266.00	46,968,600	貸付有価証券 1,400株
6785	鈴木	16,500	1,026.00	16,929,000	貸付有価証券 2,400株
6787	メイコー	33,700	2,776.00	93,551,200	貸付有価証券 2,000株
6788	日本トリム	6,900	3,085.00	21,286,500	
6789	ローランド ディー. ジー.	17,400	3,155.00	54,897,000	貸付有価証券 2,700株
6794	フォスター電機	28,600	1,176.00	33,633,600	
6798	SMK	7,400	2,469.00	18,270,600	
6800	ヨコオ	24,600	2,001.00	49,224,600	貸付有価証券 800株
6803	ティアック	32,800	113.00	3,706,400	貸付有価証券 4,600株
6804	ホシデン	72,100	1,592.00	114,783,200	貸付有価証券 2,700株
6806	ヒロセ電機	51,100	17,000.00	868,700,000	
6807	日本航空電子工業	63,400	2,303.00	146,010,200	貸付有価証券 3,700株
6809	TOA	35,200	819.00	28,828,800	
6810	マクセル	67,200	1,547.00	103,958,400	
6814	古野電気	40,200	942.00	37,868,400	貸付有価証券 8,500株
6817	スミダコーポレーション	28,300	1,498.00	42,393,400	貸付有価証券 3,600株
6820	アイコム	11,900	2,531.00	30,118,900	貸付有価証券 1,500株
6823	リオン	12,700	1,878.00	23,850,600	
6841	横河電機	338,200	2,071.00	700,412,200	
6844	新電元工業	11,800	3,420.00	40,356,000	貸付有価証券 1,600株
6845	アズビル	213,800	3,480.00	744,024,000	貸付有価証券 16,000株
6848	東亜ディーケーケー	10,600	822.00	8,713,200	貸付有価証券 2,400株
6849	日本光電工業	141,400	3,590.00	507,626,000	貸付有価証券 4,600株
6850	チノー	12,700	2,169.00	27,546,300	貸付有価証券 700株
6853	共和電業	18,700	344.00	6,432,800	貸付有価証券 5,800株
6855	日本電子材料	20,200	1,486.00	30,017,200	貸付有価証券 100株
6856	堀場製作所	68,200	7,590.00	517,638,000	貸付有価証券 8,800株

6857	アドバンテスト	241,200	11,980.00	2,889,576,000	
6858	小野測器	7,300	438.00	3,197,400	貸付有価証券 1,800株
6859	エスペック	24,500	2,001.00	49,024,500	貸付有価証券 1,300株
6861	キーエンス	306,200	62,030.00	18,993,586,000	貸付有価証券 40,200株
6866	日置電機	16,100	8,410.00	135,401,000	貸付有価証券 3,100株
6869	シスメックス	264,000	8,476.00	2,237,664,000	
6871	日本マイクロニクス	50,400	1,285.00	64,764,000	貸付有価証券 7,700株
6875	メガチップス	25,100	3,265.00	81,951,500	
6877	OBARA GROUP	14,300	3,865.00	55,269,500	貸付有価証券 4,000株
6901	澤藤電機	2,600	1,157.00	3,008,200	貸付有価証券 600株
6904	原田工業	10,100	888.00	8,968,800	貸付有価証券 2,800株
6905	コーセル	36,800	1,120.00	41,216,000	貸付有価証券 5,400株
6908	イリソ電子工業	28,100	4,870.00	136,847,000	貸付有価証券 1,400株
6914	オプテックスグループ	56,100	1,976.00	110,853,600	貸付有価証券 7,300株
6915	千代田インテグレ	10,600	2,230.00	23,638,000	貸付有価証券 2,000株
6920	レーザーテック	140,300	21,930.00	3,076,779,000	貸付有価証券 20,400株
6923	スタンレー電気	217,800	2,839.00	618,334,200	
6924	岩崎電気	9,600	4,460.00	42,816,000	
6925	ウシオ電機	159,900	1,635.00	261,436,500	
6926	岡谷電機産業	15,300	312.00	4,773,600	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	354.00	6,478,200	貸付有価証券 2,400株
6928	エノモト	5,900	1,737.00	10,248,300	貸付有価証券 100株
6929	日本セラミック	31,200	2,657.00	82,898,400	貸付有価証券 4,500株
6932	遠藤照明	9,900	853.00	8,444,700	
6937	古河電池	22,500	1,059.00	23,827,500	貸付有価証券 4,200株
6938	双信電機	10,300	386.00	3,975,800	貸付有価証券 2,200株
6941	山一電機	26,700	1,990.00	53,133,000	

6947	図研	26,600	3,375.00	89,775,000	貸付有価証券 1,300株
6951	日本電子	76,700	4,130.00	316,771,000	
6952	カシオ計算機	228,000	1,300.00	296,400,000	
6954	ファナック	300,400	22,990.00	6,906,196,000	
6958	日本シイエムケイ	65,000	447.00	29,055,000	
6961	エンブラス	8,900	4,435.00	39,471,500	貸付有価証券 1,600株
6962	大真空	37,300	723.00	26,967,900	貸付有価証券 1,900株
6963	ローム	141,500	10,520.00	1,488,580,000	
6965	浜松ホトニクス	245,600	6,940.00	1,704,464,000	
6966	三井ハイテック	31,600	8,100.00	255,960,000	貸付有価証券 6,900株
6967	新光電気工業	108,300	3,725.00	403,417,500	貸付有価証券 11,800株
6971	京セラ	475,400	6,841.00	3,252,211,400	
6976	太陽誘電	149,000	4,245.00	632,505,000	
6981	村田製作所	928,200	7,791.00	7,231,606,200	
6986	双葉電子工業	58,300	521.00	30,374,300	
6989	北陸電気工業	8,000	1,380.00	11,040,000	
6996	ニチコン	62,500	1,378.00	86,125,000	貸付有価証券 14,900株
6997	日本ケミコン	30,200	2,124.00	64,144,800	貸付有価証券 3,300株
6999	KOA	46,300	1,809.00	83,756,700	
7244	市光工業	44,100	431.00	19,007,100	貸付有価証券 5,500株
7276	小糸製作所	368,100	2,346.00	863,562,600	
7280	ミツバ	57,400	489.00	28,068,600	
7735	S C R E E Nホールディングス	52,300	11,550.00	604,065,000	
7739	キャノン電子	33,800	1,813.00	61,279,400	貸付有価証券 4,600株
7751	キャノン	1,679,200	2,879.00	4,834,416,800	貸付有価証券 355,400株
7752	リコー	767,400	982.00	753,586,800	
7965	象印マホービン	91,400	1,565.00	143,041,000	貸付有価証券 13,000株
7999	MUTOHホールディングス	2,700	1,726.00	4,660,200	貸付有価証券 900株
8035	東京エレクトロン	215,900	48,750.00	10,525,125,000	
9880	イノテック	20,400	1,389.00	28,335,600	

3116	トヨタ紡織	128,900	2,043.00	263,342,700	
3526	芦森工業	4,100	1,451.00	5,949,100	貸付有価証券 400株
5949	ユニプレス	54,900	877.00	48,147,300	貸付有価証券 13,700株
6201	豊田自動織機	223,800	6,680.00	1,494,984,000	
6455	モリタホールディングス	53,700	1,295.00	69,541,500	
6584	三櫻工業	46,700	652.00	30,448,400	
6902	デンソー	631,300	7,148.00	4,512,532,400	
6995	東海理化電機製作所	86,300	1,564.00	134,973,200	貸付有価証券 2,200株
7012	川崎重工業	230,600	2,766.00	637,839,600	
7014	名村造船所	55,400	320.00	17,728,000	貸付有価証券 21,000株
7102	日本車輛製造	11,800	1,979.00	23,352,200	
7105	三菱ロジスネクスト	48,800	859.00	41,919,200	貸付有価証券 1,200株
7122	近畿車輛	3,200	1,385.00	4,432,000	貸付有価証券 800株
7201	日産自動車	4,347,700	479.50	2,084,722,150	
7202	いすゞ自動車	889,800	1,595.00	1,419,231,000	貸付有価証券 1,700株
7203	トヨタ自動車	16,805,900	1,790.00	30,082,561,000	
7205	日野自動車	394,600	531.00	209,532,600	貸付有価証券 55,300株
7211	三菱自動車工業	1,194,000	491.00	586,254,000	貸付有価証券 163,900株
7212	エフテック	13,700	638.00	8,740,600	貸付有価証券 5,400株
7213	レシップホールディングス	8,500	485.00	4,122,500	貸付有価証券 2,200株
7214	GMB	3,900	834.00	3,252,600	貸付有価証券 300株
7215	ファルテック	3,700	591.00	2,186,700	貸付有価証券 700株
7220	武蔵精密工業	74,800	1,720.00	128,656,000	
7222	日産車体	54,000	827.00	44,658,000	貸付有価証券 3,800株
7224	新明和工業	96,100	1,156.00	111,091,600	貸付有価証券 7,000株
7226	極東開発工業	53,800	1,573.00	84,627,400	貸付有価証券 3,800株
7231	トピー工業	24,800	1,886.00	46,772,800	貸付有価証券 4,800株
7236	ティラド	7,700	2,271.00	17,486,700	

7238	曙ブレーキ工業	186,800	143.00	26,712,400	貸付有価証券 31,400株
7239	タチエス	48,400	1,196.00	57,886,400	
7240	NOK	118,900	1,383.00	164,438,700	
7241	フタバ産業	82,000	401.00	32,882,000	貸付有価証券 3,700株
7242	KYB	29,500	3,840.00	113,280,000	貸付有価証券 4,900株
7245	大同メタル工業	59,800	505.00	30,199,000	
7246	プレス工業	136,700	484.00	66,162,800	
7247	ミクニ	24,900	318.00	7,918,200	貸付有価証券 6,700株
7250	太平洋工業	70,200	1,102.00	77,360,400	
7256	河西工業	26,300	188.00	4,944,400	貸付有価証券 9,400株
7259	アイシン	236,100	3,575.00	844,057,500	
7261	マツダ	1,012,400	1,151.00	1,165,272,400	
7266	今仙電機製作所	14,100	747.00	10,532,700	貸付有価証券 3,800株
7267	本田技研工業	2,487,900	3,391.00	8,436,468,900	
7269	スズキ	562,100	4,744.00	2,666,602,400	貸付有価証券 39,400株
7270	SUBARU	968,400	2,074.00	2,008,461,600	
7271	安永	8,600	1,030.00	8,858,000	貸付有価証券 1,200株
7272	ヤマハ発動機	481,000	3,195.00	1,536,795,000	貸付有価証券 96,300株
7277	T B K	21,600	274.00	5,918,400	貸付有価証券 1,500株
7278	エクセディ	50,100	1,781.00	89,228,100	
7282	豊田合成	89,300	2,174.00	194,138,200	
7283	愛三工業	50,500	870.00	43,935,000	
7284	盟和産業	3,100	987.00	3,059,700	貸付有価証券 800株
7291	日本プラスト	15,500	401.00	6,215,500	貸付有価証券 1,600株
7294	ヨロズ	28,700	831.00	23,849,700	貸付有価証券 1,300株
7296	エフ・シー・シー	54,200	1,502.00	81,408,400	
7309	シマノ	125,200	22,005.00	2,755,026,000	貸付有価証券 16,600株
7313	テイ・エス テック	140,100	1,638.00	229,483,800	貸付有価証券 13,000株
7408	ジャムコ	12,500	1,505.00	18,812,500	貸付有価証券 3,000株

4543	テルモ	941,300	3,474.00	3,270,076,200	
5187	クリエートメディック	6,500	889.00	5,778,500	貸付有価証券 1,300株
6376	日機装	71,300	915.00	65,239,500	貸付有価証券 13,300株
7600	日本エム・ディ・エム	18,200	1,017.00	18,509,400	
7701	島津製作所	372,800	4,025.00	1,500,520,000	貸付有価証券 10,400株
7702	JMS	28,300	516.00	14,602,800	貸付有価証券 1,100株
7709	クボテック	4,600	215.00	989,000	貸付有価証券 1,100株
7715	長野計器	22,200	1,288.00	28,593,600	貸付有価証券 800株
7717	ブイ・テクノロジー	15,000	2,470.00	37,050,000	
7721	東京計器	23,500	1,229.00	28,881,500	貸付有価証券 3,900株
7723	愛知時計電機	11,900	1,493.00	17,766,700	
7725	インターアクション	14,500	1,477.00	21,416,500	貸付有価証券 2,400株
7727	オーバル	19,200	446.00	8,563,200	貸付有価証券 6,100株
7729	東京精密	67,100	5,130.00	344,223,000	
7730	マニー	134,600	1,779.00	239,453,400	貸付有価証券 17,600株
7731	ニコン	475,800	1,332.00	633,765,600	
7732	トプコン	161,100	1,727.00	278,219,700	
7733	オリンパス	1,913,300	2,255.00	4,314,491,500	
7734	理研計器	19,000	5,110.00	97,090,000	
7740	タムロン	22,900	3,115.00	71,333,500	貸付有価証券 4,800株
7741	HOYA	653,700	13,930.00	9,106,041,000	貸付有価証券 10,200株
7743	シード	10,000	560.00	5,600,000	貸付有価証券 1,900株
7744	ノーリツ鋼機	29,000	2,118.00	61,422,000	貸付有価証券 3,000株
7745	A&Dホロンホールディングス	44,600	1,393.00	62,127,800	
7747	朝日インテック	342,000	2,249.00	769,158,000	貸付有価証券 55,400株
7762	シチズン時計	336,500	773.00	260,114,500	
7769	リズム	6,700	1,846.00	12,368,200	貸付有価証券 1,100株
7775	大研医器	17,000	494.00	8,398,000	貸付有価証券 4,700株

7780	メニコン	105,100	2,760.00	290,076,000	
7782	シンシア	1,800	550.00	990,000	貸付有価証券 500株
7979	松風	13,800	2,029.00	28,000,200	貸付有価証券 300株
8050	セイコーグループ	47,400	2,865.00	135,801,000	貸付有価証券 700株
8086	ニプロ	255,100	1,001.00	255,355,100	
7795	KYORITSU	29,400	147.00	4,321,800	貸付有価証券 1,800株
7811	中本パックス	6,000	1,557.00	9,342,000	貸付有価証券 1,100株
7816	スノーピーク	52,400	2,002.00	104,904,800	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	70,700	2,314.00	163,599,800	貸付有価証券 11,000株
7818	トランザクション	23,500	1,538.00	36,143,000	貸付有価証券 3,700株
7819	粧美堂	5,300	379.00	2,008,700	貸付有価証券 1,500株
7820	ニホンフラッシュ	28,700	949.00	27,236,300	貸付有価証券 1,300株
7821	前田工織	25,800	3,130.00	80,754,000	貸付有価証券 6,900株
7822	永大産業	23,400	227.00	5,311,800	貸付有価証券 1,300株
7823	アートネイチャー	31,500	771.00	24,286,500	貸付有価証券 1,600株
7832	バンダイナムコホールディングス	279,500	8,527.00	2,383,296,500	
7833	アイフィスジャパン	5,500	602.00	3,311,000	貸付有価証券 1,100株
7839	SHOEI	32,300	5,500.00	177,650,000	貸付有価証券 1,800株
7840	フランスベッドホールディングス	37,900	1,041.00	39,453,900	貸付有価証券 300株
7846	パイロットコーポレーション	47,900	4,150.00	198,785,000	貸付有価証券 7,700株
7856	萩原工業	20,500	1,227.00	25,153,500	貸付有価証券 3,300株
7864	フジシールインターナショナル	62,000	1,488.00	92,256,000	
7867	タカラトミー	141,300	1,481.00	209,265,300	
7868	広済堂ホールディングス	13,300	2,242.00	29,818,600	貸付有価証券 1,400株
7872	エステールホールディングス	4,600	631.00	2,902,600	
7885	タカノ	7,300	705.00	5,146,500	
7893	プロネクサス	25,400	968.00	24,587,200	貸付有価証券 1,000株

7897	ホクシン	15,100	143.00	2,159,300	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	6,500	1,401.00	9,106,500	
7905	大建工業	18,600	2,292.00	42,631,200	
7911	凸版印刷	400,300	2,542.00	1,017,562,600	
7912	大日本印刷	363,100	3,615.00	1,312,606,500	
7914	共同印刷	8,600	2,728.00	23,460,800	
7915	N I S S H A	58,200	1,764.00	102,664,800	貸付有価証券 13,100株
7916	光村印刷	1,700	1,233.00	2,096,100	貸付有価証券 400株
7921	TAKARA & COMPANY	19,600	2,238.00	43,864,800	貸付有価証券 2,100株
7936	アシックス	282,500	3,535.00	998,637,500	貸付有価証券 36,500株
7937	ツツミ	5,400	2,266.00	12,236,400	
7944	ローランド	22,500	3,815.00	85,837,500	貸付有価証券 3,300株
7949	小松ウオール工業	11,200	2,025.00	22,680,000	
7951	ヤマハ	192,900	4,960.00	956,784,000	
7952	河合楽器製作所	8,300	2,902.00	24,086,600	
7955	クリナップ	34,300	669.00	22,946,700	
7956	ビジョン	194,900	2,056.00	400,714,400	貸付有価証券 26,800株
7961	兼松サステック	1,400	2,245.00	3,143,000	
7962	キングジム	27,000	896.00	24,192,000	貸付有価証券 5,100株
7966	リンテック	61,400	2,162.00	132,746,800	貸付有価証券 5,500株
7972	イトーキ	62,700	692.00	43,388,400	貸付有価証券 9,400株
7974	任天堂	1,932,300	5,095.00	9,845,068,500	
7976	三菱鉛筆	43,500	1,586.00	68,991,000	貸付有価証券 8,100株
7981	タカラスタンダード	59,200	1,469.00	86,964,800	
7984	コクヨ	147,400	1,838.00	270,921,200	貸付有価証券 21,200株
7987	ナカバヤシ	33,000	485.00	16,005,000	貸付有価証券 1,100株
7990	グローブライド	24,700	2,421.00	59,798,700	貸付有価証券 4,400株
7994	オカムラ	92,100	1,348.00	124,150,800	貸付有価証券 2,200株
8022	美津濃	30,400	3,140.00	95,456,000	貸付有価証券 700株



9501	東京電力ホールディングス	2,759,000	447.00	1,233,273,000	貸付有価証券 353,400株
9502	中部電力	1,127,800	1,400.00	1,578,920,000	
9503	関西電力	1,181,900	1,267.00	1,497,467,300	
9504	中国電力	487,400	664.00	323,633,600	貸付有価証券 61,200株
9505	北陸電力	288,900	586.00	169,295,400	貸付有価証券 60,000株
9506	東北電力	748,200	630.00	471,366,000	貸付有価証券 110,300株
9507	四国電力	261,300	732.00	191,271,600	貸付有価証券 39,900株
9508	九州電力	705,500	735.00	518,542,500	貸付有価証券 91,200株
9509	北海道電力	295,700	478.00	141,344,600	貸付有価証券 41,400株
9511	沖縄電力	71,700	1,038.00	74,424,600	貸付有価証券 8,600株
9513	電源開発	230,500	2,111.00	486,585,500	
9514	エフオン	19,800	596.00	11,800,800	貸付有価証券 3,000株
9517	イーレックス	54,300	1,800.00	97,740,000	貸付有価証券 6,400株
9519	レノバ	81,500	1,941.00	158,191,500	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	647,100	2,511.00	1,624,868,100	
9532	大阪瓦斯	620,000	2,203.00	1,365,860,000	
9533	東邦瓦斯	120,500	2,478.00	298,599,000	
9534	北海道瓦斯	18,300	1,884.00	34,477,200	
9535	広島ガス	64,600	360.00	23,256,000	
9536	西部ガスホールディングス	28,700	1,731.00	49,679,700	貸付有価証券 800株
9543	静岡ガス	69,800	1,128.00	78,734,400	貸付有価証券 12,900株
9551	メタウォーター	38,300	1,691.00	64,765,300	
2384	SBSホールディングス	27,300	3,265.00	89,134,500	貸付有価証券 3,800株
9001	東武鉄道	336,200	3,150.00	1,059,030,000	
9003	相鉄ホールディングス	101,100	2,255.00	227,980,500	貸付有価証券 2,400株
9005	東急	858,200	1,740.00	1,493,268,000	貸付有価証券 15,600株
9006	京浜急行電鉄	347,200	1,253.00	435,041,600	
9007	小田急電鉄	463,900	1,719.00	797,444,100	貸付有価証券 10,400株

9008	京王電鉄	161,800	4,700.00	760,460,000	貸付有価証券 23,100株
9009	京成電鉄	197,300	3,990.00	787,227,000	貸付有価証券 31,800株
9010	富士急行	37,700	4,375.00	164,937,500	貸付有価証券 6,400株
9020	東日本旅客鉄道	519,100	7,354.00	3,817,461,400	貸付有価証券 34,800株
9021	西日本旅客鉄道	391,000	5,438.00	2,126,258,000	貸付有価証券 16,200株
9022	東海旅客鉄道	235,800	15,955.00	3,762,189,000	貸付有価証券 15,700株
9024	西武ホールディングス	370,200	1,379.00	510,505,800	
9025	鴻池運輸	52,100	1,451.00	75,597,100	
9031	西日本鉄道	81,700	2,361.00	192,893,700	貸付有価証券 4,200株
9037	ハマキョウレックス	23,900	3,145.00	75,165,500	貸付有価証券 600株
9039	サカイ引越センター	14,500	4,645.00	67,352,500	貸付有価証券 1,000株
9041	近鉄グループホールディングス	305,500	4,265.00	1,302,957,500	貸付有価証券 1,200株
9042	阪急阪神ホールディングス	407,500	3,915.00	1,595,362,500	
9044	南海電気鉄道	146,000	2,919.00	426,174,000	貸付有価証券 19,800株
9045	京阪ホールディングス	126,300	3,440.00	434,472,000	貸付有価証券 400株
9046	神戸電鉄	8,300	3,185.00	26,435,500	貸付有価証券 1,200株
9048	名古屋鉄道	337,700	2,057.00	694,648,900	貸付有価証券 3,500株
9052	山陽電気鉄道	23,000	2,224.00	51,152,000	
9055	アルプス物流	24,400	1,278.00	31,183,200	
9064	ヤマトホールディングス	391,300	2,230.00	872,599,000	
9065	山九	77,800	4,870.00	378,886,000	貸付有価証券 4,700株
9067	丸運	9,700	227.00	2,201,900	貸付有価証券 2,400株
9068	丸全昭和運輸	18,900	3,105.00	58,684,500	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	161,800	936.00	151,444,800	貸付有価証券 12,000株
9070	トナミホールディングス	6,700	4,010.00	26,867,000	貸付有価証券 500株
9072	ニッコンホールディングス	97,800	2,456.00	240,196,800	
9074	日本石油輸送	2,200	2,343.00	5,154,600	

9075	福山通運	23,200	3,510.00	81,432,000	貸付有価証券 2,000株
9076	セイノーホールディングス	190,200	1,424.00	270,844,800	貸付有価証券 16,300株
9078	エスライン	5,500	862.00	4,741,000	貸付有価証券 600株
9081	神奈川中央交通	8,700	3,220.00	28,014,000	
9090	AZ-COM丸和ホールディングス	73,800	1,927.00	142,212,600	
9099	C&Fロジホールディングス	29,400	1,234.00	36,279,600	貸付有価証券 1,300株
9142	九州旅客鉄道	216,000	3,000.00	648,000,000	
9143	SGホールディングス	586,400	1,878.00	1,101,259,200	
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	114,100	7,750.00	884,275,000	貸付有価証券 19,900株
9101	日本郵船	817,500	3,288.00	2,687,940,000	貸付有価証券 105,300株
9104	商船三井	538,600	3,550.00	1,912,030,000	貸付有価証券 79,200株
9107	川崎汽船	260,300	3,310.00	861,593,000	貸付有価証券 53,400株
9110	NSユニテッド海運	16,500	4,345.00	71,692,500	貸付有価証券 1,300株
9115	明治海運	19,200	611.00	11,731,200	貸付有価証券 8,700株
9119	飯野海運	112,200	1,019.00	114,331,800	
9130	共栄タンカー	3,600	928.00	3,340,800	貸付有価証券 800株
9308	乾汽船	38,800	1,989.00	77,173,200	貸付有価証券 1,600株
9201	日本航空	750,500	2,526.00	1,895,763,000	
9202	ANAホールディングス	831,400	2,812.50	2,338,312,500	貸付有価証券 76,600株
9232	パスコ	3,900	1,421.00	5,541,900	貸付有価証券 1,000株
9058	トランコム	8,900	7,230.00	64,347,000	
9066	日新	23,200	2,058.00	47,745,600	貸付有価証券 4,400株
9301	三菱倉庫	65,700	3,085.00	202,684,500	
9302	三井倉庫ホールディングス	28,500	3,930.00	112,005,000	
9303	住友倉庫	83,900	2,180.00	182,902,000	貸付有価証券 6,000株
9304	澁澤倉庫	12,200	2,204.00	26,888,800	
9306	東陽倉庫	28,800	291.00	8,380,800	貸付有価証券 500株
9310	日本トランスシティ	61,500	596.00	36,654,000	

9312	ケイヒン	3,500	1,610.00	5,635,000	貸付有価証券 1,300株
9319	中央倉庫	14,700	1,092.00	16,052,400	貸付有価証券 900株
9322	川西倉庫	3,700	1,007.00	3,725,900	貸付有価証券 800株
9324	安田倉庫	20,800	1,027.00	21,361,600	
9325	ファイブホールディングス	4,300	1,391.00	5,981,300	貸付有価証券 1,200株
9351	東洋埠頭	5,700	1,353.00	7,712,100	
9364	上組	146,500	2,727.00	399,505,500	貸付有価証券 13,900株
9366	サンリツ	5,200	757.00	3,936,400	貸付有価証券 1,300株
9368	キムラユニティー	10,600	1,019.00	10,801,400	貸付有価証券 400株
9369	キューソー流通システム	11,800	971.00	11,457,800	貸付有価証券 2,300株
9380	東海運	11,500	300.00	3,450,000	貸付有価証券 2,400株
9381	エーアイティー	19,200	1,562.00	29,990,400	貸付有価証券 4,000株
9384	内外トランスライン	11,000	2,197.00	24,167,000	貸付有価証券 1,500株
9386	日本コンセプト	9,500	1,634.00	15,523,000	貸付有価証券 1,300株
1973	NEC ネットズエスアイ	102,500	1,618.00	165,845,000	
2307	クロスキャット	17,500	1,303.00	22,802,500	貸付有価証券 2,200株
2317	システナ	516,100	293.00	151,217,300	
2326	デジタルアーツ	19,400	5,090.00	98,746,000	貸付有価証券 100株
2327	日鉄ソリューションズ	52,400	3,515.00	184,186,000	貸付有価証券 3,500株
2335	キューブシステム	18,300	1,164.00	21,301,200	
2359	コア	13,600	1,616.00	21,977,600	
2477	手間いらず	5,200	4,795.00	24,934,000	貸付有価証券 600株
3031	ラクーンホールディングス	25,400	845.00	21,463,000	貸付有価証券 2,700株
3040	ソリトンシステムズ	15,800	1,034.00	16,337,200	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	12,600	3,410.00	42,966,000	貸付有価証券 300株
3626	T I S	345,000	3,475.00	1,198,875,000	
3627	J N Sホールディングス	9,700	386.00	3,744,200	貸付有価証券 2,400株

3632	グリーン	82,300	713.00	58,679,900	貸付有価証券 48,400株
3633	GMOペパボ	4,400	1,877.00	8,258,800	貸付有価証券 700株
3635	コーエーテクモホールディングス	192,300	2,458.00	472,673,400	貸付有価証券 23,000株
3636	三菱総合研究所	15,000	5,020.00	75,300,000	
3639	ボルテージ	5,700	309.00	1,761,300	貸付有価証券 900株
3640	電算	2,300	1,802.00	4,144,600	貸付有価証券 600株
3648	A G S	8,300	700.00	5,810,000	貸付有価証券 3,400株
3649	ファインデックス	24,400	695.00	16,958,000	貸付有価証券 4,700株
3655	ブレインパッド	23,000	692.00	15,916,000	貸付有価証券 3,000株
3656	K L a b	61,100	377.00	23,034,700	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	52,400	881.00	46,164,400	貸付有価証券 7,300株
3659	ネクソン	793,800	3,105.00	2,464,749,000	貸付有価証券 172,700株
3660	アイスタイル	89,200	558.00	49,773,600	貸付有価証券 12,000株
3661	エムアップホールディングス	37,600	1,096.00	41,209,600	貸付有価証券 1,600株
3662	エイチーム	22,600	675.00	15,255,000	貸付有価証券 4,000株
3665	エニグモ	39,000	501.00	19,539,000	貸付有価証券 4,300株
3666	テクノスジャパン	16,300	596.00	9,714,800	貸付有価証券 4,400株
3667	e n i s h	14,900	431.00	6,421,900	貸付有価証券 2,800株
3668	コロブラ	119,000	591.00	70,329,000	貸付有価証券 15,600株
3672	オルトプラス	15,100	190.00	2,869,000	貸付有価証券 3,600株
3673	ブロードリーフ	179,300	401.00	71,899,300	貸付有価証券 28,300株
3675	クロス・マーケティンググループ	8,000	693.00	5,544,000	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	19,100	1,455.00	27,790,500	貸付有価証券 1,300株
3677	システム情報	27,100	807.00	21,869,700	貸付有価証券 900株
3678	メディアドゥ	12,400	1,439.00	17,843,600	貸付有価証券 1,400株

3679	じげん	89,500	460.00	41,170,000	貸付有価証券 2,200株
3681	ブイキューブ	36,800	523.00	19,246,400	貸付有価証券 3,700株
3682	エンカレッジ・テクノロジー	4,600	514.00	2,364,400	貸付有価証券 900株
3683	サイバーリンクス	6,300	900.00	5,670,000	貸付有価証券 1,400株
3686	ディー・エル・イー	14,100	244.00	3,440,400	貸付有価証券 4,600株
3687	フィックスターズ	34,600	1,437.00	49,720,200	貸付有価証券 700株
3688	CARTA HOLDINGS	14,400	1,399.00	20,145,600	貸付有価証券 2,100株
3694	オプティム	25,200	921.00	23,209,200	貸付有価証券 3,000株
3696	セレス	12,300	1,281.00	15,756,300	貸付有価証券 1,400株
3697	SHIFT	22,400	23,320.00	522,368,000	貸付有価証券 1,900株
3738	ティーガイア	32,100	1,688.00	54,184,800	貸付有価証券 1,500株
3741	セック	3,100	3,335.00	10,338,500	貸付有価証券 600株
3762	テクマトリックス	56,000	1,473.00	82,488,000	貸付有価証券 1,200株
3763	プロシップ	13,400	1,397.00	18,719,800	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	93,900	2,420.00	227,238,000	貸付有価証券 15,000株
3769	GMOペイメントゲートウェイ	70,100	11,410.00	799,841,000	貸付有価証券 8,400株
3770	ザッパラス	7,300	372.00	2,715,600	貸付有価証券 2,200株
3771	システムリサーチ	9,600	2,095.00	20,112,000	
3774	インターネットイニシアティブ	171,300	2,691.00	460,968,300	貸付有価証券 200株
3778	さくらインターネット	34,400	611.00	21,018,400	
3784	ヴィンクス	5,900	1,361.00	8,029,900	貸付有価証券 1,500株
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	9,400	4,240.00	39,856,000	貸付有価証券 900株
3817	SRAホールディングス	15,700	2,942.00	46,189,400	
3826	システムインテグレータ	6,700	463.00	3,102,100	貸付有価証券 1,700株
3834	朝日ネット	33,000	594.00	19,602,000	貸付有価証券 1,100株
3835	eBASE	43,200	677.00	29,246,400	
3836	アバントグループ	38,800	1,462.00	56,725,600	貸付有価証券

					4,100株
3837	アドソル日進	12,900	1,681.00	21,684,900	
3839	ODKソリューションズ	4,400	612.00	2,692,800	貸付有価証券 100株
3843	フリービット	16,100	1,409.00	22,684,900	貸付有価証券 2,800株
3844	コムチュア	40,600	2,100.00	85,260,000	貸付有価証券 1,800株
3852	サイバーコム	3,200	1,442.00	4,614,400	貸付有価証券 800株
3853	アステリア	24,000	787.00	18,888,000	貸付有価証券 3,900株
3854	アイル	17,200	2,160.00	37,152,000	貸付有価証券 2,200株
3901	マークラインズ	16,600	2,472.00	41,035,200	貸付有価証券 2,100株
3902	メディカル・データ・ビジョン	45,800	899.00	41,174,200	貸付有価証券 4,500株
3903	g u m i	44,900	756.00	33,944,400	貸付有価証券 5,500株
3909	ショーケース	4,600	326.00	1,499,600	貸付有価証券 1,000株
3912	モバイルファクトリー	4,100	884.00	3,624,400	貸付有価証券 1,000株
3915	テラスカイ	13,200	1,804.00	23,812,800	貸付有価証券 3,400株
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	17,700	1,700.00	30,090,000	貸付有価証券 1,900株
3918	P C Iホールディングス	8,300	1,002.00	8,316,600	
3920	アイビーシー	3,100	410.00	1,271,000	貸付有価証券 1,000株
3921	ネオジャパン	10,200	883.00	9,006,600	貸付有価証券 1,400株
3922	P R T I M E S	7,700	1,890.00	14,553,000	貸付有価証券 800株
3923	ラクス	145,200	1,877.00	272,540,400	
3924	ランドコンピュータ	4,800	1,079.00	5,179,200	
3925	ダブルスタンダード	12,400	2,080.00	25,792,000	貸付有価証券 200株
3926	オープンドア	21,500	1,581.00	33,991,500	貸付有価証券 2,200株
3928	マイネット	6,400	367.00	2,348,800	貸付有価証券 1,500株
3932	アカツキ	14,600	2,242.00	32,733,200	
3934	ベネフィットジャパン	1,600	1,201.00	1,921,600	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	9,500	1,975.00	18,762,500	貸付有価証券 200株

3939	カナミックネットワーク	44,100	489.00	21,564,900	貸付有価証券 200株
3940	ノムラシステムコーポレーション	18,500	112.00	2,072,000	貸付有価証券 4,400株
3962	チェンジ	75,200	2,328.00	175,065,600	貸付有価証券 1,100株
3963	シンクロ・フード	10,700	446.00	4,772,200	貸付有価証券 2,800株
3964	オークネット	15,100	1,539.00	23,238,900	貸付有価証券 3,000株
3965	キャピタル・アセット・プランニング	3,800	622.00	2,363,600	貸付有価証券 1,200株
3968	セグエグループ	5,500	782.00	4,301,000	貸付有価証券 700株
3969	エイトレッド	3,000	1,467.00	4,401,000	貸付有価証券 500株
3978	マクロミル	60,200	925.00	55,685,000	貸付有価証券 7,900株
3981	ビーグリー	3,300	1,221.00	4,029,300	貸付有価証券 800株
3983	オロ	9,200	2,120.00	19,504,000	貸付有価証券 1,100株
3984	ユーザーローカル	11,000	2,138.00	23,518,000	貸付有価証券 1,400株
3985	テモナ	3,800	301.00	1,143,800	貸付有価証券 1,000株
3992	ニーズウェル	6,100	1,087.00	6,630,700	貸付有価証券 1,100株
3994	マネーフォワード	73,900	4,950.00	365,805,000	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 800株
4053	S u n A s t e r i s k	16,300	1,146.00	18,679,800	
4072	電算システムホールディングス	14,800	2,584.00	38,243,200	貸付有価証券 2,300株
4180	A p p i e r G r o u p	87,200	1,765.00	153,908,000	
4284	ソルクシーズ	16,100	341.00	5,490,100	貸付有価証券 3,800株
4295	フェイス	5,500	500.00	2,750,000	貸付有価証券 800株
4298	プロトコーポレーション	38,400	1,176.00	45,158,400	貸付有価証券 400株
4299	ハイマックス	9,600	1,437.00	13,795,200	貸付有価証券 1,200株
4307	野村総合研究所	629,700	3,010.00	1,895,397,000	
4312	サイバネットシステム	25,700	869.00	22,333,300	貸付有価証券 6,500株
4320	C E ホールディングス	10,200	558.00	5,691,600	貸付有価証券 3,500株



4323	日本システム技術	7,500	1,671.00	12,532,500	貸付有価証券 1,300株
4326	インテージホールディングス	34,700	1,529.00	53,056,300	貸付有価証券 5,800株
4333	東邦システムサイエンス	5,500	1,124.00	6,182,000	貸付有価証券 1,300株
4344	ソースネクスト	156,100	213.00	33,249,300	貸付有価証券 24,400株
4348	インフォコム	39,600	2,347.00	92,941,200	
4373	シンプレクス・ホールディングス	51,600	2,322.00	119,815,200	貸付有価証券 4,700株
4382	HEROZ	10,300	1,450.00	14,935,000	貸付有価証券 900株
4384	ラクスル	86,800	1,422.00	123,429,600	貸付有価証券 9,600株
4385	メルカリ	138,500	2,314.00	320,489,000	貸付有価証券 27,600株
4390	I P S	10,000	2,430.00	24,300,000	
4392	F I G	22,900	294.00	6,732,600	貸付有価証券 5,500株
4396	システムサポート	11,900	1,770.00	21,063,000	貸付有価証券 800株
4420	イーソル	19,700	812.00	15,996,400	貸付有価証券 2,400株
4423	アルテリア・ネットワークス	28,600	1,295.00	37,037,000	貸付有価証券 600株
4430	東海ソフト	3,300	901.00	2,973,300	貸付有価証券 900株
4432	ウイングアーク1st	31,600	1,940.00	61,304,000	貸付有価証券 3,600株
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	8,200	1,582.00	12,972,400	貸付有価証券 1,400株
4434	サーバーワークス	6,200	2,485.00	15,407,000	貸付有価証券 500株
4439	東名	1,500	2,335.00	3,502,500	貸付有価証券 400株
4440	ヴィッツ	1,900	912.00	1,732,800	貸付有価証券 500株
4441	トビラシステムズ	4,900	1,108.00	5,429,200	貸付有価証券 900株
4443	S a n s a n	100,400	1,585.00	159,134,000	貸付有価証券 23,600株
4446	L i n k - U	3,800	1,005.00	3,819,000	貸付有価証券 1,000株
4449	ギフトィ	33,400	2,324.00	77,621,600	貸付有価証券 5,800株
4480	メドレー	30,900	4,115.00	127,153,500	
4481	ベース	10,400	5,540.00	57,616,000	貸付有価証券 2,200株

4483	J M D C	50,400	4,630.00	233,352,000	貸付有価証券 7,000株
4662	フォーカスシステムズ	22,400	1,014.00	22,713,600	
4674	クレスコ	23,700	1,746.00	41,380,200	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	294,900	1,189.00	350,636,100	貸付有価証券 29,000株
4684	オービック	102,600	20,830.00	2,137,158,000	
4686	ジャストシステム	44,100	3,515.00	155,011,500	貸付有価証券 1,000株
4687	T D C ソフト	25,900	1,474.00	38,176,600	貸付有価証券 1,200株
4689	Zホールディングス	4,368,400	375.30	1,639,460,520	
4704	トレンドマイクロ	177,300	6,490.00	1,150,677,000	貸付有価証券 35,000株
4709	I Dホールディングス	20,700	1,022.00	21,155,400	
4716	日本オラクル	58,700	9,270.00	544,149,000	貸付有価証券 8,800株
4719	アルファシステムズ	9,700	3,980.00	38,606,000	
4722	フューチャー	76,400	1,800.00	137,520,000	貸付有価証券 11,500株
4725	C A C H o l d i n g s	18,800	1,654.00	31,095,200	貸付有価証券 2,800株
4726	S Bテクノロジー	13,000	1,969.00	25,597,000	
4728	トーセ	5,200	728.00	3,785,600	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	60,400	4,930.00	297,772,000	貸付有価証券 2,600株
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	164,800	3,245.00	534,776,000	
4743	アイティフォー	40,400	865.00	34,946,000	
4746	東計電算	4,300	6,500.00	27,950,000	貸付有価証券 700株
4762	エックスネット	3,300	1,017.00	3,356,100	
4768	大塚商会	174,000	4,555.00	792,570,000	貸付有価証券 25,100株
4776	サイボウズ	42,300	2,989.00	126,434,700	貸付有価証券 8,300株
4812	電通国際情報サービス	37,300	5,100.00	190,230,000	貸付有価証券 5,400株
4813	A C C E S S	36,300	837.00	30,383,100	貸付有価証券 4,100株
4819	デジタルガレージ	54,500	4,230.00	230,535,000	
4820	E Mシステムズ	51,200	842.00	43,110,400	貸付有価証券 9,400株
4825	ウェザーニューズ	9,500	6,620.00	62,890,000	貸付有価証券 1,700株

4826	C I J	25,500	1,076.00	27,438,000	貸付有価証券 7,000株
4828	ビジネスエンジニアリング	4,800	2,890.00	13,872,000	貸付有価証券 1,200株
4829	日本エンタープライズ	20,500	135.00	2,767,500	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	17,300	1,261.00	21,815,300	貸付有価証券 500株
4845	スカラ	28,400	745.00	21,158,000	貸付有価証券 4,100株
4847	インテリジェント ウェイブ	10,500	696.00	7,308,000	貸付有価証券 2,300株
5128	WOW WORLD GROUP	2,900	1,498.00	4,344,200	
6879	IMAGICA GROUP	25,600	598.00	15,308,800	貸付有価証券 4,900株
7518	ネットワンシステムズ	114,400	3,025.00	346,060,000	
7527	システムソフト	106,800	83.00	8,864,400	貸付有価証券 4,200株
7595	アルゴグラフィックス	28,100	3,590.00	100,879,000	貸付有価証券 1,200株
7844	マーベラス	49,800	690.00	34,362,000	
7860	エイベックス	52,100	1,521.00	79,244,100	
8056	B I P R O G Y	113,000	3,230.00	364,990,000	貸付有価証券 400株
8096	兼松エレクトロニクス	19,100	6,190.00	118,229,000	
8157	都築電気	16,200	1,555.00	25,191,000	
9401	T B Sホールディングス	157,100	1,867.00	293,305,700	貸付有価証券 26,800株
9404	日本テレビホールディングス	271,800	1,129.00	306,862,200	貸付有価証券 46,200株
9405	朝日放送グループホールディングス	28,700	675.00	19,372,500	貸付有価証券 2,100株
9409	テレビ朝日ホールディングス	74,500	1,489.00	110,930,500	貸付有価証券 11,900株
9412	スカパー J S A Tホールディングス	272,300	492.00	133,971,600	
9413	テレビ東京ホールディングス	22,100	2,480.00	54,808,000	貸付有価証券 700株
9414	日本BS放送	7,100	908.00	6,446,800	貸付有価証券 1,600株
9416	ビジョン	40,400	1,630.00	65,852,000	貸付有価証券 6,000株
9417	スマートバリュー	4,800	427.00	2,049,600	貸付有価証券 1,600株
9418	USEN-NEXT HOLDING S	27,500	2,456.00	67,540,000	貸付有価証券 2,200株
9419	ワイヤレスゲート	8,600	244.00	2,098,400	貸付有価証券 2,600株

9424	日本通信	283,300	246.00	69,691,800	貸付有価証券 54,400株
9428	クロップス	3,900	1,306.00	5,093,400	貸付有価証券 800株
9432	日本電信電話	3,933,300	3,994.00	15,709,600,200	
9433	KDDI	2,372,000	4,094.00	9,710,968,000	
9434	ソフトバンク	4,931,200	1,555.00	7,668,016,000	
9435	光通信	36,100	18,420.00	664,962,000	
9438	エムティーアイ	28,000	575.00	16,100,000	貸付有価証券 2,700株
9449	GMOインターネットグループ	114,000	2,571.00	293,094,000	
9450	ファイバーゲート	16,500	977.00	16,120,500	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	292.00	1,314,000	貸付有価証券 1,900株
9468	KADOKAWA	162,300	2,690.00	436,587,000	
9470	学研ホールディングス	51,100	846.00	43,230,600	
9474	ゼンリン	52,500	840.00	44,100,000	
9475	昭文社ホールディングス	8,500	312.00	2,652,000	貸付有価証券 2,400株
9479	インプレスホールディングス	17,500	204.00	3,570,000	貸付有価証券 5,900株
9600	アイネット	18,600	1,275.00	23,715,000	
9601	松竹	17,500	11,420.00	199,850,000	貸付有価証券 2,900株
9602	東宝	192,100	5,020.00	964,342,000	貸付有価証券 48,400株
9605	東映	8,500	17,280.00	146,880,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	963,100	1,711.00	1,647,864,100	
9629	ピー・シー・エー	17,600	1,253.00	22,052,800	貸付有価証券 600株
9658	ビジネスブレイン太田昭和	13,100	2,052.00	26,881,200	
9682	D T S	65,400	3,225.00	210,915,000	貸付有価証券 6,400株
9684	スクウェア・エニックス・ホールディ ングス	154,300	6,350.00	979,805,000	
9692	シーイーシー	43,000	1,294.00	55,642,000	貸付有価証券 9,100株
9697	カプコン	305,000	4,685.00	1,428,925,000	貸付有価証券 5,400株
9702	アイ・エス・ビー	15,600	1,192.00	18,595,200	貸付有価証券 1,600株
9717	ジャステック	18,800	1,272.00	23,913,600	貸付有価証券 2,700株
9719	S C S K	250,500	1,931.00	483,715,500	

9739	N S W	11,900	2,151.00	25,596,900	
9742	アイネス	21,500	1,351.00	29,046,500	
9746	T K C	55,100	3,600.00	198,360,000	
9749	富士ソフト	34,700	7,640.00	265,108,000	貸付有価証券 5,900株
9759	N S D	109,500	2,423.00	265,318,500	
9766	コナミグループ	131,400	6,250.00	821,250,000	
9790	福井コンピュータホールディングス	21,300	2,765.00	58,894,500	貸付有価証券 300株
9889	J B C Cホールディングス	22,400	2,179.00	48,809,600	
9928	ミロク情報サービス	27,900	1,667.00	46,509,300	
9984	ソフトバンクグループ	1,774,800	4,957.00	8,797,683,600	
2676	高千穂交易	7,500	2,552.00	19,140,000	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	1,685.00	5,897,500	貸付有価証券 500株
2692	伊藤忠食品	7,300	5,080.00	37,084,000	
2715	エレマテック	29,100	1,797.00	52,292,700	貸付有価証券 4,100株
2733	あらた	24,800	3,985.00	98,828,000	
2737	トーメンデバイス	4,700	6,740.00	31,678,000	
2760	東京エレクトロン デバイス	12,000	8,640.00	103,680,000	
2767	円谷フィールズホールディングス	55,600	1,982.00	110,199,200	
2768	双日	343,800	2,652.00	911,757,600	
2784	アルフレッサ ホールディングス	325,000	1,690.00	549,250,000	
2874	横浜冷凍	88,200	949.00	83,701,800	貸付有価証券 3,000株
3004	神栄	3,100	883.00	2,737,300	貸付有価証券 600株
3023	ラサ商事	9,600	1,438.00	13,804,800	
3036	アルコニックス	42,600	1,362.00	58,021,200	
3038	神戸物産	250,500	3,730.00	934,365,000	貸付有価証券 30,000株
3054	ハイパー	3,900	431.00	1,680,900	貸付有価証券 1,100株
3076	あい ホールディングス	51,800	2,207.00	114,322,600	貸付有価証券 6,200株
3079	ディーブイエックス	7,200	1,045.00	7,524,000	貸付有価証券 2,000株
3107	ダイワボウホールディングス	132,300	2,133.00	282,195,900	
3132	マクニカホールディングス	79,400	3,600.00	285,840,000	
3139	ラクト・ジャパン	12,500	1,994.00	24,925,000	貸付有価証券

					1,600株
3150	グリムス	13,400	2,308.00	30,927,200	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	47,300	893.00	42,238,900	貸付有価証券 500株
3153	八洲電機	26,200	1,197.00	31,361,400	貸付有価証券 1,000株
3154	メディアスホールディングス	20,700	769.00	15,918,300	貸付有価証券 2,500株
3156	レスターホールディングス	31,000	2,165.00	67,115,000	
3157	ジュテックホールディングス	4,100	1,271.00	5,211,100	貸付有価証券 1,700株
3160	大光	8,900	606.00	5,393,400	貸付有価証券 2,600株
3166	OCHIホールディングス	4,700	1,272.00	5,978,400	貸付有価証券 500株
3167	TOKAIホールディングス	159,900	880.00	140,712,000	
3168	黒谷	5,700	591.00	3,368,700	貸付有価証券 1,100株
3173	Cominix	3,700	799.00	2,956,300	貸付有価証券 1,000株
3176	三洋貿易	33,200	1,186.00	39,375,200	
3180	ビューティガレージ	5,100	3,850.00	19,635,000	貸付有価証券 900株
3183	ウイン・パートナーズ	23,600	1,048.00	24,732,800	貸付有価証券 1,400株
3321	ミタチ産業	5,300	1,449.00	7,679,700	貸付有価証券 1,300株
3360	シップヘルスケアホールディングス	116,400	2,403.00	279,709,200	貸付有価証券 1,500株
3388	明治電機工業	12,000	1,204.00	14,448,000	
3392	デリカフーズホールディングス	8,200	544.00	4,460,800	
3393	スターティアホールディングス	4,800	1,465.00	7,032,000	貸付有価証券 600株
3543	コメダホールディングス	79,300	2,334.00	185,086,200	貸付有価証券 12,600株
3559	ピーバンドットコム	2,900	562.00	1,629,800	貸付有価証券 800株
3565	アセンテック	10,800	552.00	5,961,600	貸付有価証券 600株
5009	富士興産	5,300	1,235.00	6,545,500	貸付有価証券 1,900株
6973	協栄産業	2,100	2,183.00	4,584,300	貸付有価証券 500株
7128	フルサト・マルカホールディングス	32,200	2,680.00	86,296,000	貸付有価証券 4,400株
7130	ヤマエグループホールディングス	18,300	1,673.00	30,615,900	

7414	小野建	29,700	1,484.00	44,074,800	
7417	南陽	4,000	2,261.00	9,044,000	貸付有価証券 1,000株
7420	佐鳥電機	13,100	1,613.00	21,130,300	貸付有価証券 3,200株
7427	エコートレーディング	4,400	860.00	3,784,000	貸付有価証券 1,300株
7433	伯東	18,500	4,740.00	87,690,000	貸付有価証券 3,500株
7438	コンドーテック	24,900	1,009.00	25,124,100	貸付有価証券 1,500株
7442	中山福	11,100	349.00	3,873,900	貸付有価証券 2,500株
7447	ナガイレーベン	40,900	1,987.00	81,268,300	貸付有価証券 7,000株
7451	三菱食品	29,900	3,225.00	96,427,500	貸付有価証券 1,800株
7456	松田産業	24,600	2,226.00	54,759,600	貸付有価証券 1,400株
7458	第一興商	62,600	4,280.00	267,928,000	
7459	メディパルホールディングス	335,800	1,800.00	604,440,000	
7466	S P K	14,400	1,753.00	25,243,200	
7467	萩原電気ホールディングス	12,400	3,200.00	39,680,000	
7476	アズワン	46,100	5,330.00	245,713,000	
7480	スズデン	11,300	2,617.00	29,572,100	
7481	尾家産業	4,900	1,104.00	5,409,600	貸付有価証券 1,600株
7482	シモジマ	22,200	981.00	21,778,200	
7483	ドウシシャ	34,200	1,926.00	65,869,200	貸付有価証券 1,000株
7487	小津産業	4,700	1,727.00	8,116,900	貸付有価証券 1,000株
7504	高速	16,800	1,940.00	32,592,000	
7510	たけびし	12,300	1,715.00	21,094,500	
7525	リックス	4,300	2,509.00	10,788,700	貸付有価証券 1,400株
7537	丸文	28,900	1,355.00	39,159,500	
7552	ハピネット	27,500	1,873.00	51,507,500	貸付有価証券 3,600株
7570	橋本総業ホールディングス	12,800	1,140.00	14,592,000	貸付有価証券 500株
7575	日本ライフライン	94,900	941.00	89,300,900	
7590	タカショー	28,200	692.00	19,514,400	貸付有価証券 3,300株
7599	I D O M	97,900	822.00	80,473,800	貸付有価証券

					17,200株
7607	進和	21,400	2,062.00	44,126,800	貸付有価証券 2,600株
7608	エスケイジャパン	5,100	582.00	2,968,200	貸付有価証券 1,200株
7609	ダイトロン	12,800	2,570.00	32,896,000	貸付有価証券 1,900株
7613	シークス	46,100	1,350.00	62,235,000	貸付有価証券 8,100株
7619	田中商事	6,500	646.00	4,199,000	
7628	オーハシテクニカ	16,200	1,579.00	25,579,800	
7637	白銅	11,700	2,564.00	29,998,800	貸付有価証券 600株
7673	ダイコー通産	2,500	1,158.00	2,895,000	貸付有価証券 500株
8001	伊藤忠商事	1,995,400	4,186.00	8,352,744,400	
8002	丸紅	2,556,500	1,740.50	4,449,588,250	
8007	高島	3,000	2,900.00	8,700,000	貸付有価証券 300株
8012	長瀬産業	152,200	2,002.00	304,704,400	貸付有価証券 800株
8014	蝶理	17,400	2,465.00	42,891,000	貸付有価証券 200株
8015	豊田通商	283,700	5,380.00	1,526,306,000	
8018	三共生興	46,500	558.00	25,947,000	
8020	兼松	125,700	1,627.00	204,513,900	貸付有価証券 200株
8025	ツカモトコーポレーション	3,500	1,470.00	5,145,000	貸付有価証券 1,100株
8031	三井物産	2,369,400	3,781.00	8,958,701,400	
8032	日本紙パルプ商事	17,200	5,090.00	87,548,000	貸付有価証券 2,500株
8037	カメイ	34,400	1,393.00	47,919,200	貸付有価証券 700株
8038	東都水産	1,100	6,480.00	7,128,000	貸付有価証券 600株
8041	OUGホールディングス	3,100	2,467.00	7,647,700	貸付有価証券 500株
8043	スターゼン	24,600	2,213.00	54,439,800	
8051	山善	87,300	1,008.00	87,998,400	貸付有価証券 10,200株
8052	椿本興業	5,200	4,195.00	21,814,000	
8053	住友商事	2,005,500	2,299.50	4,611,647,250	
8057	内田洋行	14,300	4,790.00	68,497,000	貸付有価証券 1,900株



8058	三菱商事	2,024,700	4,636.00	9,386,509,200	
8059	第一実業	11,400	5,360.00	61,104,000	貸付有価証券 400株
8060	キャノンマーケティングジャパン	75,000	3,085.00	231,375,000	貸付有価証券 19,000株
8061	西華産業	12,700	2,056.00	26,111,200	
8065	佐藤商事	22,500	1,397.00	31,432,500	貸付有価証券 1,500株
8068	菱洋エレクトロ	27,600	2,425.00	66,930,000	貸付有価証券 4,500株
8070	東京産業	29,500	715.00	21,092,500	貸付有価証券 900株
8074	ユアサ商事	29,200	3,755.00	109,646,000	
8075	神鋼商事	8,100	5,830.00	47,223,000	
8077	トルク	11,200	215.00	2,408,000	貸付有価証券 3,700株
8078	阪和興業	58,100	3,760.00	218,456,000	
8079	正栄食品工業	21,500	4,030.00	86,645,000	貸付有価証券 3,900株
8081	カナデン	26,200	1,142.00	29,920,400	貸付有価証券 300株
8084	菱電商事	26,100	1,864.00	48,650,400	貸付有価証券 1,500株
8088	岩谷産業	73,700	5,690.00	419,353,000	貸付有価証券 3,600株
8089	ナイス	6,500	1,335.00	8,677,500	貸付有価証券 100株
8091	ニチモウ	2,500	3,060.00	7,650,000	
8093	極東貿易	19,300	1,533.00	29,586,900	貸付有価証券 1,600株
8095	アステナホールディングス	56,000	428.00	23,968,000	貸付有価証券 5,700株
8097	三愛オプリー	89,400	1,328.00	118,723,200	貸付有価証券 10,300株
8098	稲畑産業	65,400	2,642.00	172,786,800	
8101	G S I クレオス	18,800	1,599.00	30,061,200	
8103	明和産業	43,000	686.00	29,498,000	貸付有価証券 7,100株
8104	クワザワホールディングス	7,500	489.00	3,667,500	貸付有価証券 2,200株
8125	ワキタ	59,500	1,178.00	70,091,000	貸付有価証券 9,300株
8129	東邦ホールディングス	80,600	2,319.00	186,911,400	
8130	サンゲツ	81,300	2,239.00	182,030,700	
8131	ミツウロコグループホールディングス	41,600	1,279.00	53,206,400	貸付有価証券 3,600株

8132	シナネンホールディングス	10,500	3,145.00	33,022,500	貸付有価証券 700株
8133	伊藤忠エネクス	80,300	1,136.00	91,220,800	
8136	サンリオ	91,700	5,650.00	518,105,000	貸付有価証券 5,200株
8137	サンワテクノス	16,500	1,989.00	32,818,500	
8140	リョーサン	34,300	3,300.00	113,190,000	貸付有価証券 700株
8141	新光商事	43,500	1,247.00	54,244,500	
8142	トーヨー	13,900	2,138.00	29,718,200	貸付有価証券 1,900株
8150	三信電気	13,000	2,472.00	32,136,000	
8151	東陽テクニカ	35,800	1,326.00	47,470,800	
8153	モスフードサービス	47,600	3,025.00	143,990,000	
8154	加賀電子	26,300	4,950.00	130,185,000	
8158	ソーダニッカ	16,900	821.00	13,874,900	貸付有価証券 1,700株
8159	立花エレテック	23,600	2,005.00	47,318,000	
8275	フォーバル	12,700	1,100.00	13,970,000	貸付有価証券 600株
8283	PALTAC	50,900	4,830.00	245,847,000	
8285	三谷産業	56,600	325.00	18,395,000	
8835	太平洋興発	7,800	852.00	6,645,600	貸付有価証券 500株
9260	西本Wismettacホールディングス	8,200	3,560.00	29,192,000	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	1,885.00	3,581,500	貸付有価証券 400株
9273	コア商事ホールディングス	18,100	710.00	12,851,000	貸付有価証券 5,000株
9274	KPPグループホールディングス	75,400	636.00	47,954,400	貸付有価証券 14,400株
9305	ヤマタネ	14,300	1,668.00	23,852,400	
9763	丸紅建材リース	1,800	1,963.00	3,533,400	貸付有価証券 400株
9810	日鉄物産	22,200	9,290.00	206,238,000	
9824	泉州電業	16,200	3,265.00	52,893,000	貸付有価証券 2,600株
9830	トラスコ中山	68,000	2,155.00	146,540,000	貸付有価証券 9,000株
9832	オートバックスセブン	112,700	1,446.00	162,964,200	
9837	モリト	23,200	1,002.00	23,246,400	貸付有価証券 4,500株
9869	加藤産業	39,300	3,525.00	138,532,500	貸付有価証券 5,800株

9872	北恵	4,700	711.00	3,341,700	貸付有価証券 800株
9882	イエローハット	57,100	1,790.00	102,209,000	貸付有価証券 3,400株
9896	J Kホールディングス	25,500	1,027.00	26,188,500	貸付有価証券 4,200株
9902	日伝	19,200	1,947.00	37,382,400	
9930	北沢産業	11,100	283.00	3,141,300	貸付有価証券 4,400株
9932	杉本商事	14,400	2,028.00	29,203,200	
9934	因幡電機産業	83,900	2,838.00	238,108,200	
9960	東テク	10,800	4,160.00	44,928,000	
9962	ミスミグループ本社	488,600	3,225.00	1,575,735,000	貸付有価証券 19,100株
9972	アルテック	11,600	273.00	3,166,800	貸付有価証券 5,000株
9982	タキヒヨー	5,700	955.00	5,443,500	貸付有価証券 1,300株
9986	蔵王産業	4,100	2,313.00	9,483,300	
9987	スズケン	100,700	3,305.00	332,813,500	貸付有価証券 4,800株
9991	ジェコス	20,900	868.00	18,141,200	貸付有価証券 400株
9995	グローセル	22,900	430.00	9,847,000	貸付有価証券 5,300株
2651	ローソン	80,400	5,470.00	439,788,000	貸付有価証券 11,000株
2659	サンエー	24,700	4,100.00	101,270,000	貸付有価証券 4,200株
2664	カワチ薬品	25,300	2,265.00	57,304,500	貸付有価証券 4,600株
2670	エービーシー・マート	47,200	7,100.00	335,120,000	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	1,297.00	12,062,100	
2678	アスクル	67,000	1,665.00	111,555,000	貸付有価証券 9,200株
2681	ゲオホールディングス	34,100	1,546.00	52,718,600	
2685	アダストリア	39,100	2,419.00	94,582,900	貸付有価証券 6,400株
2686	ジーフット	12,700	271.00	3,441,700	貸付有価証券 2,700株
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	3,100	424.00	1,314,400	貸付有価証券 600株
2695	くら寿司	37,900	3,165.00	119,953,500	貸付有価証券 4,600株
2698	キャンドウ	11,500	2,424.00	27,876,000	貸付有価証券 1,600株

2722	I Kホールディングス	6,700	378.00	2,532,600	貸付有価証券 1,400株
2726	パルグループホールディングス	31,800	2,983.00	94,859,400	貸付有価証券 5,200株
2730	エディオン	128,200	1,345.00	172,429,000	貸付有価証券 38,400株
2734	サーラコーポレーション	68,000	723.00	49,164,000	貸付有価証券 8,900株
2735	ワッツ	10,200	691.00	7,048,200	貸付有価証券 1,900株
2742	ハローズ	14,700	3,100.00	45,570,000	貸付有価証券 1,600株
2752	フジオフードグループ本社	26,900	1,391.00	37,417,900	貸付有価証券 5,200株
2753	あみやき亭	7,800	3,125.00	24,375,000	貸付有価証券 500株
2764	ひらまつ	44,800	192.00	8,601,600	貸付有価証券 12,400株
2791	大黒天物産	9,900	4,990.00	49,401,000	貸付有価証券 1,100株
2792	ハニーズホールディングス	25,500	1,544.00	39,372,000	貸付有価証券 3,800株
2796	ファーマライズホールディングス	4,500	614.00	2,763,000	貸付有価証券 1,000株
3028	アルペン	26,700	1,951.00	52,091,700	貸付有価証券 5,700株
3030	ハブ	6,900	663.00	4,574,700	貸付有価証券 2,100株
3034	クオールホールディングス	44,500	1,153.00	51,308,500	貸付有価証券 2,000株
3046	ジinzホールディングス	19,200	3,660.00	70,272,000	貸付有価証券 2,300株
3048	ビックカメラ	215,300	1,100.00	236,830,000	貸付有価証券 25,900株
3050	DCMホールディングス	197,700	1,141.00	225,575,700	貸付有価証券 24,400株
3053	ペッパーフードサービス	69,300	175.00	12,127,500	貸付有価証券 11,600株
3064	Monotaro	459,100	1,667.00	765,319,700	貸付有価証券 75,700株
3067	東京一番フーズ	4,800	499.00	2,395,200	貸付有価証券 1,600株
3073	DDホールディングス	11,100	716.00	7,947,600	貸付有価証券 1,700株
3082	きちりホールディングス	5,600	666.00	3,729,600	貸付有価証券 1,200株
3085	アークランドサービスホールディングス	26,500	2,217.00	58,750,500	貸付有価証券 3,200株
3086	J. フロント リテイリング	402,600	1,212.00	487,951,200	貸付有価証券 81,900株

3087	ドトール・日レスホールディングス	57,400	1,877.00	107,739,800	貸付有価証券 7,000株
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	196,400	6,770.00	1,329,628,000	
3091	ブロンコビリー	17,300	2,482.00	42,938,600	貸付有価証券 2,200株
3092	Z O Z O	214,000	3,060.00	654,840,000	
3093	トレジャー・ファクトリー	12,400	1,239.00	15,363,600	貸付有価証券 2,600株
3097	物語コーポレーション	54,100	2,627.00	142,120,700	貸付有価証券 6,600株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	545,100	1,379.00	751,692,900	貸付有価証券 76,400株
3134	H a m e e	11,200	941.00	10,539,200	貸付有価証券 1,800株
3135	マーケットエンタープライズ	2,100	1,253.00	2,631,300	貸付有価証券 400株
3141	ウエルシアホールディングス	168,000	2,807.00	471,576,000	貸付有価証券 25,800株
3148	クリエイトSDホールディングス	53,500	3,305.00	176,817,500	貸付有価証券 6,400株
3159	丸善CHIホールディングス	24,700	345.00	8,521,500	貸付有価証券 5,100株
3169	ミサワ	4,300	600.00	2,580,000	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	2,800	1,284.00	3,595,200	貸付有価証券 600株
3175	エー・ピーホールディングス	4,100	792.00	3,247,200	貸付有価証券 1,100株
3178	チムニー	6,500	1,192.00	7,748,000	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	24,100	863.00	20,798,300	貸付有価証券 4,500株
3182	オイシックス・ラ・大地	43,500	2,277.00	99,049,500	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	73,900	2,749.00	203,151,100	貸付有価証券 8,500株
3191	ジョイフル本田	96,200	1,684.00	162,000,800	貸付有価証券 15,100株
3193	鳥貴族ホールディングス	12,000	2,142.00	25,704,000	貸付有価証券 1,400株
3196	ホットランド	24,800	1,451.00	35,984,800	貸付有価証券 2,900株
3197	すかいらくホールディングス	442,700	1,665.00	737,095,500	貸付有価証券 48,900株
3198	S F Pホールディングス	17,700	1,846.00	32,674,200	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	25,000	1,436.00	35,900,000	貸付有価証券 1,400株
3221	ヨシックスホールディングス	4,100	2,122.00	8,700,200	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	105,500	1,111.00	117,210,500	貸付有価証券 12,700 株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	14,600	933.00	13,621,800	貸付有価証券 2,000 株
3328	B E E N O S	18,300	2,082.00	38,100,600	貸付有価証券 1,700 株
3333	あさひ	27,000	1,320.00	35,640,000	貸付有価証券 4,400 株
3341	日本調剤	22,000	1,145.00	25,190,000	貸付有価証券 1,600 株
3349	コスモス薬品	32,000	11,880.00	380,160,000	貸付有価証券 5,300 株
3361	トーエル	9,300	796.00	7,402,800	貸付有価証券 2,700 株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	1,116,000	5,850.00	6,528,600,000	貸付有価証券 340,400 株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	243,600	1,010.00	246,036,000	貸付有価証券 30,600 株
3391	ツルハホールディングス	68,000	8,620.00	586,160,000	貸付有価証券 12,300 株
3395	サンマルクホールディングス	26,100	1,792.00	46,771,200	
3396	フェリシモ	4,700	998.00	4,690,600	貸付有価証券 1,000 株
3397	トリドールホールディングス	80,500	2,758.00	222,019,000	貸付有価証券 14,900 株
3415	T O K Y O B A S E	33,300	510.00	16,983,000	貸付有価証券 4,900 株
3538	ウイルプラスホールディングス	4,000	1,114.00	4,456,000	貸付有価証券 800 株
3539	J Mホールディングス	27,500	1,890.00	51,975,000	貸付有価証券 3,900 株
3544	サツドラホールディングス	9,500	793.00	7,533,500	貸付有価証券 1,800 株
3546	アレンザホールディングス	24,200	964.00	23,328,800	貸付有価証券 2,600 株
3547	串カツ田中ホールディングス	8,600	1,619.00	13,923,400	貸付有価証券 900 株
3548	パロックジャパンリミテッド	21,000	811.00	17,031,000	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	28,900	6,630.00	191,607,000	貸付有価証券 6,300 株
3561	力の源ホールディングス	11,200	1,475.00	16,520,000	貸付有価証券 2,600 株
3563	F O O D & L I F E C O M P A N I E	186,000	3,325.00	618,450,000	貸付有価証券 21,900 株
4350	メディカルシステムネットワーク	28,100	395.00	11,099,500	貸付有価証券 600 株
7127	一家ホールディングス	4,500	590.00	2,655,000	貸付有価証券

					1,400株
7135	ジャパンクラフトホールディングス	6,500	571.00	3,711,500	貸付有価証券 600株
7416	はるやまホールディングス	9,900	502.00	4,969,800	貸付有価証券 2,500株
7419	ノジマ	105,700	1,380.00	145,866,000	
7421	カップ・クリエイト	50,900	1,443.00	73,448,700	貸付有価証券 7,000株
7445	ライトオン	15,800	556.00	8,784,800	貸付有価証券 5,800株
7453	良品計画	417,800	1,420.00	593,276,000	貸付有価証券 89,200株
7455	パリミキホールディングス	26,100	350.00	9,135,000	貸付有価証券 2,200株
7463	アドヴァングループ	30,800	970.00	29,876,000	貸付有価証券 900株
7475	アルビス	10,600	2,498.00	26,478,800	貸付有価証券 500株
7494	コナカ	22,800	357.00	8,139,600	貸付有価証券 2,700株
7506	ハウス オブ ローゼ	2,600	1,667.00	4,334,200	貸付有価証券 200株
7508	G-7ホールディングス	40,300	1,434.00	57,790,200	貸付有価証券 3,700株
7512	イオン北海道	47,900	800.00	38,320,000	貸付有価証券 6,200株
7513	コジマ	62,400	545.00	34,008,000	貸付有価証券 7,500株
7514	ヒマラヤ	6,600	915.00	6,039,000	貸付有価証券 1,700株
7516	コーナン商事	43,700	3,185.00	139,184,500	貸付有価証券 6,200株
7520	エコス	12,000	1,860.00	22,320,000	貸付有価証券 1,600株
7522	ワタミ	39,100	893.00	34,916,300	貸付有価証券 2,700株
7524	マルシェ	6,900	390.00	2,691,000	貸付有価証券 1,500株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	653,600	2,479.00	1,620,274,400	貸付有価証券 104,500株
7545	西松屋チェーン	71,700	1,641.00	117,659,700	貸付有価証券 10,200株
7550	ゼンショーホールディングス	177,200	4,040.00	715,888,000	貸付有価証券 6,500株
7554	幸楽苑ホールディングス	21,100	1,086.00	22,914,600	貸付有価証券 2,700株
7561	ハークスレイ	8,800	769.00	6,767,200	貸付有価証券 200株
7581	サイゼリヤ	53,800	3,265.00	175,657,000	貸付有価証券

					8,600株
7593	V Tホールディングス	123,000	506.00	62,238,000	
7596	魚力	10,000	2,161.00	21,610,000	
7601	ポプラ	4,600	136.00	625,600	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	18,300	1,292.00	23,643,600	貸付有価証券 2,400株
7606	ユナイテッドアローズ	34,600	1,829.00	63,283,400	貸付有価証券 4,600株
7611	ハイデイ日高	48,000	2,109.00	101,232,000	貸付有価証券 6,300株
7615	YU-WA Creation Holdi	12,400	200.00	2,480,000	貸付有価証券 2,700株
7616	コロワイド	149,200	1,910.00	284,972,000	貸付有価証券 24,000株
7618	ピーシーデポコーポレーション	36,100	295.00	10,649,500	貸付有価証券 6,800株
7630	巻番屋	25,600	4,910.00	125,696,000	貸付有価証券 4,600株
7640	トップカルチャー	6,700	196.00	1,313,200	貸付有価証券 1,600株
7646	P L A N T	4,900	665.00	3,258,500	貸付有価証券 1,100株
7649	スギホールディングス	65,200	5,620.00	366,424,000	貸付有価証券 10,200株
7679	薬王堂ホールディングス	18,100	2,561.00	46,354,100	貸付有価証券 1,900株
7918	ヴィア・ホールディングス	27,800	95.00	2,641,000	貸付有価証券 6,600株
8005	スクロール	48,000	820.00	39,360,000	
8008	ヨンドシーホールディングス	27,800	1,789.00	49,734,200	貸付有価証券 4,400株
8160	木曽路	49,000	2,191.00	107,359,000	貸付有価証券 2,700株
8163	S R Sホールディングス	53,400	950.00	50,730,000	貸付有価証券 2,000株
8165	千趣会	59,600	400.00	23,840,000	貸付有価証券 7,800株
8166	タカキュー	14,300	74.00	1,058,200	貸付有価証券 5,000株
8167	リテールパートナーズ	48,000	1,361.00	65,328,000	貸付有価証券 5,900株
8168	ケーヨー	52,200	829.00	43,273,800	貸付有価証券 10,500株
8173	上新電機	28,800	1,987.00	57,225,600	貸付有価証券 3,900株
8174	日本瓦斯	173,500	1,918.00	332,773,000	
8179	ロイヤルホールディングス	62,800	2,675.00	167,990,000	貸付有価証券



					9,400株
8181	東天紅	1,500	739.00	1,108,500	貸付有価証券 400株
8182	いなげや	31,500	1,280.00	40,320,000	
8185	チヨダ	30,900	802.00	24,781,800	貸付有価証券 5,600株
8194	ライフコーポレーション	28,300	2,533.00	71,683,900	貸付有価証券 3,300株
8200	リンガーハット	41,800	2,257.00	94,342,600	貸付有価証券 5,400株
8203	M r M a x HD	45,300	663.00	30,033,900	貸付有価証券 6,000株
8207	テンアライド	21,200	270.00	5,724,000	貸付有価証券 8,300株
8214	A O K I ホールディングス	60,200	819.00	49,303,800	貸付有価証券 6,700株
8217	オークワ	51,800	832.00	43,097,600	貸付有価証券 6,800株
8218	コメリ	49,800	2,719.00	135,406,200	
8219	青山商事	69,200	905.00	62,626,000	
8227	しまむら	38,000	13,300.00	505,400,000	貸付有価証券 5,200株
8230	はせがわ	11,200	378.00	4,233,600	貸付有価証券 3,000株
8233	高島屋	244,100	1,841.00	449,388,100	貸付有価証券 43,400株
8237	松屋	54,900	1,034.00	56,766,600	貸付有価証券 8,800株
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	157,600	1,400.00	220,640,000	
8244	近鉄百貨店	10,400	2,387.00	24,824,800	貸付有価証券 1,700株
8252	丸井グループ	238,800	1,998.00	477,122,400	
8255	アクシアル リテイリング	22,100	3,370.00	74,477,000	貸付有価証券 2,500株
8260	井筒屋	9,900	321.00	3,177,900	貸付有価証券 3,300株
8267	イオン	1,097,800	2,529.00	2,776,336,200	貸付有価証券 309,500株
8273	イズミ	49,200	3,075.00	151,290,000	貸付有価証券 8,900株
8276	平和堂	54,100	2,042.00	110,472,200	貸付有価証券 8,900株
8278	フジ	49,700	1,723.00	85,633,100	貸付有価証券 8,600株
8279	ヤオコー	36,600	6,840.00	250,344,000	貸付有価証券 2,600株
8281	ゼビオホールディングス	43,900	994.00	43,636,600	

8282	ケーズホールディングス	257,500	1,189.00	306,167,500	貸付有価証券 10,700株
8289	O l y m p i cグループ	9,300	512.00	4,761,600	貸付有価証券 2,200株
8291	日産東京販売ホールディングス	31,100	334.00	10,387,400	
9262	シルバーライフ	7,400	1,351.00	9,997,400	貸付有価証券 600株
9267	G e n k y D r u g S t o r e s	14,200	3,840.00	54,528,000	貸付有価証券 2,100株
9275	ナルミヤ・インターナショナル	4,500	921.00	4,144,500	貸付有価証券 700株
9278	ブックオフグループホールディングス	12,300	1,252.00	15,399,600	貸付有価証券 2,500株
9279	ギフトホールディングス	6,800	4,490.00	30,532,000	貸付有価証券 800株
9627	アインホールディングス	44,600	5,480.00	244,408,000	貸付有価証券 9,200株
9828	元気寿司	9,200	3,075.00	28,290,000	貸付有価証券 1,700株
9831	ヤマダホールディングス	1,327,800	473.00	628,049,400	貸付有価証券 11,700株
9842	アークランズ	47,400	1,484.00	70,341,600	貸付有価証券 6,800株
9843	ニトリホールディングス	131,000	16,335.00	2,139,885,000	
9850	グルメ杵屋	26,200	1,035.00	27,117,000	貸付有価証券 5,100株
9854	愛眼	15,500	174.00	2,697,000	貸付有価証券 6,400株
9856	ケーユーホールディングス	18,900	1,475.00	27,877,500	貸付有価証券 1,100株
9861	吉野家ホールディングス	126,700	2,398.00	303,826,600	貸付有価証券 14,600株
9887	松屋フーズホールディングス	15,300	4,105.00	62,806,500	貸付有価証券 1,300株
9900	サガミホールディングス	52,000	1,295.00	67,340,000	貸付有価証券 2,300株
9919	関西フードマーケット	29,200	1,465.00	42,778,000	貸付有価証券 4,900株
9936	王将フードサービス	21,300	6,060.00	129,078,000	貸付有価証券 1,300株
9946	ミニストップ	23,500	1,394.00	32,759,000	貸付有価証券 3,700株
9948	アークス	59,400	2,235.00	132,759,000	貸付有価証券 8,900株
9956	パローホールディングス	61,800	1,926.00	119,026,800	
9974	ベルク	16,100	5,560.00	89,516,000	貸付有価証券 2,200株
9979	大庄	11,300	1,020.00	11,526,000	貸付有価証券 2,300株

9983	ファーストリテイリング	145,700	27,645.00	4,027,876,500	貸付有価証券 30,300株
9989	サンドラッグ	122,900	3,640.00	447,356,000	
9990	サックスパーホールディングス	30,800	784.00	24,147,200	
9993	ヤマザワ	4,400	1,274.00	5,605,600	貸付有価証券 1,000株
9994	やまや	4,300	2,639.00	11,347,700	貸付有価証券 400株
9997	ベルーナ	77,900	684.00	53,283,600	
5830	いよぎんホールディングス	358,700	733.00	262,927,100	貸付有価証券 23,100株
5831	しずおかフィナンシャルグループ	681,200	929.00	632,834,800	
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	253,800	880.00	223,344,000	貸付有価証券 37,600株
7150	島根銀行	6,700	487.00	3,262,900	貸付有価証券 1,100株
7161	じもとホールディングス	14,000	390.00	5,460,000	貸付有価証券 1,400株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,495,800	314.00	469,681,200	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	38,600	2,485.00	95,921,000	
7180	九州フィナンシャルグループ	530,400	464.00	246,105,600	
7182	ゆうちょ銀行	858,300	1,116.00	957,862,800	貸付有価証券 174,400株
7184	富山第一銀行	75,100	577.00	43,332,700	貸付有価証券 4,700株
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,661,400	467.00	775,873,800	
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	190,900	987.00	188,418,300	貸付有価証券 900株
7322	三十三フィナンシャルグループ	27,000	1,574.00	42,498,000	
7327	第四北越フィナンシャルグループ	47,300	2,853.00	134,946,900	
7337	ひろぎんホールディングス	393,300	627.00	246,599,100	
7350	おきなわフィナンシャルグループ	28,700	2,107.00	60,470,900	貸付有価証券 4,000株
7380	十六フィナンシャルグループ	39,100	2,762.00	107,994,200	
7381	北國フィナンシャルホールディングス	25,400	3,855.00	97,917,000	貸付有価証券 4,500株
7384	プロクレアホールディングス	36,900	2,082.00	76,825,800	貸付有価証券 4,600株
7389	あいちフィナンシャルグループ	42,200	2,132.00	89,970,400	貸付有価証券 11,800株
8303	SBI新生銀行	88,900	2,266.00	201,447,400	貸付有価証券 10,900株
8304	あおぞら銀行	189,500	2,404.00	455,558,000	貸付有価証券 33,500株

8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,139,100	825.60	15,801,240,960	
8308	りそなホールディングス	3,809,900	600.00	2,285,940,000	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	547,800	4,525.00	2,478,795,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,202,800	5,136.00	11,313,580,800	
8331	千葉銀行	840,100	822.00	690,562,200	
8334	群馬銀行	584,900	435.00	254,431,500	貸付有価証券 36,500株
8336	武蔵野銀行	38,700	2,181.00	84,404,700	
8337	千葉興業銀行	45,600	483.00	22,024,800	
8338	筑波銀行	132,300	209.00	27,650,700	貸付有価証券 20,000株
8341	七十七銀行	96,500	2,098.00	202,457,000	
8343	秋田銀行	20,200	1,752.00	35,390,400	
8344	山形銀行	33,500	1,014.00	33,969,000	
8345	岩手銀行	20,600	2,152.00	44,331,200	貸付有価証券 2,900株
8346	東邦銀行	238,400	219.00	52,209,600	
8349	東北銀行	9,500	987.00	9,376,500	貸付有価証券 400株
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	240,600	2,477.00	595,966,200	
8358	スルガ銀行	265,700	450.00	119,565,000	
8359	八十二銀行	618,300	555.00	343,156,500	
8360	山梨中央銀行	31,000	1,126.00	34,906,000	
8361	大垣共立銀行	57,500	1,786.00	102,695,000	
8362	福井銀行	26,900	1,465.00	39,408,500	貸付有価証券 3,800株
8364	清水銀行	12,000	1,432.00	17,184,000	
8365	富山銀行	3,300	1,669.00	5,507,700	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	50,100	2,662.00	133,366,200	貸付有価証券 1,000株
8367	南都銀行	45,400	2,325.00	105,555,000	
8368	百五銀行	283,600	367.00	104,081,200	貸付有価証券 40,900株
8369	京都銀行	95,500	6,130.00	585,415,000	
8370	紀陽銀行	107,800	1,470.00	158,466,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	191,600	922.00	176,655,200	
8381	山陰合同銀行	188,700	734.00	138,505,800	
8383	鳥取銀行	6,700	1,179.00	7,899,300	貸付有価証券 1,800株
8386	百十四銀行	27,500	1,841.00	50,627,500	

8387	四国銀行	47,900	877.00	42,008,300	貸付有価証券 500株
8388	阿波銀行	44,500	1,925.00	85,662,500	
8392	大分銀行	18,100	2,019.00	36,543,900	
8393	宮崎銀行	19,700	2,321.00	45,723,700	
8395	佐賀銀行	17,700	1,602.00	28,355,400	
8399	琉球銀行	69,100	907.00	62,673,700	貸付有価証券 800株
8410	セブン銀行	1,079,800	265.00	286,147,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	4,359,400	1,842.50	8,032,194,500	
8416	高知銀行	6,700	668.00	4,475,600	
8418	山口フィナンシャルグループ	332,800	794.00	264,243,200	貸付有価証券 20,300株
8521	長野銀行	6,500	1,406.00	9,139,000	貸付有価証券 200株
8522	名古屋銀行	19,900	3,130.00	62,287,000	
8524	北洋銀行	456,700	277.00	126,505,900	
8537	大光銀行	6,300	1,129.00	7,112,700	
8541	愛媛銀行	40,600	841.00	34,144,600	
8542	トマト銀行	6,400	1,025.00	6,560,000	貸付有価証券 1,700株
8544	京葉銀行	140,000	557.00	77,980,000	
8550	栃木銀行	138,000	266.00	36,708,000	貸付有価証券 15,600株
8551	北日本銀行	10,600	1,970.00	20,882,000	
8558	東和銀行	55,300	551.00	30,470,300	
8562	福島銀行	22,400	227.00	5,084,800	貸付有価証券 6,300株
8563	大東銀行	9,300	664.00	6,175,200	貸付有価証券 2,500株
8600	トモニホールディングス	243,600	348.00	84,772,800	
8713	フィデアホールディングス	31,100	1,342.00	41,736,200	
8714	池田泉州ホールディングス	386,000	230.00	88,780,000	貸付有価証券 3,500株
7148	F P G	122,300	1,120.00	136,976,000	貸付有価証券 200株
7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	24,600	1,037.00	25,510,200	貸付有価証券 2,500株
7347	マーキュリアホールディングス	11,400	718.00	8,185,200	貸付有価証券 2,300株
8473	S B Iホールディングス	436,300	2,672.00	1,165,793,600	
8518	日本アジア投資	16,700	260.00	4,342,000	貸付有価証券 5,400株

8595	ジャフコ グループ	100,600	2,041.00	205,324,600	
8601	大和証券グループ本社	2,155,500	613.00	1,321,321,500	
8604	野村ホールディングス	5,551,400	498.70	2,768,483,180	
8609	岡三証券グループ	264,600	481.00	127,272,600	貸付有価証券 12,900株
8613	丸三証券	100,300	441.00	44,232,300	貸付有価証券 22,500株
8614	東洋証券	100,000	355.00	35,500,000	貸付有価証券 6,400株
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	328,100	377.00	123,693,700	貸付有価証券 21,900株
8617	光世証券	4,400	416.00	1,830,400	貸付有価証券 1,500株
8622	水戸証券	80,900	308.00	24,917,200	貸付有価証券 3,200株
8624	いちよし証券	55,500	617.00	34,243,500	
8628	松井証券	178,000	795.00	141,510,000	
8698	マネックスグループ	336,700	484.00	162,962,800	貸付有価証券 5,000株
8706	極東証券	37,500	609.00	22,837,500	
8707	岩井コスモホールディングス	34,400	1,404.00	48,297,600	
8708	アイザワ証券グループ	43,500	702.00	30,537,000	
8732	マネーパートナーズグループ	22,500	270.00	6,075,000	貸付有価証券 4,800株
8739	スパークス・グループ	33,600	1,447.00	48,619,200	貸付有価証券 1,000株
8742	小林洋行	7,500	234.00	1,755,000	貸付有価証券 1,800株
7181	かんぽ生命保険	366,000	2,071.00	757,986,000	
8630	SOMPOホールディングス	517,300	5,328.00	2,756,174,400	
8715	アニコム ホールディングス	102,400	505.00	51,712,000	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	613,400	4,122.00	2,528,434,800	
8750	第一生命ホールディングス	1,534,500	2,335.00	3,583,057,500	
8766	東京海上ホールディングス	3,035,300	2,527.50	7,671,720,750	
8795	T & Dホールディングス	809,000	1,525.00	1,233,725,000	
8798	アドバンスクリエイト	17,400	1,033.00	17,974,200	
7164	全国保証	78,800	5,150.00	405,820,000	貸付有価証券 5,000株
7183	あんしん保証	8,400	259.00	2,175,600	貸付有価証券 1,800株
7187	ジェイリース	7,100	2,141.00	15,201,100	貸付有価証券 1,200株

7191	イントラスト	8,900	989.00	8,802,100	貸付有価証券 1,700株
7192	日本モーゲージサービス	11,700	715.00	8,365,500	貸付有価証券 2,400株
7196	C a s a	7,500	820.00	6,150,000	貸付有価証券 1,600株
7198	アルヒ	37,200	1,074.00	39,952,800	
7199	プレミアグループ	50,600	1,628.00	82,376,800	
7383	ネットプロテクションズホールディングス	99,700	533.00	53,140,100	貸付有価証券 14,800株
8253	クレディセゾン	191,000	1,689.00	322,599,000	
8424	芙蓉総合リース	27,700	8,890.00	246,253,000	貸付有価証券 1,400株
8425	みずほリース	44,900	3,490.00	156,701,000	
8439	東京センチュリー	56,300	4,290.00	241,527,000	貸付有価証券 7,800株
8511	日本証券金融	120,900	991.00	119,811,900	貸付有価証券 11,500株
8515	アイフル	499,200	347.00	173,222,400	貸付有価証券 66,600株
8566	リコーリース	28,600	3,880.00	110,968,000	貸付有価証券 1,100株
8570	イオンフィナンシャルサービス	173,100	1,214.00	210,143,400	貸付有価証券 36,800株
8572	アコム	538,100	317.00	170,577,700	貸付有価証券 33,900株
8584	ジャックス	32,100	4,315.00	138,511,500	
8585	オリエントコーポレーション	78,700	1,120.00	88,144,000	
8591	オリックス	1,978,700	2,138.00	4,230,460,600	
8593	三菱HCキャピタル	1,175,300	684.00	803,905,200	
8596	九州リースサービス	9,100	900.00	8,190,000	
8697	日本取引所グループ	847,000	2,055.00	1,740,585,000	
8771	イー・ギャランティ	48,700	2,187.00	106,506,900	
8772	アサックス	11,000	638.00	7,018,000	貸付有価証券 2,700株
8793	NECキャピタルソリューション	14,800	2,549.00	37,725,200	
1878	大東建託	110,400	12,860.00	1,419,744,000	
2337	いちご	347,100	269.00	93,369,900	貸付有価証券 66,100株
2353	日本駐車場開発	358,900	231.00	82,905,900	貸付有価証券 61,100株
2975	スター・マイカ・ホールディングス	27,200	689.00	18,740,800	貸付有価証券 5,000株
2980	SREホールディングス	14,800	3,265.00	48,322,000	貸付有価証券 800株

2982	A Dワークスグループ	47,400	166.00	7,868,400	貸付有価証券 8,600株
3003	ヒューリック	703,100	1,056.00	742,473,600	貸付有価証券 140,800株
3228	三栄建築設計	14,600	1,518.00	22,162,800	貸付有価証券 1,700株
3231	野村不動産ホールディングス	188,400	2,872.00	541,084,800	
3232	三重交通グループホールディングス	64,500	540.00	34,830,000	
3244	サムティ	47,900	2,126.00	101,835,400	貸付有価証券 6,200株
3245	ディア・ライフ	46,200	651.00	30,076,200	
3246	コーセーアールイー	6,200	723.00	4,482,600	貸付有価証券 1,600株
3252	地主	23,000	1,862.00	42,826,000	貸付有価証券 2,700株
3254	プレサンスコーポレーション	39,600	1,751.00	69,339,600	
3271	T H E グローバル社	11,300	211.00	2,384,300	貸付有価証券 2,800株
3275	ハウスコム	3,700	1,111.00	4,110,700	貸付有価証券 600株
3276	J P M C	15,200	1,054.00	16,020,800	貸付有価証券 2,100株
3277	サンセイランディック	5,700	837.00	4,770,900	貸付有価証券 1,300株
3280	エストラスト	2,500	585.00	1,462,500	貸付有価証券 600株
3284	フージャースホールディングス	46,500	827.00	38,455,500	
3288	オープンハウスグループ	110,300	4,880.00	538,264,000	
3289	東急不動産ホールディングス	906,300	627.00	568,250,100	
3291	飯田グループホールディングス	264,100	2,126.00	561,476,600	
3294	イーグランド	3,000	1,499.00	4,497,000	貸付有価証券 700株
3299	ムゲンエステート	13,000	556.00	7,228,000	貸付有価証券 3,600株
3452	ビーロット	13,300	618.00	8,219,400	貸付有価証券 2,000株
3454	ファーストブラザーズ	3,900	854.00	3,330,600	貸付有価証券 1,000株
3457	A n d D o ホールディングス	17,900	891.00	15,948,900	貸付有価証券 2,400株
3458	シーアールイー	13,700	1,288.00	17,645,600	貸付有価証券 1,100株
3464	プロパティエージェント	2,500	1,160.00	2,900,000	貸付有価証券 200株
3465	ケイアイスター不動産	14,500	4,150.00	60,175,000	
3467	アグレ都市デザイン	3,500	1,618.00	5,663,000	貸付有価証券



					1,000株
3475	グッドコムアセット	28,000	798.00	22,344,000	貸付有価証券 4,700株
3480	ジェイ・エス・ビー	7,500	4,230.00	31,725,000	貸付有価証券 1,000株
3482	ロードスターキャピタル	12,900	1,391.00	17,943,900	貸付有価証券 1,800株
3484	テンポイノベーション	5,900	1,204.00	7,103,600	貸付有価証券 1,400株
3486	グローバル・リンク・マネジメント	3,700	1,232.00	4,558,400	貸付有価証券 700株
3489	フェイスネットワーク	2,700	1,831.00	4,943,700	貸付有価証券 400株
4666	パーク24	234,900	1,900.00	446,310,000	貸付有価証券 35,400株
4809	パラカ	10,600	2,001.00	21,210,600	
6620	宮越ホールディングス	13,700	799.00	10,946,300	貸付有価証券 2,000株
8801	三井不動産	1,310,100	2,406.00	3,152,100,600	貸付有価証券 88,000株
8802	三菱地所	1,818,800	1,563.00	2,842,784,400	
8803	平和不動産	48,900	3,730.00	182,397,000	貸付有価証券 100株
8804	東京建物	287,300	1,570.00	451,061,000	貸付有価証券 62,800株
8818	京阪神ビルディング	38,000	1,171.00	44,498,000	
8830	住友不動産	544,900	2,905.00	1,582,934,500	
8841	テーオーシー	54,500	611.00	33,299,500	貸付有価証券 3,200株
8842	東京楽天地	5,200	4,025.00	20,930,000	貸付有価証券 700株
8848	レオパレス21	339,300	331.00	112,308,300	貸付有価証券 68,400株
8850	スターツコーポレーション	43,300	2,509.00	108,639,700	貸付有価証券 4,500株
8860	フジ住宅	42,200	676.00	28,527,200	
8864	空港施設	36,400	543.00	19,765,200	貸付有価証券 2,300株
8869	明和地所	9,900	869.00	8,603,100	貸付有価証券 1,800株
8871	ゴールドクレスト	28,700	1,703.00	48,876,100	貸付有価証券 1,200株
8877	エスリード	14,200	2,230.00	31,666,000	
8881	日神グループホールディングス	48,400	466.00	22,554,400	貸付有価証券 3,900株
8892	日本エスコン	67,700	828.00	56,055,600	貸付有価証券 7,900株

8897	M I R A R T Hホールディングス	152,300	381.00	58,026,300	貸付有価証券 1,500株
8904	A V A N T I A	9,900	799.00	7,910,100	貸付有価証券 2,500株
8905	イオンモール	156,300	1,699.00	265,553,700	貸付有価証券 21,900株
8908	毎日コムネット	7,200	803.00	5,781,600	貸付有価証券 1,300株
8917	ファースト住建	7,900	1,100.00	8,690,000	貸付有価証券 1,900株
8918	ランド	1,814,200	10.00	18,142,000	貸付有価証券 344,000株
8919	カチタス	81,000	2,541.00	205,821,000	
8923	トーセイ	50,100	1,426.00	71,442,600	貸付有価証券 6,000株
8928	穴吹興産	4,600	2,199.00	10,115,400	貸付有価証券 1,300株
8934	サンフロンティア不動産	50,200	1,222.00	61,344,400	
8935	F Jネクストホールディングス	31,700	983.00	31,161,100	貸付有価証券 1,200株
8940	インテリックス	4,700	523.00	2,458,100	貸付有価証券 1,300株
8944	ランドビジネス	7,100	246.00	1,746,600	貸付有価証券 700株
8945	サンネクスタグループ	6,400	994.00	6,361,600	貸付有価証券 1,100株
8999	グランディハウス	14,400	568.00	8,179,200	貸付有価証券 3,400株
9706	日本空港ビルデング	106,600	6,410.00	683,306,000	貸付有価証券 19,400株
1717	明豊ファシリティワークス	9,300	795.00	7,393,500	貸付有価証券 200株
1954	日本工営	19,000	3,240.00	61,560,000	貸付有価証券 2,800株
2120	L I F U L L	107,600	214.00	23,026,400	貸付有価証券 5,100株
2121	M I X I	71,600	2,694.00	192,890,400	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	28,400	2,571.00	73,016,400	貸付有価証券 2,800株
2127	日本M&Aセンターホールディングス	539,900	1,005.00	542,599,500	
2130	メンバーズ	9,200	1,297.00	11,932,400	
2139	中広	3,300	409.00	1,349,700	貸付有価証券 200株
2146	U Tグループ	46,200	2,407.00	111,203,400	貸付有価証券 9,800株
2148	アイティメディア	11,900	1,376.00	16,374,400	貸付有価証券 400株
2153	E・Jホールディングス	18,400	1,451.00	26,698,400	貸付有価証券

					1,000株
2154	オープンアップグループ	94,300	1,895.00	178,698,500	貸付有価証券 4,600株
2157	コシダカホールディングス	94,200	928.00	87,417,600	貸付有価証券 13,000株
2163	アルトナー	4,900	1,325.00	6,492,500	貸付有価証券 1,400株
2168	パソナグループ	38,200	1,844.00	70,440,800	貸付有価証券 6,900株
2169	CDS	5,100	1,805.00	9,205,500	貸付有価証券 1,100株
2170	リンクアンドモチベーション	90,600	531.00	48,108,600	貸付有価証券 11,000株
2175	エス・エム・エス	119,700	3,200.00	383,040,000	
2180	サニーサイドアップグループ	7,100	621.00	4,409,100	貸付有価証券 1,400株
2181	パーソルホールディングス	352,200	2,604.00	917,128,800	貸付有価証券 4,900株
2183	リニカル	11,500	684.00	7,866,000	貸付有価証券 2,600株
2193	クックパッド	86,100	218.00	18,769,800	貸付有価証券 17,600株
2196	エスクリ	9,200	335.00	3,082,000	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	677.00	6,770,000	貸付有価証券 3,000株
2301	学情	14,200	1,610.00	22,862,000	貸付有価証券 1,500株
2305	スタジオアリス	15,700	2,114.00	33,189,800	貸付有価証券 2,100株
2309	シミックホールディングス	17,300	2,057.00	35,586,100	貸付有価証券 1,100株
2311	エプコ	4,300	711.00	3,057,300	貸付有価証券 800株
2325	N J S	6,900	2,199.00	15,173,100	貸付有価証券 900株
2331	総合警備保障	116,800	3,565.00	416,392,000	
2371	カカクコム	230,900	1,839.00	424,625,100	貸付有価証券 13,500株
2372	アイロムグループ	11,300	1,799.00	20,328,700	貸付有価証券 400株
2374	セントケア・ホールディング	20,000	758.00	15,160,000	貸付有価証券 1,300株
2376	サイネックス	3,500	591.00	2,068,500	貸付有価証券 1,300株
2378	ルネサンス	22,000	942.00	20,724,000	貸付有価証券 3,600株
2379	ディップ	55,100	3,420.00	188,442,000	貸付有価証券 6,000株

2389	デジタルホールディングス	24,500	1,137.00	27,856,500	貸付有価証券 3,100株
2395	新日本科学	33,400	2,816.00	94,054,400	貸付有価証券 4,600株
2410	キャリアデザインセンター	4,200	2,203.00	9,252,600	貸付有価証券 1,600株
2412	ベネフィット・ワン	145,800	1,915.00	279,207,000	
2413	エムスリー	621,700	3,390.00	2,107,563,000	
2418	ツカダ・グローバルホールディング	13,100	410.00	5,371,000	貸付有価証券 3,700株
2424	プラス	2,700	1,068.00	2,883,600	貸付有価証券 600株
2427	アウトソーシング	187,400	1,248.00	233,875,200	貸付有価証券 24,400株
2428	ウェルネット	18,100	629.00	11,384,900	貸付有価証券 5,600株
2429	ワールドホールディングス	14,100	2,534.00	35,729,400	貸付有価証券 1,400株
2432	ディー・エヌ・エー	134,100	1,792.00	240,307,200	貸付有価証券 700株
2433	博報堂DYホールディングス	401,300	1,433.00	575,062,900	
2440	ぐるなび	57,800	334.00	19,305,200	貸付有価証券 10,000株
2445	タカミヤ	42,700	432.00	18,446,400	貸付有価証券 500株
2453	ジャパンベストレスキューシステム	19,500	726.00	14,157,000	貸付有価証券 1,600株
2461	ファンコミュニケーションズ	61,600	401.00	24,701,600	貸付有価証券 15,600株
2462	ライク	11,700	1,958.00	22,908,600	貸付有価証券 1,700株
2464	ビジネス・ブレークスルー	7,600	469.00	3,564,400	貸付有価証券 2,500株
2471	エスプール	90,400	579.00	52,341,600	貸付有価証券 9,900株
2475	WDBホールディングス	16,100	2,009.00	32,344,900	
2485	ティア	11,900	434.00	5,164,600	
2487	CDG	2,200	1,197.00	2,633,400	貸付有価証券 400株
2489	アドウェイズ	43,300	686.00	29,703,800	貸付有価証券 7,500株
2491	バリューコマース	23,700	1,715.00	40,645,500	貸付有価証券 4,500株
2492	インフォマート	326,600	285.00	93,081,000	貸付有価証券 46,400株
2749	J Pホールディングス	90,500	345.00	31,222,500	貸付有価証券 2,100株
3521	エコナックホールディングス	35,300	93.00	3,282,900	貸付有価証券

					11,100株
4286	C Lホールディングス	8,700	833.00	7,247,100	貸付有価証券 1,100株
4290	プレステージ・インターナショナル	132,300	584.00	77,263,200	貸付有価証券 3,400株
4301	アミューズ	17,100	1,815.00	31,036,500	
4310	ドリームインキュベータ	9,600	2,819.00	27,062,400	
4318	クイック	24,000	1,797.00	43,128,000	
4319	T A C	11,100	202.00	2,242,200	貸付有価証券 2,900株
4324	電通グループ	309,200	4,390.00	1,357,388,000	貸付有価証券 63,200株
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	9,300	1,317.00	12,248,100	貸付有価証券 1,600株
4337	ぴあ	10,500	3,250.00	34,125,000	貸付有価証券 1,600株
4343	イオンファンタジー	13,600	2,622.00	35,659,200	貸付有価証券 1,800株
4345	シーティーエス	34,800	759.00	26,413,200	
4346	ネクシィーズグループ	6,300	622.00	3,918,600	貸付有価証券 2,100株
4544	H. U. グループホールディングス	92,100	2,672.00	246,091,200	
4641	アルプス技研	27,400	2,438.00	66,801,200	貸付有価証券 4,900株
4651	サニックス	50,400	281.00	14,162,400	貸付有価証券 9,500株
4658	日本空調サービス	33,800	728.00	24,606,400	貸付有価証券 3,700株
4661	オリエンタルランド	333,000	21,885.00	7,287,705,000	
4665	ダスキン	70,000	3,200.00	224,000,000	貸付有価証券 4,800株
4668	明光ネットワークジャパン	41,400	634.00	26,247,600	貸付有価証券 5,000株
4671	ファルコホールディングス	14,200	1,979.00	28,101,800	貸付有価証券 700株
4678	秀英予備校	4,500	429.00	1,930,500	貸付有価証券 200株
4679	田谷	3,700	539.00	1,994,300	貸付有価証券 1,000株
4680	ラウンドワン	263,100	490.00	128,919,000	貸付有価証券 5,600株
4681	リゾートトラスト	124,200	2,110.00	262,062,000	貸付有価証券 5,600株
4694	ビー・エム・エル	39,000	3,100.00	120,900,000	貸付有価証券 2,000株
4708	りらいあコミュニケーションズ	51,900	1,459.00	75,722,100	
4714	リソー教育	143,000	325.00	46,475,000	貸付有価証券

					21,000株
4718	早稲田アカデミー	17,400	1,212.00	21,088,800	
4732	ユー・エス・エス	323,600	2,270.00	734,572,000	
4745	東京個別指導学院	37,300	517.00	19,284,100	貸付有価証券 2,200株
4751	サイバーエージェント	752,900	1,116.00	840,236,400	貸付有価証券 44,800株
4755	楽天グループ	1,456,600	623.00	907,461,800	貸付有価証券 401,200株
4763	クリーク・アンド・リバー社	18,400	2,216.00	40,774,400	貸付有価証券 2,200株
4765	モーニングスター	51,300	503.00	25,803,900	
4767	テー・オー・ダブリュ	61,700	314.00	19,373,800	貸付有価証券 7,400株
4792	山田コンサルティンググループ	15,900	1,501.00	23,865,900	
4801	セントラルスポーツ	11,800	2,507.00	29,582,600	貸付有価証券 1,200株
4848	フルキャストホールディングス	30,000	2,313.00	69,390,000	貸付有価証券 6,000株
4849	エン・ジャパン	56,900	2,440.00	138,836,000	
5261	リソルホールディングス	2,200	5,220.00	11,484,000	貸付有価証券 1,100株
6028	テクノプロ・ホールディングス	186,100	3,575.00	665,307,500	貸付有価証券 29,200株
6029	アトラグループ	4,600	185.00	851,000	貸付有価証券 1,300株
6032	インターワークス	5,900	367.00	2,165,300	貸付有価証券 800株
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	16,300	2,243.00	36,560,900	貸付有価証券 700株
6036	Keepers 技研	19,400	4,875.00	94,575,000	貸付有価証券 3,200株
6037	ファーストロジック	3,100	840.00	2,604,000	貸付有価証券 1,000株
6044	三機サービス	3,500	933.00	3,265,500	貸付有価証券 900株
6047	Gunosy	25,000	603.00	15,075,000	貸付有価証券 4,800株
6048	デザインワン・ジャパン	6,100	192.00	1,171,200	貸付有価証券 1,100株
6050	イー・ガーディアン	11,900	2,300.00	27,370,000	
6054	リブセンス	9,400	262.00	2,462,800	貸付有価証券 2,700株
6055	ジャパンマテリアル	96,300	2,255.00	217,156,500	
6058	バクトル	49,400	1,517.00	74,939,800	貸付有価証券 5,300株
6059	ウチヤマホールディングス	10,100	280.00	2,828,000	貸付有価証券

					3,400株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	26,200	1,078.00	28,243,600	貸付有価証券 4,300株
6070	キャリアリンク	11,500	2,533.00	29,129,500	
6071	I B J	19,200	680.00	13,056,000	貸付有価証券 2,900株
6073	アサンテ	15,500	1,674.00	25,947,000	
6078	バリューHR	27,500	1,597.00	43,917,500	貸付有価証券 4,300株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	29,100	3,770.00	109,707,000	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	11,200	1,152.00	12,902,400	貸付有価証券 400株
6083	E R Iホールディングス	5,700	1,469.00	8,373,300	貸付有価証券 1,300株
6087	アビスト	3,200	3,035.00	9,712,000	貸付有価証券 800株
6088	シグマクシス・ホールディングス	47,700	1,091.00	52,040,700	貸付有価証券 400株
6089	ウィルグループ	26,200	1,087.00	28,479,400	貸付有価証券 800株
6093	エスクロー・エージェンツ・ジャパン	21,300	149.00	3,173,700	貸付有価証券 7,700株
6095	メドピア	24,800	1,111.00	27,552,800	貸付有価証券 2,000株
6096	レアジョブ	3,900	1,273.00	4,964,700	貸付有価証券 1,200株
6098	リクルートホールディングス	2,329,300	3,700.00	8,618,410,000	
6099	エラン	41,600	1,053.00	43,804,800	貸付有価証券 5,000株
6171	土木管理総合試験所	8,500	329.00	2,796,500	貸付有価証券 1,900株
6178	日本郵政	4,123,500	1,092.50	4,504,923,750	
6183	バルシステム24ホールディングス	42,200	1,416.00	59,755,200	貸付有価証券 11,200株
6184	鎌倉新書	35,700	968.00	34,557,600	貸付有価証券 5,200株
6185	SMN	4,700	449.00	2,110,300	貸付有価証券 900株
6186	一蔵	2,600	580.00	1,508,000	貸付有価証券 500株
6189	グローバルキッズCOMPANY	3,100	799.00	2,476,900	貸付有価証券 600株
6191	エアトリ	20,300	2,628.00	53,348,400	貸付有価証券 500株
6194	アトラエ	24,700	879.00	21,711,300	貸付有価証券 3,000株
6196	ストライク	15,500	3,830.00	59,365,000	貸付有価証券

					1,600株
6197	ソラスト	86,700	635.00	55,054,500	貸付有価証券 2,300株
6199	セラク	11,200	1,588.00	17,785,600	貸付有価証券 1,300株
6200	インソース	78,100	1,363.00	106,450,300	貸付有価証券 800株
6532	ベйкаレント・コンサルティング	249,000	5,390.00	1,342,110,000	貸付有価証券 26,000株
6533	Orchestra Holdings	6,700	1,680.00	11,256,000	貸付有価証券 800株
6535	アイモバイル	16,300	1,272.00	20,733,600	貸付有価証券 1,800株
6538	キャリアインデックス	7,000	313.00	2,191,000	貸付有価証券 1,700株
6539	MS-Japan	8,300	1,016.00	8,432,800	貸付有価証券 2,600株
6540	船場	3,500	739.00	2,586,500	貸付有価証券 700株
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	112,100	2,055.00	230,365,500	貸付有価証券 2,600株
6546	フルテック	2,900	1,063.00	3,082,700	貸付有価証券 600株
6547	グリーンズ	7,700	1,371.00	10,556,700	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	657.00	3,744,900	貸付有価証券 200株
6552	GameWith	6,100	356.00	2,171,600	貸付有価証券 1,400株
6555	MS&Consulting	3,000	610.00	1,830,000	貸付有価証券 600株
6556	ウェルビー	23,100	626.00	14,460,600	
6560	エル・ティー・エス	4,000	2,693.00	10,772,000	貸付有価証券 800株
6564	ミダックホールディングス	19,100	2,225.00	42,497,500	貸付有価証券 1,000株
6569	日総工産	23,600	707.00	16,685,200	貸付有価証券 2,000株
6571	キュービーネットホールディングス	14,900	1,400.00	20,860,000	貸付有価証券 2,600株
6572	RPAホールディングス	42,600	430.00	18,318,000	貸付有価証券 2,900株
7030	スプリックス	7,000	882.00	6,174,000	貸付有価証券 2,000株
7033	マネジメントソリューションズ	17,300	3,180.00	55,014,000	貸付有価証券 2,100株
7034	プロレド・パートナーズ	7,700	450.00	3,465,000	貸付有価証券 900株
7035	and factory	5,900	363.00	2,141,700	貸付有価証券



					1,200株
7037	テノ・ホールディングス	2,500	812.00	2,030,000	貸付有価証券 800株
7038	フロンティア・マネジメント	10,500	989.00	10,384,500	貸付有価証券 1,700株
7044	ピアラ	3,300	592.00	1,953,600	貸付有価証券 1,000株
7059	コプロ・ホールディングス	4,000	1,435.00	5,740,000	貸付有価証券 800株
7060	ギークス	3,500	1,128.00	3,948,000	貸付有価証券 900株
7071	アンビスホールディングス	26,500	3,045.00	80,692,500	
7085	カーブスホールディングス	96,700	766.00	74,072,200	貸付有価証券 14,500株
7088	フォーラムエンジニアリング	18,300	901.00	16,488,300	貸付有価証券 2,200株
7092	Fast Fitness Japan	10,700	1,361.00	14,562,700	
7354	ダイレクトマーケティングミックス	37,600	1,367.00	51,399,200	貸付有価証券 5,700株
7358	ポピンズ	4,700	1,943.00	9,132,100	貸付有価証券 1,000株
7366	LITALICO	24,500	2,544.00	62,328,000	貸付有価証券 4,200株
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	10,300	435.00	4,480,500	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	175,100	2,046.00	358,254,600	
8920	東祥	21,900	1,140.00	24,966,000	貸付有価証券 3,700株
9216	ビーウィズ	5,900	1,720.00	10,148,000	貸付有価証券 1,300株
9247	TREホールディングス	66,200	1,405.00	93,011,000	貸付有価証券 1,600株
9248	人・夢・技術グループ	14,000	1,498.00	20,972,000	貸付有価証券 1,100株
9336	大栄環境	60,000	1,769.00	106,140,000	
9603	エイチ・アイ・エス	82,300	1,961.00	161,390,300	貸付有価証券 6,600株
9612	ラックランド	9,800	2,905.00	28,469,000	貸付有価証券 1,000株
9616	共立メンテナンス	53,900	5,280.00	284,592,000	貸付有価証券 4,100株
9619	イチネンホールディングス	33,300	1,245.00	41,458,500	貸付有価証券 5,500株
9621	建設技術研究所	16,200	3,110.00	50,382,000	貸付有価証券 2,600株
9622	スペース	22,800	896.00	20,428,800	貸付有価証券 2,800株

9628	燦ホールディングス	13,900	2,127.00	29,565,300	
9632	スバル興業	1,300	9,160.00	11,908,000	貸付有価証券 400株
9633	東京テアトル	7,500	1,150.00	8,625,000	貸付有価証券 2,400株
9644	タナベコンサルティンググループ	7,900	921.00	7,275,900	貸付有価証券 600株
9663	ナガワ	8,400	6,920.00	58,128,000	貸付有価証券 1,600株
9672	東京都競馬	26,300	3,515.00	92,444,500	貸付有価証券 2,700株
9675	常磐興産	7,100	1,269.00	9,009,900	貸付有価証券 2,000株
9678	カナモト	57,600	2,125.00	122,400,000	貸付有価証券 10,200株
9699	西尾レントオール	29,200	2,997.00	87,512,400	貸付有価証券 400株
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	112,700	23.00	2,592,100	貸付有価証券 39,500株
9715	トランス・コスモス	39,100	3,150.00	123,165,000	貸付有価証券 800株
9716	乃村工藝社	137,200	895.00	122,794,000	貸付有価証券 18,200株
9722	藤田観光	14,000	3,185.00	44,590,000	貸付有価証券 2,700株
9726	KNT-CTホールディングス	18,800	1,642.00	30,869,600	貸付有価証券 2,600株
9728	日本管財	33,000	2,584.00	85,272,000	
9729	トーカイ	27,800	1,945.00	54,071,000	貸付有価証券 4,500株
9731	白洋舎	1,900	1,765.00	3,353,500	貸付有価証券 600株
9735	セコム	320,400	8,175.00	2,619,270,000	
9740	セントラル警備保障	17,000	2,620.00	44,540,000	貸付有価証券 2,100株
9743	丹青社	61,000	781.00	47,641,000	貸付有価証券 8,000株
9744	メイテック	125,400	2,356.00	295,442,400	
9755	応用地質	29,400	2,189.00	64,356,600	貸付有価証券 5,400株
9757	船井総研ホールディングス	65,500	2,616.00	171,348,000	貸付有価証券 8,700株
9760	進学会ホールディングス	6,700	310.00	2,077,000	貸付有価証券 2,800株
9765	オオバ	12,800	754.00	9,651,200	貸付有価証券 3,500株
9768	いであ	4,500	1,571.00	7,069,500	貸付有価証券 800株

9769	学究社	12,600	1,977.00	24,910,200	
9783	ベネッセホールディングス	117,400	1,955.00	229,517,000	貸付有価証券 10,900株
9787	イオンディライト	34,800	2,963.00	103,112,400	貸付有価証券 5,600株
9788	ナック	13,900	971.00	13,496,900	貸付有価証券 1,400株
9793	ダイセキ	64,200	3,950.00	253,590,000	貸付有価証券 11,900株
9795	ステップ	12,900	1,855.00	23,929,500	
合 計		356,823,900		862,140,675,060	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[令和5年3月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	78,841,841,669
コール・ローン	2,114,726,472
株式	1,998,131,545,564
投資証券	43,461,613,113
派生商品評価勘定	1,723,342,463
未収入金	19,214,385
未収配当金	3,565,372,177
差入委託証拠金	12,446,325,573
流動資産合計	2,140,303,981,416
資産合計	2,140,303,981,416
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	211,895,860
未払金	1,289,522
未払解約金	3,351,963,477
未払利息	705
流動負債合計	3,565,149,564
負債合計	3,565,149,564

純資産の部	
元本等	
元本	470, 141, 826, 649
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	1, 666, 597, 005, 203
元本等合計	2, 136, 738, 831, 852
純資産合計	2, 136, 738, 831, 852
負債純資産合計	2, 140, 303, 981, 416

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)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 期首	令和 4 年 3 月 26 日
期首元本額	324, 060, 471, 685 円
期中追加設定元本額	237, 132, 327, 070 円
期中一部解約元本額	91, 050, 972, 106 円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)	218, 550, 389 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)	986, 561, 408 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	879, 817, 579 円
MAXIS 海外株式 (MSCI コクサイ) 上場投信	3, 011, 686, 133 円
MAXIS 全世界株式 (オール・カントリー) 上場投信	4, 056, 331, 501 円
三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	1, 696, 248, 385 円
三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	9, 746, 305, 259 円
三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	10, 371, 331, 760 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	53, 516, 421 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	140, 190, 157 円
ファンド・マネジャー (海外株式)	780, 920 円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13, 668, 903, 060 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	1, 133, 752, 326 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	198, 966, 878 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1, 773, 722, 629 円
コアバランス	168, 337 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	229, 820, 360 円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	268,950,118円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	244,195,377円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス 海外株式セレクション (ラップ向け)	87,159,569,335円 2,343,631,442円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	4,819,813,401円
つみたて先進国株式	22,912,804,136円
つみたて8資産均等バランス	2,256,885,866円
つみたて4資産均等バランス	769,430,517円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,964,010円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,337,185円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,104,315円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	192,083,978円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	203,566,748円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	131,410,943円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	57,689,709円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	449,447,224円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,034,507,306円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	41,367,274,078円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	478,699,009円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	3,391,671,777円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	166,195,500,809円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	114,669,103円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	39,766,944円
つみたて全世界株式	195,908,698円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	45,096,184円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,261,685,283円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	15,868,136円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3,870,644,863円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	31,234,650円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	29,260,726,314円
eMAXIS 全世界株式インデックス	4,570,659,253円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	329,492,424円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	605,167,785円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	103,215,487円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	322,329,616円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	236,229,951円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	330,065,950円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	92,937,105円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	116,083,390円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	471,959,689円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	368,036,088円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	694,052,143円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,599,510,166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)	14,309円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	6,156,969円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,197,394,462円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限	49,088,413円

定)	
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	812,311,873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)	10,666,790,350円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	593,394円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	647,330,887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)	5,316,722,321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)	64,872,362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)	913,454,058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)	291,150,889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)	375,225,753円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	53,595,063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)	297,011,182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)	81,473,331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)	2,330,248,094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)	373,741,168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)	24,758,141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)	120,434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)	2,488,333,173円
海外株式インデックスファンドS	2,179,672,961円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,698,767,296円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	848,879円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,423,188円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	805,741円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	2,109,510円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	25,633,573円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	1,177,510円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	9,794,537円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,661,777円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	15,497,746円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,680,656,582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)	102,655,750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)	416,302,576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)	440,196,370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)	434,497,419円
合計	470,141,826,649円
2. 受益権の総数	470,141,826,649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 令和 4 年 3 月 26 日 至 令和 5 年 3 月 27 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 5 年 3 月 27 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	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	37,789,669,565
投資証券	△6,386,758,435
合計	31,402,911,130

(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

[令和 5 年 3 月 27 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	97,723,323,450	—	99,234,154,567	1,510,831,117
合計		97,723,323,450	—	99,234,154,567	1,510,831,117

(注) 時価の算定方法

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

### 通貨関連

[令和 5 年 3 月 27 日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	3,331,348,327	—	3,331,223,353	△124,974
	カナダドル	161,734,430	—	161,729,160	△5,270
	オーストラリアドル	115,409,021	—	115,404,100	△4,921
	イギリスポンド	116,206,442	—	116,202,734	△3,708
	スイスフラン	145,523,200	—	145,519,616	△3,584
	香港ドル	53,657,550	—	53,653,680	△3,870
	シンガポールドル	25,007,340	—	25,006,702	△638
	デンマーククローネ	48,515,689	—	48,513,376	△2,313
	ユーロ	473,846,481	—	473,830,309	△16,172
	売建				
	アメリカドル	1,014,329,904	—	1,014,736,170	△406,266
	カナダドル	37,125,309	—	37,107,486	17,823
	オーストラリアドル	33,320,332	—	33,149,960	170,372
	イギリスポンド	38,813,170	—	38,685,974	127,196
	スイスフラン	27,505,626	—	27,428,098	77,528
スウェーデンクローネ	11,382,783	—	11,288,629	94,154	
ユーロ	123,353,120	—	122,652,991	700,129	
合計		5,757,078,724	—	5,756,132,338	615,486

(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）

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1口当たり純資産額	4,544.9 円
(1万口当たり純資産額)	(45,449 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	101,800	34.51	3,513,118.00	
	BAKER HUGHES CO	326,748	27.02	8,828,730.96	
	CHENIERE ENERGY INC	72,712	147.33	10,712,658.96	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	37,475	74.30	2,784,392.50	
	CHEVRON CORP	594,539	156.06	92,783,756.34	
	CONOCOPHILLIPS	403,299	95.43	38,486,823.57	
	COTERRA ENERGY INC	253,523	23.68	6,003,424.64	
	DEVON ENERGY CORP	202,654	46.57	9,437,596.78	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	52,814	125.42	6,623,931.88	
	EOG RESOURCES INC	190,298	105.49	20,074,536.02	
	EQT CORP	101,061	30.56	3,088,424.16	
	EXXON MOBIL CORP	1,333,062	103.53	138,011,908.86	
	HALLIBURTON CO	297,827	29.60	8,815,679.20	
	HESS CORP	90,247	122.49	11,054,355.03	
	HF SINCLAIR CORP	47,286	47.60	2,250,813.60	
	KINDER MORGAN INC	660,448	16.79	11,088,921.92	

MARATHON OIL CORP	217,347	22.16	4,816,409.52
MARATHON PETROLEUM CORP	151,611	124.70	18,905,891.70
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	235,756	58.18	13,716,284.08
ONEOK INC	144,854	59.48	8,615,915.92
OVINTIV INC	82,940	33.98	2,818,301.20
PHILLIPS 66	153,105	93.73	14,350,531.65
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	73,169	192.22	14,064,545.18
SCHLUMBERGER LTD	460,208	44.57	20,511,470.56
TARGA RESOURCES CORP	68,999	67.52	4,658,812.48
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,863	1,651.33	3,076,427.79
VALERO ENERGY CORP	125,041	129.26	16,162,799.66
WILLIAMS COS INC	395,001	28.74	11,352,328.74
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	71,795	267.67	19,217,367.65
ALBEMARLE CORP	38,000	217.79	8,276,020.00
ALCOA CORP	53,760	40.08	2,154,700.80
AMCOR PLC	478,670	10.93	5,231,863.10
AVERY DENNISON CORP	24,955	169.74	4,235,861.70
BALL CORP	101,553	52.97	5,379,262.41
CELANESE CORP	35,523	101.58	3,608,426.34
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	62,407	69.30	4,324,805.10
CLEVELAND-CLIFFS INC	171,019	17.43	2,980,861.17
CORTEVA INC	233,041	56.84	13,246,050.44
CROWN HOLDINGS INC	37,452	77.05	2,885,676.60
DOW INC	227,708	51.78	11,790,720.24
DUPONT DE NEMOURS INC	161,112	68.60	11,052,283.20
EASTMAN CHEMICAL CO	40,284	79.58	3,205,800.72
ECOLAB INC	83,151	160.36	13,334,094.36
FMC CORP	39,430	117.69	4,640,516.70
FREEMONT-MCMORAN INC	463,713	38.01	17,625,731.13
INTERNATIONAL PAPER CO	111,608	34.48	3,848,243.84
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	83,518	84.27	7,038,061.86
LINDE PLC	159,708	344.75	55,059,333.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	84,474	86.57	7,312,914.18
MARTIN MARIETTA MATERIALS	20,257	336.83	6,823,165.31
MOSAIC CO/THE	113,000	42.39	4,790,070.00
NEWMONT CORP	259,377	48.55	12,592,753.35

NUCOR CORP	82,264	148.65	12,228,543.60
PACKAGING CORP OF AMERICA	30,858	133.15	4,108,742.70
PPG INDUSTRIES INC	76,192	125.44	9,557,524.48
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	19,300	252.17	4,866,881.00
RPM INTERNATIONAL INC	39,891	83.34	3,324,515.94
SEALED AIR CORP	49,467	42.80	2,117,187.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	79,869	211.28	16,874,722.32
STEEL DYNAMICS INC	56,193	108.39	6,090,759.27
VULCAN MATERIALS CO	43,284	166.20	7,193,800.80
WESTLAKE CORP	13,051	108.69	1,418,513.19
WESTROCK CO	81,719	28.61	2,337,980.59
3M CO	179,617	101.14	18,166,463.38
AECOM	43,500	81.18	3,531,330.00
AERCAP HOLDINGS NV	45,293	50.32	2,279,143.76
ALLEGION PLC	26,361	100.60	2,651,916.60
AMETEK INC	74,643	139.32	10,399,262.76
AXON ENTERPRISE INC	22,200	216.58	4,808,076.00
BOEING CO/THE	183,558	197.53	36,258,211.74
CARLISLE COS INC	16,689	212.05	3,538,902.45
CARRIER GLOBAL CORP	271,943	43.92	11,943,736.56
CATERPILLAR INC	168,486	217.01	36,563,146.86
CUMMINS INC	45,970	223.90	10,292,683.00
DEERE & CO	92,894	386.50	35,903,531.00
DOVER CORP	45,752	141.44	6,471,162.88
EATON CORP PLC	128,758	163.64	21,069,959.12
EMERSON ELECTRIC CO	192,005	82.89	15,915,294.45
FASTENAL CO	187,013	52.30	9,780,779.90
FERGUSON PLC	67,631	129.47	8,756,185.57
FORTIVE CORP	105,645	65.26	6,894,392.70
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	38,725	57.03	2,208,486.75
GENERAC HOLDINGS INC	21,013	111.22	2,337,065.86
GENERAL DYNAMICS CORP	75,697	223.50	16,918,279.50
GENERAL ELECTRIC CO	354,169	91.37	32,360,421.53
GRACO INC	56,100	69.05	3,873,705.00
HEICO CORP	15,479	165.75	2,565,644.25
HEICO CORP-CLASS A	22,744	131.89	2,999,706.16

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	217,569	188.16	40,937,783.04
HOWMET AEROSPACE INC	121,799	40.25	4,902,409.75
HUBBELL INC	17,543	230.28	4,039,802.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	13,307	200.03	2,661,799.21
IDEX CORP	24,460	219.44	5,367,502.40
ILLINOIS TOOL WORKS	99,416	231.62	23,026,733.92
INGERSOLL-RAND INC	128,498	55.03	7,071,244.94
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	52,400	47.66	2,497,384.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	222,535	58.23	12,958,213.05
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	62,154	193.13	12,003,802.02
LENNOX INTERNATIONAL INC	9,451	244.15	2,307,461.65
LOCKHEED MARTIN CORP	76,382	474.54	36,246,314.28
MASCO CORP	73,970	48.06	3,554,998.20
NORDSON CORP	16,618	209.95	3,488,949.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	47,436	455.25	21,595,239.00
OTIS WORLDWIDE CORP	135,296	80.50	10,891,328.00
OWENS CORNING	29,948	91.82	2,749,825.36
PACCAR INC	169,908	69.90	11,876,569.20
PARKER HANNIFIN CORP	41,691	320.87	13,377,391.17
PENTAIR PLC	53,508	51.78	2,770,644.24
PLUG POWER INC	170,755	11.23	1,917,578.65
QUANTA SERVICES INC	45,857	160.78	7,372,888.46
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	476,249	96.44	45,929,453.56
ROCKWELL AUTOMATION INC	37,479	277.60	10,404,170.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	47,364	46.83	2,218,056.12
SMITH (A. O.) CORP	41,076	66.74	2,741,412.24
SNAP-ON INC	16,363	234.39	3,835,323.57
STANLEY BLACK & DECKER INC	49,255	74.25	3,657,183.75
TEXTRON INC	68,142	67.74	4,615,939.08
TORO CO	34,600	107.73	3,727,458.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	74,714	182.07	13,603,177.98
TRANSDIGM GROUP INC	16,803	703.89	11,827,463.67
UNITED RENTALS INC	22,028	370.78	8,167,541.84
WABTEC CORP	56,644	95.50	5,409,502.00
WW GRAINGER INC	14,794	663.60	9,817,298.40
XYLEM INC	59,030	98.59	5,819,767.70

AUTOMATIC DATA PROCESSING	134,464	214.13	28,792,776.32
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	40,983	90.89	3,724,944.87
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	38,932	140.60	5,473,839.20
CINTAS CORP	29,745	436.35	12,979,230.75
CLARIVATE PLC	115,796	9.26	1,072,270.96
COPART INC	136,293	71.43	9,735,408.99
COSTAR GROUP INC	132,594	67.14	8,902,361.16
EQUIFAX INC	39,313	197.58	7,767,462.54
JACOBS SOLUTIONS INC	40,785	112.34	4,581,786.90
LEIDOS HOLDINGS INC	42,946	91.38	3,924,405.48
PAYCHEX INC	105,457	108.84	11,477,939.88
REPUBLIC SERVICES INC	72,206	130.92	9,453,209.52
ROBERT HALF INTL INC	31,924	74.70	2,384,722.80
ROLLINS INC	65,665	36.62	2,404,652.30
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	71,344	53.92	3,846,868.48
TRANSUNION	63,235	58.71	3,712,526.85
VERISK ANALYTICS INC	51,167	186.69	9,552,367.23
WASTE CONNECTIONS INC	83,924	133.62	11,213,924.88
WASTE MANAGEMENT INC	133,207	154.46	20,575,153.22
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	40,475	95.48	3,864,553.00
CSX CORP	681,562	28.25	19,254,126.50
DELTA AIR LINES INC	53,589	31.59	1,692,876.51
EXPEDITORS INTL WASH INC	51,822	104.49	5,414,880.78
FEDEX CORP	80,215	217.60	17,454,784.00
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	367,326	2.68	984,433.68
HUNT (JB) TRANSPORT SVCS INC	25,635	166.10	4,257,973.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	49,106	55.41	2,720,963.46
NORFOLK SOUTHERN CORP	75,130	200.26	15,045,533.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	30,505	329.50	10,051,397.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	50,383	29.63	1,492,848.29
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	27,432	48.65	1,334,566.80
UBER TECHNOLOGIES INC	485,913	30.75	14,941,824.75
UNION PACIFIC CORP	199,099	188.51	37,532,152.49
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	236,284	186.07	43,965,363.88
APTIV PLC	88,527	107.18	9,488,323.86
BORGWARNER INC	78,768	47.38	3,732,027.84

FORD MOTOR CO	1, 282, 767	11. 51	14, 764, 648. 17
GENERAL MOTORS CO	461, 156	33. 71	15, 545, 568. 76
LEAR CORP	20, 206	137. 97	2, 787, 821. 82
LUCID GROUP INC	108, 300	8. 19	886, 977. 00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	108, 400	13. 62	1, 476, 408. 00
TESLA INC	869, 393	190. 41	165, 541, 121. 13
DR HORTON INC	104, 075	96. 93	10, 087, 989. 75
GARMIN LTD	48, 921	95. 92	4, 692, 502. 32
HASBRO INC	42, 578	49. 04	2, 088, 025. 12
LENNAR CORP-A	83, 896	103. 74	8, 703, 371. 04
LULULEMON ATHLETICA INC	37, 775	313. 45	11, 840, 573. 75
MOHAWK INDUSTRIES INC	16, 546	95. 40	1, 578, 488. 40
NEWELL BRANDS INC	130, 633	11. 63	1, 519, 261. 79
NIKE INC -CL B	408, 425	120. 71	49, 300, 981. 75
NVR INC	962	5, 413. 00	5, 207, 306. 00
PULTEGROUP INC	76, 342	56. 66	4, 325, 537. 72
VF CORP	98, 705	20. 29	2, 002, 724. 45
WHIRLPOOL CORP	16, 596	127. 17	2, 110, 513. 32
AIRBNB INC-CLASS A	123, 189	116. 92	14, 403, 257. 88
ARAMARK	72, 988	34. 24	2, 499, 109. 12
BOOKING HOLDINGS INC	12, 603	2, 499. 33	31, 499, 055. 99
CAESARS ENTERTAINMENT INC	67, 558	42. 40	2, 864, 459. 20
CARNIVAL CORP	322, 950	9. 23	2, 980, 828. 50
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	9, 043	1, 624. 25	14, 688, 092. 75
DARDEN RESTAURANTS INC	38, 486	152. 58	5, 872, 193. 88
DOMINO' S PIZZA INC	10, 935	311. 51	3, 406, 361. 85
DOORDASH INC - A	77, 241	60. 67	4, 686, 211. 47
EXPEDIA GROUP INC	48, 175	90. 54	4, 361, 764. 50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	89, 089	131. 83	11, 744, 602. 87
LAS VEGAS SANDS CORP	109, 170	54. 35	5, 933, 389. 50
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	86, 490	156. 56	13, 540, 874. 40
MCDONALD' S CORP	237, 392	271. 33	64, 411, 571. 36
MGM RESORTS INTERNATIONAL	104, 054	41. 11	4, 277, 659. 94
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	71, 580	60. 85	4, 355, 643. 00
STARBUCKS CORP	372, 530	98. 34	36, 634, 600. 20
VAIL RESORTS INC	12, 637	219. 49	2, 773, 695. 13

WYNN RESORTS LTD	33,881	106.58	3,611,036.98
YUM! BRANDS INC	90,052	127.83	11,511,347.16
ACTIVISION BLIZZARD INC	253,748	84.39	21,413,793.72
ALPHABET INC-CL A	1,934,910	105.44	204,016,910.40
ALPHABET INC-CL C	1,772,934	106.06	188,037,380.04
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	35,151	343.95	12,090,186.45
COMCAST CORP-CLASS A	1,398,997	35.92	50,251,972.24
DISH NETWORK CORP-A	84,434	8.75	738,797.50
ELECTRONIC ARTS INC	88,747	119.03	10,563,555.41
FOX CORP - CLASS A	94,197	33.06	3,114,152.82
FOX CORP - CLASS B	50,847	30.38	1,544,731.86
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	128,763	35.04	4,511,855.52
LIBERTY BROADBAND-C	37,365	78.74	2,942,120.10
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	22,942	25.89	593,968.38
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	50,965	25.75	1,312,348.75
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	65,129	73.38	4,779,166.02
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	57,466	65.95	3,789,882.70
MATCH GROUP INC	89,286	40.20	3,589,297.20
META PLATFORMS INC-CLASS A	728,386	206.01	150,054,799.86
NETFLIX INC	144,228	328.39	47,363,032.92
NEWS CORP - CLASS A	130,626	16.22	2,118,753.72
OMNICOM GROUP	63,760	87.63	5,587,288.80
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	194,365	20.23	3,932,003.95
PINTEREST INC- CLASS A	179,393	27.47	4,927,925.71
ROBLOX CORP -CLASS A	116,296	43.43	5,050,735.28
ROKU INC	38,981	60.00	2,338,860.00
SEA LTD-ADR	118,949	82.38	9,799,018.62
SIRIUS XM HOLDINGS INC	234,669	3.77	884,702.13
SNAP INC - A	350,310	11.56	4,049,583.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	54,831	118.12	6,476,637.72
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	143,640	60.45	8,683,038.00
WALT DISNEY CO/THE	591,135	94.08	55,613,980.80
WARNER BROS DISCOVERY INC	752,602	14.00	10,536,428.00
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	90,161	23.18	2,089,931.98
ADVANCE AUTO PARTS INC	19,129	110.83	2,120,067.07
AMAZON.COM INC	2,973,164	98.13	291,756,583.32

AUTOZONE INC	6,092	2,329.40	14,190,704.80
BATH & BODY WORKS INC	70,761	35.61	2,519,799.21
BEST BUY CO INC	63,663	74.32	4,731,434.16
BURLINGTON STORES INC	21,172	200.68	4,248,796.96
CARMAX INC	49,982	57.78	2,887,959.96
CHEWY INC - CLASS A	31,027	33.59	1,042,196.93
EBAY INC	171,616	42.66	7,321,138.56
ETSY INC	41,138	106.85	4,395,595.30
GENUINE PARTS CO	45,108	156.88	7,076,543.04
HOME DEPOT INC	330,289	283.02	93,478,392.78
LKQ CORP	80,873	53.80	4,350,967.40
LOWE'S COS INC	196,148	189.46	37,162,200.08
MERCADOLIBRE INC	14,683	1,187.28	17,432,832.24
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	20,383	810.76	16,525,721.08
POOL CORP	12,964	325.23	4,216,281.72
ROSS STORES INC	113,391	101.33	11,489,910.03
TJX COMPANIES INC	377,070	74.87	28,231,230.90
TRACTOR SUPPLY COMPANY	36,289	227.21	8,245,223.69
ULTA BEAUTY INC	16,778	513.98	8,623,556.44
COSTCO WHOLESALE CORP	143,283	495.27	70,963,771.41
DOLLAR GENERAL CORP	73,487	205.81	15,124,359.47
DOLLAR TREE INC	72,178	137.39	9,916,535.42
KROGER CO	221,268	49.05	10,853,195.40
SYSCO CORP	164,736	74.64	12,295,895.04
TARGET CORP	149,582	156.22	23,367,700.04
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	240,534	32.70	7,865,461.80
WALMART INC	483,311	141.80	68,533,499.80
ALTRIA GROUP INC	581,178	43.97	25,554,396.66
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	175,317	76.61	13,431,035.37
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	96,533	62.95	6,076,752.35
BUNGE LTD	49,109	93.93	4,612,808.37
CAMPBELL SOUP CO	67,404	54.54	3,676,214.16
COCA-COLA CO/THE	1,329,484	60.90	80,965,575.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	66,711	56.78	3,787,850.58
CONAGRA BRANDS INC	158,908	37.21	5,912,966.68
CONSTELLATION BRANDS INC-A	54,010	217.95	11,771,479.50



DARLING INGREDIENTS INC	52,560	54.39	2,858,738.40
GENERAL MILLS INC	193,207	84.80	16,383,953.60
HERSHEY CO/THE	47,900	247.86	11,872,494.00
HORMEL FOODS CORP	91,879	38.65	3,551,123.35
JM SMUCKER CO/THE	34,139	154.69	5,280,961.91
KELLOGG CO	84,861	65.47	5,555,849.67
KEURIG DR PEPPER INC	254,579	34.87	8,877,169.73
KRAFT HEINZ CO/THE	239,505	38.18	9,144,300.90
LAMB WESTON HOLDINGS INC	46,449	100.19	4,653,725.31
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	78,366	72.87	5,710,530.42
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	62,806	50.70	3,184,264.20
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	441,886	69.04	30,507,809.44
MONSTER BEVERAGE CORP	127,155	104.08	13,234,292.40
PEPSICO INC	445,775	179.09	79,833,844.75
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	501,906	90.75	45,547,969.50
TYSON FOODS INC-CL A	90,533	57.06	5,165,812.98
CHURCH & DWIGHT CO INC	76,721	85.98	6,596,471.58
CLOROX COMPANY	40,580	157.50	6,391,350.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	257,745	73.42	18,923,637.90
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	75,034	241.69	18,134,967.46
KIMBERLY-CLARK CORP	109,992	130.48	14,351,756.16
PROCTER & GAMBLE CO/THE	767,040	146.72	112,540,108.80
ABBOTT LABORATORIES	564,545	98.05	55,353,637.25
ALIGN TECHNOLOGY INC	23,814	306.70	7,303,753.80
AMERISOURCEBERGEN CORP	50,568	156.41	7,909,340.88
BAXTER INTERNATIONAL INC	161,736	39.23	6,344,903.28
BECTON DICKINSON AND CO	91,994	240.50	22,124,557.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	464,979	48.22	22,421,287.38
CARDINAL HEALTH INC	82,871	70.37	5,831,632.27
CENTENE CORP	184,030	64.05	11,787,121.50
COOPER COS INC/THE	15,553	355.02	5,521,626.06
CVS HEALTH CORP	425,318	73.26	31,158,796.68
DAVITA INC	16,659	76.12	1,268,083.08
DENTSPLY SIRONA INC	64,432	37.25	2,400,092.00
DEXCOM INC	125,644	114.09	14,334,723.96
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	202,080	80.76	16,319,980.80

ELEVANCE HEALTH INC	77,351	456.69	35,325,428.19
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	117,163	76.46	8,958,282.98
HCA HEALTHCARE INC	68,720	254.22	17,469,998.40
HENRY SCHEIN INC	41,137	79.17	3,256,816.29
HOLOGIC INC	78,244	79.20	6,196,924.80
HUMANA INC	41,060	502.43	20,629,775.80
IDEXX LABORATORIES INC	26,962	485.51	13,090,320.62
INSULET CORP	22,107	310.17	6,856,928.19
INTUITIVE SURGICAL INC	114,724	256.42	29,417,528.08
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	29,015	218.41	6,337,166.15
MASIMO CORP	16,542	172.88	2,859,780.96
MCKESSON CORP	46,017	346.56	15,947,651.52
MEDTRONIC PLC	431,310	79.37	34,233,074.70
MOLINA HEALTHCARE INC	19,200	267.72	5,140,224.00
NOVOCURE LTD	30,832	57.17	1,762,665.44
QUEST DIAGNOSTICS INC	37,107	140.06	5,197,206.42
RESMED INC	46,772	212.58	9,942,791.76
STERIS PLC	31,354	185.20	5,806,760.80
STRYKER CORP	110,569	276.69	30,593,336.61
TELEFLEX INC	15,114	248.93	3,762,328.02
THE CIGNA GROUP	99,129	260.21	25,794,357.09
UNITEDHEALTH GROUP INC	302,441	475.99	143,958,891.59
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20,248	122.63	2,483,012.24
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	44,426	175.58	7,800,317.08
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	68,708	126.04	8,659,956.32
ABBVIE INC	572,844	158.02	90,520,808.88
AGILENT TECHNOLOGIES INC	95,747	131.96	12,634,774.12
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	40,264	189.98	7,649,354.72
AMGEN INC	172,905	238.03	41,156,577.15
AVANTOR INC	217,209	20.89	4,537,496.01
BIO-RAD LABORATORIES-A	6,947	460.78	3,201,038.66
BIO-TECHNE CORP	47,945	72.54	3,477,930.30
BIOGEN INC	46,918	270.03	12,669,267.54
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58,061	90.74	5,268,455.14
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	688,468	67.68	46,595,514.24
CATALENT INC	56,121	64.27	3,606,896.67

CHARLES RIVER LABORATORIES	15,602	193.79	3,023,511.58
DANAHER CORP	223,867	248.17	55,557,073.39
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	148,648	8.82	1,311,075.36
ELI LILLY & CO	261,567	336.13	87,920,515.71
EXACT SCIENCES CORP	56,656	66.28	3,755,159.68
GILEAD SCIENCES INC	406,804	80.00	32,544,320.00
HORIZON THERAPEUTICS PLC	69,187	108.52	7,508,173.24
ILLUMINA INC	51,252	220.00	11,275,440.00
INCYTE CORP	59,677	70.23	4,191,115.71
IQVIA HOLDINGS INC	60,385	188.35	11,373,514.75
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	20,987	141.28	2,965,043.36
JOHNSON & JOHNSON	846,325	152.65	129,191,511.25
MERCK & CO. INC.	821,032	104.80	86,044,153.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	7,222	1,459.75	10,542,314.50
MODERNA INC	106,059	150.88	16,002,181.92
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	31,737	97.05	3,080,075.85
PERKINELMER INC	41,516	127.58	5,296,611.28
PFIZER INC	1,817,439	40.39	73,406,361.21
REGENERON PHARMACEUTICALS	34,713	820.00	28,464,660.00
REPLIGEN CORP	17,444	160.25	2,795,401.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	111,881	35.43	3,963,943.83
SEAGEN INC	45,605	197.64	9,013,372.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	360,337	8.44	3,041,244.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	126,959	558.26	70,876,131.34
UNITED THERAPEUTICS CORP	15,000	219.94	3,299,100.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	83,332	314.39	26,198,747.48
VIATRIS INC	379,530	9.33	3,541,014.90
WATERS CORP	19,356	299.96	5,806,025.76
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	23,847	334.30	7,972,052.10
ZOETIS INC	151,126	164.18	24,811,866.68
BANK OF AMERICA CORP	2,337,221	27.14	63,432,177.94
CITIGROUP INC	627,048	43.11	27,032,039.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	155,051	31.10	4,822,086.10
FIFTH THIRD BANCORP	218,270	25.48	5,561,519.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	3,794	582.55	2,210,194.70
FIRST HORIZON CORP	173,558	16.76	2,908,832.08

FIRST REPUBLIC BANK/CA	59,659	12.36	737,385.24
HUNTINGTON BANCSHARES INC	461,466	10.78	4,974,603.48
JPMORGAN CHASE & CO	949,611	124.91	118,615,910.01
KEYCORP	306,076	11.86	3,630,061.36
M & T BANK CORP	56,084	114.93	6,445,734.12
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	130,587	124.15	16,212,376.05
REGIONS FINANCIAL CORP	304,015	17.88	5,435,788.20
SIGNATURE BANK	19,656	—	—
SVB FINANCIAL GROUP	19,371	—	—
TRUIST FINANCIAL CORP	430,205	32.89	14,149,442.45
US BANCORP	457,762	34.90	15,975,893.80
WEBSTER FINANCIAL CORP	57,805	38.62	2,232,429.10
WELLS FARGO & CO	1,233,351	36.23	44,684,306.73
ALLY FINANCIAL INC	92,854	24.22	2,248,923.88
AMERICAN EXPRESS CO	205,541	159.78	32,841,340.98
AMERIPRISE FINANCIAL INC	34,711	291.44	10,116,173.84
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	147,838	18.93	2,798,573.34
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	130,743	57.54	7,522,952.22
ARES MANAGEMENT CORP - A	51,159	80.40	4,113,183.60
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	249,312	42.75	10,658,088.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	421,197	298.92	125,904,207.24
BLACKROCK INC	48,658	644.88	31,378,571.04
BLACKSTONE INC	227,744	83.94	19,116,831.36
BLOCK INC	175,369	60.68	10,641,390.92
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	123,937	90.45	11,210,101.65
CARLYLE GROUP INC/THE	60,998	30.42	1,855,559.16
CBOE GLOBAL MARKETS INC	35,152	129.28	4,544,450.56
CME GROUP INC	116,828	183.55	21,443,779.40
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	41,300	67.83	2,801,379.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	88,635	92.85	8,229,759.75
EQUITABLE HOLDINGS INC	115,779	23.58	2,730,068.82
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12,356	398.86	4,928,314.16
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	190,030	49.70	9,444,491.00
FISERV INC	195,855	112.52	22,037,604.60
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23,091	200.82	4,637,134.62
FRANKLIN RESOURCES INC	95,796	26.29	2,518,476.84

FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	49.28	985,600.00
GLOBAL PAYMENTS INC	86,971	98.43	8,560,555.53
GOLDMAN SACHS GROUP INC	109,537	312.57	34,237,980.09
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	181,337	97.49	17,678,544.13
INVESCO LTD	115,882	15.05	1,744,024.10
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	24,225	147.24	3,566,889.00
KKR & CO INC	182,123	50.05	9,115,256.15
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	26,019	192.00	4,995,648.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12,374	385.99	4,776,240.26
MASTERCARD INC - A	277,866	351.63	97,706,021.58
MOODY'S CORP	53,595	292.73	15,688,864.35
MORGAN STANLEY	410,276	83.95	34,442,670.20
MSCI INC	26,018	543.10	14,130,375.80
NASDAQ INC	108,285	53.07	5,746,684.95
NORTHERN TRUST CORP	62,611	83.43	5,223,635.73
PAYPAL HOLDINGS INC	351,209	73.88	25,947,320.92
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	60,787	89.09	5,415,513.83
S&P GLOBAL INC	108,007	334.52	36,130,501.64
SCHWAB (CHARLES) CORP	470,729	53.26	25,071,026.54
SEI INVESTMENTS COMPANY	39,270	54.80	2,151,996.00
STATE STREET CORP	119,401	71.65	8,555,081.65
SYNCHRONY FINANCIAL	154,684	28.04	4,337,339.36
T ROWE PRICE GROUP INC	73,466	109.65	8,055,546.90
TOAST INC-CLASS A	71,887	16.23	1,166,726.01
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	37,148	74.47	2,766,411.56
VISA INC-CLASS A SHARES	527,058	221.04	116,500,900.32
AFLAC INC	192,670	62.88	12,115,089.60
ALLSTATE CORP	84,624	105.59	8,935,448.16
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	23,305	118.02	2,750,456.10
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	237,263	47.34	11,232,030.42
AON PLC-CLASS A	66,955	309.16	20,699,807.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	120,843	66.05	7,981,680.15
ARTHUR J GALLAGHER & CO	68,509	185.66	12,719,380.94
ASSURANT INC	18,269	112.77	2,060,195.13
BROWN & BROWN INC	74,733	55.36	4,137,218.88
CHUBB LTD	134,163	186.55	25,028,107.65

CINCINNATI FINANCIAL CORP	47,190	106.60	5,030,454.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	7,461	224.19	1,672,681.59
EVEREST RE GROUP LTD	12,726	344.83	4,388,306.58
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86,645	33.32	2,887,011.40
GLOBE LIFE INC	30,200	106.69	3,222,038.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	103,653	66.12	6,853,536.36
LOEWS CORP	65,826	54.56	3,591,466.56
MARKEL CORP	4,198	1,215.92	5,104,432.16
MARSH & MCLENNAN COS	160,496	160.53	25,764,422.88
METLIFE INC	215,749	54.35	11,725,958.15
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	76,063	71.59	5,445,350.17
PROGRESSIVE CORP	189,581	140.43	26,622,859.83
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	117,748	77.58	9,134,889.84
TRAVELERS COS INC/THE	75,970	164.91	12,528,212.70
WILLIS TOWERS WATSON PLC	35,060	226.22	7,931,273.20
WR BERKLEY CORP	70,051	60.03	4,205,161.53
ACCENTURE PLC-CL A	203,947	272.00	55,473,584.00
ADOBE INC	150,571	374.96	56,458,102.16
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	48,096	76.05	3,657,700.80
ANSYS INC	27,667	315.70	8,734,471.90
ASPEN TECHNOLOGY INC	8,440	199.75	1,685,890.00
ATLASSIAN CORP-CL A	48,700	152.72	7,437,464.00
AUTODESK INC	70,144	200.22	14,044,231.68
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	61,932	41.43	2,565,842.76
BILL HOLDINGS INC	28,947	69.24	2,004,290.28
BLACK KNIGHT INC	51,474	54.58	2,809,450.92
CADENCE DESIGN SYS INC	89,054	204.48	18,209,761.92
CERIDIAN HCM HOLDING INC	46,280	68.51	3,170,642.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	33,201	128.40	4,263,008.40
CLOUDFLARE INC - CLASS A	84,516	56.64	4,786,986.24
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	167,716	58.65	9,836,543.40
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	65,057	131.54	8,557,597.78
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	14,727	143.82	2,118,037.14
DATADOG INC - CLASS A	78,741	65.24	5,137,062.84
DOCUSIGN INC	61,926	56.62	3,506,250.12
DROPBOX INC-CLASS A	81,861	21.16	1,732,178.76

DYNATRACE INC	71,672	39.13	2,804,525.36
EPAM SYSTEMS INC	18,298	278.50	5,095,993.00
FAIR ISAAC CORP	8,140	690.94	5,624,251.60
FORTINET INC	215,681	62.99	13,585,746.19
GARTNER INC	25,127	312.11	7,842,387.97
GEN DIGITAL INC	182,160	16.40	2,987,424.00
GODADDY INC - CLASS A	50,548	74.40	3,760,771.20
HUBSPOT INC	14,849	395.77	5,876,788.73
INTL BUSINESS MACHINES CORP	292,961	125.29	36,705,083.69
INTUIT INC	86,494	429.57	37,155,227.58
MICROSOFT CORP	2,292,902	280.57	643,319,514.14
MONGODB INC	22,594	216.79	4,898,153.26
OKTA INC	47,660	82.25	3,920,035.00
ORACLE CORP	523,677	88.01	46,088,812.77
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	525,499	8.20	4,309,091.80
PALO ALTO NETWORKS INC	98,113	191.55	18,793,545.15
PAYCOM SOFTWARE INC	16,897	271.56	4,588,549.32
PAYLOCITY HOLDING CORP	13,942	182.25	2,540,929.50
PTC INC	36,419	121.70	4,432,192.30
ROPER TECHNOLOGIES INC	34,428	429.59	14,789,924.52
SALESFORCE INC	324,112	190.06	61,600,726.72
SERVICENOW INC	65,690	432.90	28,437,201.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	73,134	136.53	9,984,985.02
SPLUNK INC	53,603	90.58	4,855,359.74
SYNOPSYS INC	49,568	376.56	18,665,326.08
TWILIO INC - A	58,401	61.48	3,590,493.48
TYLER TECHNOLOGIES INC	13,376	329.48	4,407,124.48
UNITY SOFTWARE INC	81,932	28.72	2,353,087.04
VERISIGN INC	30,362	201.88	6,129,480.56
VMWARE INC-CLASS A	68,952	122.28	8,431,450.56
WIX.COM LTD	16,678	94.67	1,578,906.26
WORKDAY INC-CLASS A	65,583	190.43	12,488,970.69
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	69,126	69.04	4,772,459.04
ZSCALER INC	28,648	111.93	3,206,570.64
AMPHENOL CORP-CL A	193,946	78.61	15,246,095.06
APPLE INC	5,150,500	160.25	825,367,625.00

ARISTA NETWORKS INC	79,516	168.94	13,433,433.04
ARROW ELECTRONICS INC	18,289	118.05	2,159,016.45
CDW CORP/DE	44,379	191.71	8,507,898.09
CISCO SYSTEMS INC	1,329,865	50.51	67,171,481.15
COGNEX CORP	56,700	48.00	2,721,600.00
CORNING INC	254,100	32.85	8,347,185.00
DELL TECHNOLOGIES -C	82,035	37.38	3,066,468.30
F5 INC	20,124	141.12	2,839,898.88
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	420,634	14.23	5,985,621.82
HP INC	324,391	27.72	8,992,118.52
JUNIPER NETWORKS INC	105,432	32.68	3,445,517.76
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	56,675	156.70	8,880,972.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC	54,260	271.68	14,741,356.80
NETAPP INC	71,581	61.06	4,370,735.86
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	62,439	61.64	3,848,739.96
TE CONNECTIVITY LTD	103,366	124.68	12,887,672.88
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	15,065	424.96	6,402,022.40
TRIMBLE INC	81,451	49.44	4,026,937.44
WESTERN DIGITAL CORP	104,789	35.26	3,694,860.14
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	16,368	288.73	4,725,932.64
AT&T INC	2,309,979	18.61	42,988,709.19
LIBERTY GLOBAL PLC- C	82,999	19.38	1,608,520.62
LIBERTY GLOBAL PLC-A	55,653	18.52	1,030,693.56
T-MOBILE US INC	201,718	142.54	28,752,883.72
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,361,195	37.66	51,262,603.70
AES CORP	215,104	22.21	4,777,459.84
ALLIANT ENERGY CORP	78,245	51.83	4,055,438.35
AMEREN CORPORATION	84,684	84.04	7,116,843.36
AMERICAN ELECTRIC POWER	166,616	89.09	14,843,819.44
AMERICAN WATER WORKS CO INC	59,268	141.84	8,406,573.12
ATMOS ENERGY CORP	44,651	109.38	4,883,926.38
CENTERPOINT ENERGY INC	197,928	28.34	5,609,279.52
CMS ENERGY CORP	92,467	60.43	5,587,780.81
CONSOLIDATED EDISON INC	112,923	95.07	10,735,589.61
CONSTELLATION ENERGY	106,482	73.44	7,820,038.08
DOMINION ENERGY INC	270,934	53.83	14,584,377.22



DTE ENERGY COMPANY	63,693	106.75	6,799,227.75
DUKE ENERGY CORP	248,859	94.37	23,484,823.83
EDISON INTERNATIONAL	124,809	68.38	8,534,439.42
ENTERGY CORP	66,606	103.69	6,906,376.14
ESSENTIAL UTILITIES INC	83,324	42.11	3,508,773.64
EVERGY INC	71,920	59.45	4,275,644.00
EVERSOURCE ENERGY	113,730	75.73	8,612,772.90
EXELON CORP	321,962	40.24	12,955,750.88
FIRSTENERGY CORP	177,948	39.17	6,970,223.16
NEXTERA ENERGY INC	643,250	75.69	48,687,592.50
NISOURCE INC	135,740	26.75	3,631,045.00
NRG ENERGY INC	77,774	31.49	2,449,103.26
P G & E CORP	474,569	15.64	7,422,259.16
PPL CORP	240,681	26.78	6,445,437.18
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	162,684	58.78	9,562,565.52
SEMPRA ENERGY	101,868	142.78	14,544,713.04
SOUTHERN CO/THE	352,384	68.59	24,170,018.56
UGI CORP	62,839	33.17	2,084,369.63
VISTRA CORP	119,689	23.42	2,803,116.38
WEC ENERGY GROUP INC	102,839	93.22	9,586,651.58
XCEL ENERGY INC	177,891	65.55	11,660,755.05
ADVANCED MICRO DEVICES	522,532	97.95	51,182,009.40
ANALOG DEVICES INC	164,968	187.69	30,962,843.92
APPLIED MATERIALS INC	279,138	119.53	33,365,365.14
BROADCOM INC	134,999	636.17	85,882,313.83
ENPHASE ENERGY INC	43,002	195.99	8,427,961.98
ENTEGRIS INC	47,458	78.04	3,703,622.32
FIRST SOLAR INC	30,588	211.10	6,457,126.80
INTEL CORP	1,338,076	29.36	39,285,911.36
KLA CORP	45,997	375.07	17,252,094.79
LAM RESEARCH CORP	44,334	502.06	22,258,328.04
MARVELL TECHNOLOGY INC	277,787	41.06	11,407,323.15
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	178,589	79.43	14,185,324.27
MICRON TECHNOLOGY INC	352,295	61.16	21,546,362.20
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	14,391	485.40	6,985,391.40
NVIDIA CORP	796,563	267.79	213,311,605.77

	NXP SEMICONDUCTORS NV	84,083	176.55	14,844,853.65	
	ON SEMICONDUCTOR	141,273	77.81	10,992,452.13	
	QORVO INC	33,116	100.92	3,342,066.72	
	QUALCOMM INC	362,853	124.76	45,269,540.28	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	51,093	114.94	5,872,629.42	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	17,872	284.52	5,084,941.44	
	TERADYNE INC	48,350	106.34	5,141,539.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	293,703	179.51	52,722,625.53	
	WOLFSPEED INC	40,925	61.30	2,508,702.50	
	CBRE GROUP INC - A	100,186	68.86	6,898,807.96	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	356,100	4.23	1,506,303.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	51,785	43.43	2,249,022.55	
	アメリカドル 小計	109,534,545		11,101,812,793.89 (1,450,451,841,521)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	192,700	15.18	2,925,186.00	
	CAMECO CORP	142,600	33.06	4,714,356.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	358,600	70.60	25,317,160.00	
	CENOVUS ENERGY INC	468,200	21.32	9,982,024.00	
	ENBRIDGE INC	655,300	50.43	33,046,779.00	
	IMPERIAL OIL LTD	65,500	63.50	4,159,250.00	
	KEYERA CORP	76,700	28.41	2,179,047.00	
	PARKLAND CORP	42,600	30.73	1,309,098.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	177,532	41.92	7,442,141.44	
	SUNCOR ENERGY INC	440,400	39.79	17,523,516.00	
	TC ENERGY CORP	329,400	52.00	17,128,800.00	
	TOURMALINE OIL CORP	104,800	54.59	5,721,032.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	145,040	70.96	10,292,038.40	
	BARRICK GOLD CORP	578,600	25.44	14,719,584.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	50,500	64.66	3,265,330.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193,600	28.35	5,488,560.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	62,900	198.33	12,474,957.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	193,100	11.41	2,203,271.00	
	KINROSS GOLD CORP	392,200	5.97	2,341,434.00	
	LUNDIN MINING CORP	222,100	7.90	1,754,590.00	
	NUTRIEN LTD	169,659	98.56	16,721,591.04	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	75,100	24.74	1,857,974.00	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	155,300	48.21	7,487,013.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	18,200	95.16	1,731,912.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	141,300	64.62	9,130,806.00
CAE INC	97,800	28.97	2,833,266.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	28,300	106.62	3,017,346.00
WSP GLOBAL INC	40,300	169.62	6,835,686.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	62,000	44.66	2,768,920.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	57,700	74.73	4,311,921.00
THOMSON REUTERS CORP	55,032	174.60	9,608,587.20
AIR CANADA	62,200	18.14	1,128,308.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	186,500	156.11	29,114,515.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	301,600	103.19	31,122,104.00
TFI INTERNATIONAL INC	25,900	154.26	3,995,334.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	88,900	68.96	6,130,544.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	9,100	103.77	944,307.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	57,100	43.65	2,492,415.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	93,010	85.61	7,962,586.10
QUEBECOR INC -CL B	55,600	32.05	1,781,980.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	146,400	38.94	5,700,816.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19,100	167.53	3,199,823.00
DOLLARAMA INC	86,700	78.72	6,825,024.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	263,100	64.66	17,012,046.00
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	33.91	1,875,223.00
LOBLAW COMPANIES LTD	50,700	116.29	5,895,903.00
METRO INC/CN	74,600	70.74	5,277,204.00
WESTON (GEORGE) LTD	21,811	166.57	3,633,058.27
SAPUTO INC	76,200	34.01	2,591,562.00
BANK OF MONTREAL	219,400	116.01	25,452,594.00
BANK OF NOVA SCOTIA	386,300	65.85	25,437,855.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	296,000	56.66	16,771,360.00
NATIONAL BANK OF CANADA	110,500	92.67	10,240,035.00
ROYAL BANK OF CANADA	446,900	126.81	56,671,389.00
TORONTO-DOMINION BANK	586,500	77.62	45,524,130.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	113,787	42.60	4,847,326.20
BROOKFIELD CORP	459,550	41.14	18,905,887.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	115,800	17.73	2,053,134.00

	IGM FINANCIAL INC	20,700	40.16	831,312.00	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	17,800	56.76	1,010,328.00	
	ONEX CORPORATION	24,300	63.10	1,533,330.00	
	TMX GROUP LTD	19,600	133.89	2,624,244.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7,400	900.02	6,660,148.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	86,000	34.57	2,973,020.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	34,100	81.60	2,782,560.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	55,900	193.41	10,811,619.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	610,700	24.34	14,864,438.00	
	POWER CORP OF CANADA	168,700	34.64	5,843,768.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	191,000	61.43	11,733,130.00	
	CGI INC	69,100	127.47	8,808,177.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	6,500	2,391.35	15,543,775.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	29,200	106.49	3,109,508.00	
	LUMINE GROUP INC	18,902	16.75	316,608.50	
	OPEN TEXT CORP	91,800	50.79	4,662,522.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	387,700	61.73	23,932,721.00	
	BCE INC	22,600	60.79	1,373,854.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	112,600	62.76	7,066,776.00	
	TELUS CORP	145,100	27.30	3,961,230.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	241,500	11.00	2,656,500.00	
	ALTAGAS LTD	94,600	21.59	2,042,414.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	39,350	43.84	1,725,104.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	38,000	35.93	1,365,340.00	
	EMERA INC	89,100	54.70	4,873,770.00	
	FORTIS INC	152,100	56.16	8,541,936.00	
	HYDRO ONE LTD	110,100	37.08	4,082,508.00	
	NORTHLAND POWER INC	79,600	33.22	2,644,312.00	
	FIRSTSERVICE CORP	13,900	184.26	2,561,214.00	
	カナダドル 小計	13,179,573		753,815,805.15 (71,733,112,018)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	82,331	30.23	2,488,866.13	
	SANTOS LTD	1,045,835	6.85	7,163,969.75	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	64,847	28.87	1,872,132.89	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	617,078	32.56	20,092,059.68	
	BHP GROUP LTD	1,640,306	43.64	71,582,953.84	

BLUESCOPE STEEL LTD	157,082	19.36	3,041,107.52
FORTESCUE METALS GROUP LTD	534,912	20.32	10,869,411.84
IGO LTD	231,962	11.96	2,774,265.52
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	147,510	31.50	4,646,565.00
MINERAL RESOURCES LTD	53,520	77.21	4,132,279.20
NEWCREST MINING LTD	294,637	26.27	7,740,113.99
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	369,774	11.53	4,263,494.22
ORICA LTD	158,310	14.95	2,366,734.50
PILBARA MINERALS LTD	735,369	3.56	2,617,913.64
RIO TINTO LTD	117,797	114.43	13,479,510.71
SOUTH32 LTD	1,507,938	4.12	6,212,704.56
REECE LTD	81,800	16.03	1,311,254.00
BRAMBLES LTD	460,976	13.32	6,140,200.32
COMPUTERSHARE LTD	169,145	20.75	3,509,758.75
AURIZON HOLDINGS LTD	607,049	3.36	2,039,684.64
QANTAS AIRWAYS LTD	318,258	6.43	2,046,398.94
TRANSURBAN GROUP	1,010,795	14.13	14,282,533.35
ARISTOCRAT LEISURE LTD	196,842	36.60	7,204,417.20
IDP EDUCATION LTD	66,233	26.40	1,748,551.20
LOTTERY CORP LTD/THE	673,112	5.12	3,446,333.44
REA GROUP LTD	16,523	131.74	2,176,740.02
SEEK LTD	111,070	23.05	2,560,163.50
WESFARMERS LTD	370,295	49.60	18,366,632.00
COLES GROUP LTD	423,676	17.87	7,571,090.12
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	449,953	6.73	3,028,183.69
WOOLWORTHS GROUP LTD	395,400	37.46	14,811,684.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	245,838	12.94	3,181,143.72
COCHLEAR LTD	20,154	225.89	4,552,587.06
RAMSAY HEALTH CARE LTD	55,070	63.65	3,505,205.50
SONIC HEALTHCARE LTD	142,034	33.75	4,793,647.50
CSL LTD	156,294	288.49	45,089,256.06
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	972,363	22.52	21,897,614.76
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	548,750	95.84	52,592,200.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,023,715	27.18	27,824,573.70
WESTPAC BANKING CORP	1,137,495	21.20	24,114,894.00
ASX LTD	59,402	65.40	3,884,890.80

	MACQUARIE GROUP LTD	119,392	169.60	20,248,883.20
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	762,528	4.53	3,454,251.84
	MEDIBANK PRIVATE LTD	936,375	3.20	2,996,400.00
	QBE INSURANCE GROUP LTD	488,602	14.02	6,850,200.04
	SUNCORP GROUP LTD	404,738	11.80	4,775,908.40
	WISETECH GLOBAL LTD	43,885	63.42	2,783,186.70
	XERO LTD	42,700	87.70	3,744,790.00
	TELSTRA GROUP LTD	1,329,461	4.17	5,543,852.37
	APA GROUP	397,094	9.98	3,962,998.12
	ORIGIN ENERGY LTD	540,177	7.92	4,278,201.84
	LENDLEASE GROUP	244,789	7.14	1,747,793.46
	オーストラリアドル 小計	22,781,191		507,410,187.23 (44,038,130,149)
イギリスポンド	BP PLC	5,890,625	4.86	28,646,109.37
	SHELL PLC	2,284,597	22.00	50,272,556.98
	ANGLO AMERICAN PLC	413,083	25.38	10,484,046.54
	ANTOFAGASTA PLC	124,065	15.17	1,882,066.05
	CRODA INTERNATIONAL PLC	45,330	64.16	2,908,372.80
	GLENORE PLC	3,339,230	4.42	14,782,771.21
	JOHNSON MATTHEY PLC	58,854	19.32	1,137,353.55
	MONDI PLC	161,979	12.89	2,087,909.31
	RIO TINTO PLC	364,484	52.53	19,146,344.52
	ASHTED GROUP PLC	143,104	47.37	6,778,836.48
	BAE SYSTEMS PLC	1,000,726	9.73	9,737,063.98
	BUNZL PLC	111,508	30.17	3,364,196.36
	DCC PLC	30,399	42.91	1,304,421.09
	MELROSE INDUSTRIES PLC	1,211,674	1.57	1,913,233.24
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,661,015	1.43	3,819,620.93
	SMITHS GROUP PLC	113,243	17.10	1,936,455.30
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	24,603	113.00	2,780,139.00
	EXPERIAN PLC	292,420	25.98	7,597,071.60
	INTERTEK GROUP PLC	55,231	39.23	2,166,712.13
	RELX PLC	621,328	25.77	16,011,622.56
	RENTOKIL INITIAL PLC	814,870	5.66	4,615,423.68
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	290,184	4.41	1,280,581.99
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32,323	40.20	1,299,384.60

BURBERRY GROUP PLC	126,278	23.43	2,958,693.54
PERSIMMON PLC	103,740	12.00	1,244,880.00
TAYLOR WIMPEY PLC	1,180,533	1.15	1,363,515.61
COMPASS GROUP PLC	576,332	19.92	11,480,533.44
ENTAIN PLC	198,717	11.81	2,347,841.35
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	57,197	51.12	2,923,910.64
PEARSON PLC	194,698	8.13	1,582,894.74
WHITBREAD PLC	65,187	28.17	1,836,317.79
AUTO TRADER GROUP PLC	265,668	5.94	1,578,067.92
INFORMA PLC	468,909	6.61	3,099,488.49
WPP PLC	357,177	9.17	3,276,741.79
JD SPORTS FASHION PLC	728,558	1.63	1,194,470.84
KINGFISHER PLC	567,509	2.56	1,454,525.56
NEXT PLC	41,419	66.94	2,772,587.86
OCADO GROUP PLC	164,438	4.39	722,211.69
SAINSBURY (J) PLC	620,861	2.59	1,608,650.85
TESCO PLC	2,341,521	2.50	5,872,534.66
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	119,280	19.18	2,287,790.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	689,661	28.72	19,807,063.92
COCA-COLA HBC AG-DI	61,536	21.82	1,342,715.52
DIAGEO PLC	736,458	35.99	26,505,123.42
IMPERIAL BRANDS PLC	294,866	18.83	5,553,801.11
HALEON PLC	1,597,387	3.25	5,203,488.15
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	232,853	61.04	14,213,347.12
UNILEVER PLC	821,442	41.97	34,475,920.74
SMITH & NEPHEW PLC	282,738	11.33	3,203,421.54
ASTRAZENECA PLC	502,030	110.80	55,624,924.00
GSK PLC	1,319,314	14.01	18,486,227.76
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	54,192	16.71	905,819.28
BARCLAYS PLC	5,102,640	1.33	6,832,434.96
HSBC HOLDINGS PLC	6,471,780	5.34	34,559,305.20
LLOYDS BANKING GROUP PLC	21,959,810	0.45	10,038,927.14
NATWEST GROUP PLC	1,665,358	2.58	4,304,950.43
STANDARD CHARTERED PLC	805,585	5.91	4,767,452.03
3I GROUP PLC	319,724	15.42	4,931,742.70
ABRDN PLC	590,816	2.02	1,196,402.40

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	123,322	7.87	971,037.42	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	122,342	77.50	9,481,505.00	
	M&G PLC	725,660	1.79	1,303,648.19	
	SCHRODERS PLC	321,906	4.36	1,406,407.31	
	ST JAMES' S PLACE PLC	165,599	11.73	1,943,304.26	
	ADMIRAL GROUP PLC	63,019	19.96	1,257,859.24	
	AVIVA PLC	934,484	4.08	3,815,498.17	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,879,875	2.29	4,312,433.25	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	222,425	5.48	1,220,668.40	
	PRUDENTIAL PLC	894,025	10.24	9,154,816.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	304,183	7.50	2,281,980.86	
	HALMA PLC	121,077	20.96	2,537,773.92	
	BT GROUP PLC	2,143,878	1.39	2,996,069.50	
	VODAFONE GROUP PLC	8,474,128	0.88	7,506,382.58	
	NATIONAL GRID PLC	1,189,865	10.58	12,594,721.02	
	SEVERN TRENT PLC	83,766	28.16	2,358,850.56	
	SSE PLC	353,777	17.06	6,035,435.62	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	232,410	10.40	2,417,064.00	
	イギリスポンド 小計	90,126,828		571,106,473.16 (91,308,502,928)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	60,430	14.43	872,004.90	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2,396	722.50	1,731,110.00	
	GIVAUDAN-REG	3,011	2,944.00	8,864,384.00	
	HOLCIM LTD	179,986	56.06	10,090,015.16	
	SIG GROUP AG	103,650	22.86	2,369,439.00	
	SIKA AG-REG	47,415	248.10	11,763,661.50	
	ABB LTD-REG	508,544	29.79	15,149,525.76	
	GEBERIT AG-REG	11,828	489.20	5,786,257.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	7,216	189.60	1,368,153.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12,662	198.30	2,510,874.60	
	VAT GROUP AG	8,759	309.40	2,710,034.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	55,553	31.08	1,726,587.24	
	SGS SA-REG	2,020	2,050.00	4,141,000.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	17,625	258.60	4,557,825.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	169,553	139.25	23,610,255.25	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	9,553	304.30	2,906,977.90	



	SWATCH GROUP AG/THE-REG	17,907	55.60	995,629.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,062	1,892.00	2,009,304.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	350	10,460.00	3,661,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	33	104,700.00	3,455,100.00	
	NESTLE SA-REG	890,070	109.64	97,587,274.80	
	ALCON INC	162,900	61.06	9,946,674.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	17,404	249.30	4,338,817.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	36,777	126.45	4,650,451.65	
	BACHEM HOLDING AG	12,632	85.90	1,085,088.80	
	LONZA GROUP AG-REG	24,236	528.40	12,806,302.40	
	NOVARTIS AG-REG	700,539	76.36	53,493,158.04	
	ROCHE HOLDING AG-BR	8,133	277.00	2,252,841.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	228,046	258.40	58,927,086.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	9,251	85.70	792,810.70	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,198,227	0.75	909,693.93	
	JULIUS BAER GROUP LTD	66,539	61.80	4,112,110.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	7,088	819.80	5,810,742.40	
	UBS GROUP AG-REG	1,084,690	17.26	18,721,749.40	
	BALOISE HOLDING AG - REG	15,786	137.20	2,165,839.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	9,590	530.00	5,082,700.00	
	SWISS RE AG	98,553	90.68	8,936,786.04	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	48,770	420.60	20,512,662.00	
	TEMENOS AG - REG	22,921	57.64	1,321,166.44	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55,125	48.36	2,665,845.00	
	SWISSCOM AG-REG	8,185	587.60	4,809,506.00	
	BKW AG	6,450	139.70	901,065.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	22,533	76.75	1,729,407.75	
	スイスフラン 小計	5,953,998		433,838,917.66 (61,657,186,977)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	883,868	48.50	42,867,598.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	451,500	85.30	38,512,950.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	656,000	13.72	9,000,320.00	
	MTR CORP	448,500	37.80	16,953,300.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	352,000	16.80	5,913,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	691,000	51.60	35,655,600.00	
	SANDS CHINA LTD	775,600	26.60	20,630,960.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	562,000	23.80	13,375,600.00	
	WH GROUP LTD	2,846,000	4.46	12,693,160.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,166,000	25.15	29,324,900.00	
	HANG SENG BANK LTD	249,300	113.50	28,295,550.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	393,600	342.00	134,611,200.00	
	AIA GROUP LTD	3,840,200	81.55	313,168,310.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,165,000	10.38	12,092,700.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	160,500	42.25	6,781,125.00	
	CLP HOLDINGS LTD	546,000	56.40	30,794,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	3,603,348	6.94	25,007,235.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	421,500	41.90	17,660,850.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	652,868	47.15	30,782,726.20	
	ESR GROUP LTD	632,800	13.66	8,644,048.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	15.20	11,004,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	415,641	27.00	11,222,307.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	552,250	21.40	11,818,150.00	
	SINO LAND CO	1,247,400	10.72	13,372,128.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	477,500	107.20	51,188,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	145,000	59.60	8,642,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	305,600	20.30	6,203,680.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	534,000	45.05	24,056,700.00	
	香港ドル 小計	24,898,975		970,273,897.32 (16,145,357,651)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	28.76	868,552.00	
	KEPPEL CORP LTD	477,500	5.40	2,578,500.00	
	SEMBICORP MARINE LTD	9,113,103	0.10	947,762.71	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	529,600	3.53	1,869,488.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	461,640	5.68	2,622,115.20	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,914,500	1.08	2,067,660.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	670,600	4.18	2,803,108.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	587,900	33.37	19,618,223.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,080,900	12.36	13,359,924.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	385,300	29.29	11,285,437.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	303,500	9.08	2,755,780.00	
	VENTURE CORP LTD	76,900	17.45	1,341,905.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,616,560	2.38	6,227,412.80	

	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	802,000	3.48	2,790,960.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	118,100	7.16	845,596.00	
	UOL GROUP LTD	194,000	6.59	1,278,460.00	
	シンガポールドル 小計	19,362,303		73,260,883.71 (7,186,160,083)	
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	418,085	8.86	3,704,233.10	
	EBOS GROUP LTD	54,700	45.12	2,468,064.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	175,116	26.16	4,581,034.56	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	630,447	4.94	3,117,560.41	
	MERCURY NZ LTD	216,705	6.07	1,315,399.35	
	MERIDIAN ENERGY LTD	445,023	5.02	2,236,240.57	
	ニュージーランドドル 小計	1,940,076		17,422,531.99 (1,411,921,992)	
スウェーデンク ローネ	BOLIDEN AB	89,974	392.00	35,269,808.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	402.60	13,292,644.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	189,562	135.90	25,761,475.80	
	ALFA LAVAL AB	92,471	340.30	31,467,881.30	
	ASSA ABLOY AB-B	327,679	234.90	76,971,797.10	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	886,563	119.94	106,334,366.22	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	483,052	108.04	52,188,938.08	
	EPIROC AB-A	209,247	189.75	39,704,618.25	
	EPIROC AB-B	132,310	162.35	21,480,528.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	81.06	12,907,345.92	
	INDUTRADE AB	83,800	208.40	17,463,920.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	199.85	11,683,031.15	
	LIFCO AB-B SHS	71,700	203.90	14,619,630.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	495,296	106.90	52,947,142.40	
	SANDVIK AB	346,200	200.30	69,343,860.00	
	SKANSKA AB-B SHS	104,733	158.40	16,589,707.20	
	SKF AB-B SHARES	113,171	188.50	21,332,733.50	
	VOLVO AB-A SHS	62,474	205.60	12,844,654.40	
	VOLVO AB-B SHS	489,768	197.14	96,552,863.52	
	SECURITAS AB-B SHS	156,813	84.24	13,209,927.12	
VOLVO CAR AB-B	207,500	41.34	8,578,050.00		
ELECTROLUX AB-B	84,165	117.50	9,889,387.50		
EVOLUTION AB	59,565	1,310.00	78,030,150.00		

	EMBRACER GROUP AB	230,400	49.22	11,341,440.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	218,689	121.20	26,505,106.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	194,331	296.50	57,619,141.50	
	GETINGE AB-B SHS	64,924	242.50	15,744,070.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	60,727	244.40	14,841,678.80	
	NORDEA BANK ABP	1,079,194	104.90	113,207,450.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	525,384	108.80	57,161,779.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	455,890	85.14	38,814,474.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	294,827	173.60	51,181,967.20	
	EQT AB	117,771	198.00	23,318,658.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	44,871	265.80	11,926,711.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	53,600	265.50	14,230,800.00	
	INVESTOR AB-A SHS	153,400	204.00	31,293,600.00	
	INVESTOR AB-B SHS	592,176	196.54	116,386,271.04	
	KINNEVIK AB - B	80,928	142.15	11,503,915.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	24,225	450.80	10,920,630.00	
	ERICSSON LM-B SHS	950,219	56.31	53,506,831.89	
	HEXAGON AB-B SHS	628,643	111.80	70,282,287.40	
	TELE2 AB-B SHS	198,238	98.36	19,498,689.68	
	TELIA CO AB	910,648	26.08	23,749,699.84	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	147,348	39.00	5,746,572.00	
	SAGAX AB-B	64,700	220.90	14,292,230.00	
	スウェーデンクローネ 小計	12,027,884		1,631,538,465.71 (20,443,176,975)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	103,871	243.40	25,282,201.40	
	EQUINOR ASA	309,888	281.30	87,171,494.40	
	NORSK HYDRO ASA	434,804	71.64	31,149,358.56	
	YARA INTERNATIONAL ASA	49,574	438.80	21,753,071.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,500	416.20	13,526,500.00	
	ADEVINTA ASA	106,857	78.35	8,372,245.95	
	MOWI ASA	135,763	180.30	24,478,068.90	
	ORKLA ASA	250,892	74.32	18,646,293.44	
	SALMAR ASA	25,891	435.20	11,267,763.20	
	DNB BANK ASA	287,728	180.60	51,963,676.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69,251	166.60	11,537,216.60	
	TELENOR ASA	211,605	121.10	25,625,365.50	

ノルウェークローネ 小計		2,018,624		330,773,255.95 (4,128,050,234)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	33,357	511.00	17,045,427.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	62,014	349.00	21,642,886.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	1,599.50	5,599,849.50
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	321,595	188.42	60,594,929.90
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,039	15,650.00	16,260,350.00
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,524	15,785.00	24,056,340.00
	DSV A/S	61,428	1,281.50	78,719,982.00
	PANDORA A/S	30,806	603.60	18,594,501.60
	CARLSBERG AS-B	31,440	1,028.00	32,320,320.00
	COLOPLAST-B	39,767	850.80	33,833,763.60
	DEMANT A/S	34,228	225.00	7,701,300.00
	GENMAB A/S	20,841	2,578.00	53,728,098.00
	NOVO NORDISK A/S-B	536,405	1,049.00	562,688,845.00
	DANSKE BANK A/S	221,483	136.35	30,199,207.05
	TRYG A/S	114,270	146.05	16,689,133.50
ORSTED A/S	60,759	547.50	33,265,552.50	
デンマーククローネ 小計		1,574,457		1,012,940,485.65 (19,124,316,369)
イスラエルシケル	ICL GROUP LTD	211,785	23.85	5,051,072.25
	ELBIT SYSTEMS LTD	7,200	626.00	4,507,200.00
	BANK HAPOALIM BM	386,829	31.45	12,165,772.05
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	520,979	29.74	15,493,915.46
	FIRST INTL BANK ISRAEL	24,000	134.40	3,225,600.00
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	403,741	18.19	7,344,048.79
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	48,267	117.90	5,690,679.30
	NICE LTD	19,783	762.00	15,074,646.00
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	572,400	5.09	2,913,516.00
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	35,700	148.00	5,283,600.00
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	208.30	3,084,089.80
イスラエルシケル 小計		2,245,490		79,834,139.65 (2,910,289,693)
ユーロ	ENI SPA	809,885	12.17	9,857,920.22
	GALP ENERGIA SGPS SA	151,355	9.91	1,500,836.18
	NESTE OYJ	134,607	43.70	5,882,325.90

OMV AG	44,483	40.16	1,786,437.28
REPSOL SA	447,793	13.79	6,175,065.47
TENARIS SA	134,483	12.82	1,724,744.47
TOTALENERGIES SE	804,888	51.81	41,701,247.28
AIR LIQUIDE SA	169,278	149.60	25,323,988.80
AKZO NOBEL N. V.	58,755	66.40	3,901,332.00
ARCELORMITTAL	172,493	26.02	4,488,267.86
ARKEMA	19,014	87.18	1,657,640.52
BASF SE	299,008	45.91	13,728,952.32
COVESTRO AG	64,321	36.38	2,339,997.98
CRH PLC	239,258	44.05	10,539,314.90
EVONIK INDUSTRIES AG	76,974	18.43	1,418,630.82
HEIDELBERGCEMENT AG	47,261	61.80	2,920,729.80
KONINKLIJKE DSM NV	57,034	109.20	6,228,112.80
OCI NV	34,955	26.22	916,520.10
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	81,855	32.18	2,634,093.90
SOLVAY SA	24,153	99.16	2,395,011.48
STORA ENSO OYJ-R SHS	184,408	11.85	2,185,234.80
SYMRISE AG	42,629	98.10	4,181,904.90
UMICORE	62,556	29.47	1,843,525.32
UPM-KYMMENE OYJ	175,063	31.16	5,454,963.08
VOESTALPINE AG	39,061	30.16	1,178,079.76
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	64,621	28.08	1,814,557.68
AIRBUS SE	191,745	117.40	22,510,863.00
ALSTOM	96,250	23.75	2,285,937.50
BOUYGUES SA	69,916	30.32	2,119,853.12
BRENTAG SE	49,586	67.70	3,356,972.20
CNH INDUSTRIAL NV	324,390	13.34	4,327,362.60
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	159,461	49.30	7,861,427.30
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	147,911	29.53	4,367,811.83
DASSAULT AVIATION SA	6,763	181.90	1,230,189.70
EIFFAGE	27,982	95.64	2,676,198.48
FERROVIAL SA	157,922	26.37	4,164,403.14
GEA GROUP AG	52,112	41.70	2,173,070.40
IMCD NV	18,078	142.85	2,582,442.30
KINGSPAN GROUP PLC	51,132	58.88	3,010,652.16

KNORR-BREMSE AG	25,881	59.02	1,527,496.62
KONE OYJ-B	105,985	46.28	4,904,985.80
LEGRAND SA	87,343	80.62	7,041,592.66
METSO OUTOTEC OYJ	226,750	9.12	2,069,774.00
MTU AERO ENGINES AG	17,773	224.80	3,995,370.40
PRYSMIAN SPA	81,681	35.58	2,906,209.98
RATIONAL AG	1,276	609.00	777,084.00
RHEINMETALL AG	14,260	263.00	3,750,380.00
SAFRAN SA	111,259	133.30	14,830,824.70
SCHNEIDER ELECTRIC SE	175,676	142.30	24,998,694.80
SIEMENS AG-REG	248,011	140.58	34,865,386.38
SIEMENS ENERGY AG	137,504	18.54	2,549,324.16
THALES SA	33,295	135.10	4,498,154.50
VINCI SA	174,577	101.36	17,695,124.72
WARTSILA OYJ ABP	161,062	8.09	1,304,280.07
BUREAU VERITAS SA	94,880	26.05	2,471,624.00
RANDSTAD NV	40,342	56.34	2,272,868.28
TELEPERFORMANCE	19,579	209.10	4,093,968.90
WOLTERS KLUWER	82,203	113.20	9,305,379.60
ADP	10,260	125.20	1,284,552.00
AENA SME SA	24,220	142.20	3,444,084.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	179,416	9.36	1,680,589.67
DEUTSCHE POST AG-REG	322,641	41.44	13,370,243.04
GETLINK SE	132,190	14.62	1,932,617.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	108,847	97.76	10,640,882.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	18,227	91.90	1,675,061.30
CONTINENTAL AG	34,400	64.56	2,220,864.00
DR ING HC F PORSCHE AG	34,570	112.40	3,885,668.00
FERRARI NV	41,289	243.90	10,070,387.10
MERCEDES-BENZ GROUP AG	261,161	69.65	18,189,863.65
MICHELIN (CGDE)	215,236	26.95	5,801,686.38
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	45,820	50.82	2,328,572.40
RENAULT SA	57,337	35.45	2,032,596.65
STELLANTIS NV	735,283	15.90	11,692,470.26
VALEO	72,083	17.59	1,268,300.38
VOLKSWAGEN AG	8,950	149.50	1,338,025.00

VOLKSWAGEN AG-PREF	59,893	119.00	7,127,267.00
ADIDAS AG	53,323	141.12	7,524,941.76
HERMES INTERNATIONAL	10,313	1,787.00	18,429,331.00
KERING	24,404	580.50	14,166,522.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	89,703	813.40	72,964,420.20
MONCLER SPA	63,271	60.64	3,836,753.44
PUMA SE	32,556	52.42	1,706,585.52
SEB SA	9,694	98.45	954,374.30
ACCOR SA	57,043	28.08	1,601,767.44
AMADEUS IT GROUP SA	147,055	58.00	8,529,190.00
DELIVERY HERO SE	54,469	29.74	1,619,908.06
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	54,758	158.80	8,695,570.40
JUST EAT TAKEAWAY	57,881	16.78	971,590.46
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	37,870	36.83	1,394,752.10
SODEXO SA	26,938	86.62	2,333,369.56
BOLLORE SE	271,925	5.61	1,525,499.25
PUBLICIS GROUPE	75,307	68.66	5,170,578.62
SCOUT24 SE	27,257	54.66	1,489,867.62
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	228,537	22.81	5,214,071.65
VIVENDI SE	236,529	9.13	2,160,928.94
D' IETEREN GROUP	8,226	168.00	1,381,968.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	356,760	29.16	10,403,121.60
PROSUS NV	258,955	70.70	18,308,118.50
ZALANDO SE	72,249	33.96	2,453,576.04
CARREFOUR SA	197,337	17.49	3,451,424.13
HELLOFRESH SE	45,738	17.39	795,612.51
JERONIMO MARTINS	95,613	20.06	1,917,996.78
KESKO OYJ-B SHS	93,457	18.95	1,771,010.15
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	340,291	30.37	10,334,637.67
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	281,584	57.47	16,182,632.48
DANONE	209,261	56.27	11,775,116.47
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	156,074	11.12	1,735,542.88
HEINEKEN HOLDING NV	38,117	82.65	3,150,370.05
HEINEKEN NV	84,248	97.74	8,234,399.52
JDE PEET' S NV	35,400	27.94	989,076.00
KERRY GROUP PLC-A	52,682	90.36	4,760,345.52



PERNOD RICARD SA	64,425	207.70	13,381,072.50
REMY COINTREAU	6,746	169.60	1,144,121.60
BEIERSDORF AG	33,411	117.35	3,920,780.85
HENKEL AG & CO KGAA	34,620	65.30	2,260,686.00
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	57,517	69.24	3,982,477.08
L' OREAL	78,199	398.05	31,127,111.95
AMPLIFON SPA	42,891	30.41	1,304,315.31
BIOMERIEUX	13,869	100.60	1,395,221.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	11,510	132.95	1,530,254.50
DIASORIN SPA	9,103	102.05	928,961.15
ESSILORLUXOTTICA	94,599	162.10	15,334,497.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	67,833	37.07	2,514,569.31
FRESENIUS SE & CO KGAA	129,848	23.60	3,064,412.80
KONINKLIJKE PHILIPS NV	285,870	14.80	4,230,876.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	92,542	50.78	4,699,282.76
ARGENX SE	18,640	334.70	6,238,808.00
BAYER AG-REG	318,918	55.55	17,715,894.90
EUROFINS SCIENTIFIC	44,948	60.44	2,716,657.12
GRIFOLS SA	82,564	8.70	718,471.92
IPSEN	13,860	104.10	1,442,826.00
MERCK KGAA	41,961	168.65	7,076,722.65
ORION OYJ-CLASS B	34,824	41.61	1,449,026.64
QIAGEN N. V.	73,322	42.48	3,114,718.56
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	32,103	38.82	1,246,238.46
SANOFI	369,695	97.10	35,897,384.50
SARTORIUS AG-VORZUG	7,294	389.50	2,841,013.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	8,551	301.70	2,579,836.70
UCB SA	42,461	78.98	3,353,569.78
ABN AMRO BANK NV-CVA	133,234	14.36	1,913,240.24
AIB GROUP PLC	297,214	3.58	1,066,403.83
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,957,926	6.12	12,000,128.45
BANCO SANTANDER SA	5,447,634	3.22	17,541,381.48
BANK OF IRELAND GROUP PLC	351,816	8.97	3,156,493.15
BNP PARIBAS	360,592	50.47	18,199,078.24
CAIXABANK SA	1,457,948	3.49	5,092,612.36
COMMERZBANK AG	350,612	8.87	3,112,733.33

CREDIT AGRICOLE SA	373,329	9.94	3,711,263.58
ERSTE GROUP BANK AG	110,379	28.19	3,111,584.01
FINECOBANK SPA	186,022	13.61	2,531,759.42
ING GROEP NV	1,214,160	10.37	12,598,124.16
INTESA SANPAOLO	5,260,087	2.26	11,903,576.88
KBC GROUP NV	79,725	59.84	4,770,744.00
MEDIOBANCA SPA	181,481	8.99	1,632,240.11
SOCIETE GENERALE SA	258,996	19.90	5,154,020.40
UNICREDIT SPA	626,452	16.23	10,167,315.96
ADYEN NV	6,905	1,414.60	9,767,813.00
AMUNDI SA	21,837	55.60	1,214,137.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	674,053	8.54	5,756,412.62
DEUTSCHE BOERSE AG	62,076	179.10	11,117,811.60
EDEMRED	81,610	52.54	4,287,789.40
EURAZEO SE	11,669	62.25	726,395.25
EURONEXT NV	28,504	68.94	1,965,065.76
EXOR NV	35,414	73.08	2,588,055.12
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	32,086	75.10	2,409,658.60
NEXI SPA	160,933	7.10	1,143,268.03
SOFINA	5,291	190.60	1,008,464.60
WENDEL	9,312	95.50	889,296.00
WORLDLINE SA	76,356	37.61	2,871,749.16
AEGON NV	589,592	3.83	2,260,495.72
AGEAS	51,936	38.80	2,015,116.80
ALLIANZ SE-REG	130,743	205.15	26,821,926.45
ASSICURAZIONI GENERALI	355,557	17.69	6,289,803.33
AXA SA	609,980	26.63	16,246,817.30
HANNOVER RUECK SE	20,084	171.50	3,444,406.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	45,585	314.60	14,341,041.00
NN GROUP NV	91,002	32.16	2,926,624.32
POSTE ITALIANE SPA	188,025	9.19	1,729,077.90
SAMPO OYJ-A SHS	153,542	42.92	6,590,022.64
BECHTLE AG	26,787	41.42	1,109,517.54
CAPGEMINI SE	53,362	165.70	8,842,083.40
DASSAULT SYSTEMES SE	217,325	37.20	8,084,490.00
NEMETSCHEK SE	20,683	58.96	1,219,469.68

SAP SE	338,318	113.98	38,561,485.64
NOKIA OYJ	1,771,979	4.31	7,638,115.47
CELLNEX TELECOM SA	185,248	34.00	6,298,432.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,052,306	21.72	22,856,086.32
ELISA OYJ	43,016	55.28	2,377,924.48
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	114,083	11.72	1,337,623.17
KONINKLIJKE KPN NV	1,065,750	3.21	3,422,123.25
ORANGE	659,792	10.67	7,045,258.97
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.28	1,028,976.37
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	297,838	2.83	843,477.21
TELEFONICA SA	1,669,173	3.76	6,289,443.86
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	30,096	17.26	519,456.96
ACCIONA SA	8,326	173.90	1,447,891.40
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	19,200	34.42	660,864.00
E. ON SE	715,946	11.03	7,900,464.11
EDP RENOVAVEIS SA	96,779	19.74	1,910,417.46
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	850,867	4.71	4,014,390.50
ELIA GROUP SA/NV	10,658	118.20	1,259,775.60
ENAGAS SA	82,825	17.14	1,419,620.50
ENDESA SA	108,855	19.04	2,072,599.20
ENEL SPA	2,652,916	5.39	14,304,523.07
ENGIE	594,425	13.57	8,068,724.95
FORTUM OYJ	136,337	13.17	1,795,558.29
IBERDROLA SA	1,985,042	11.07	21,974,414.94
NATURGY ENERGY GROUP SA	45,200	26.85	1,213,620.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	131,018	15.68	2,055,017.33
RWE AG	203,358	37.46	7,617,790.68
SNAM SPA	600,034	4.74	2,846,561.29
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	469,067	7.43	3,487,044.07
VEOLIA ENVIRONNEMENT	218,632	26.14	5,715,040.48
VERBUND AG	22,697	72.85	1,653,476.45
ASM INTERNATIONAL NV	15,362	333.30	5,120,154.60
ASML HOLDING NV	130,614	598.70	78,198,601.80
INFINEON TECHNOLOGIES AG	424,820	34.15	14,509,727.10
STMICROELECTRONICS NV	218,245	45.40	9,909,414.22
AROUNDTOWN SA	379,138	1.47	557,332.86

	LEG IMMOBILIEN SE	21,715	50.56	1,097,910.40	
	VONOVIA SE	237,081	16.68	3,955,696.48	
	ユーロ 小計	59,636,987		1,475,748,197.73 (207,593,498,974)	
	合 計	365,280,931		1,998,131,545,564 (1,998,131,545,564)	

(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	49,695	5,956,442.70	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	107,934	3,220,750.56	
		AMERICAN TOWER CORP	150,965	30,135,633.30	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,541	7,025,451.93	
		BOSTON PROPERTIES INC	47,057	2,325,556.94	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	32,617	3,258,112.13	
		CROWN CASTLE INC	140,816	18,230,039.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	94,070	8,877,385.90	
		EQUINIX INC	30,049	20,484,403.30	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	57,122	3,662,091.42	
		EQUITY RESIDENTIAL	115,240	6,452,287.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,585	4,333,620.45	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	42,486	6,508,855.20	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	85,391	4,228,562.32	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	114,571	2,173,411.87	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	171,442	3,584,852.22	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	236,020	3,554,461.20	
		INVITATION HOMES INC	202,193	5,952,561.92	
		IRON MOUNTAIN INC	93,347	4,709,356.15	
		KIMCO REALTY CORP	206,423	3,717,678.23	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	177,787	1,338,736.11	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,527	5,235,780.18	
		PROLOGIS INC	299,123	35,006,364.69	
PUBLIC STORAGE	51,336	14,712,897.60			

		REALTY INCOME CORP	204,741	12,497,390.64	
		REGENCY CENTERS CORP	47,157	2,751,139.38	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	35,298	9,050,760.18	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	106,342	11,004,270.16	
		SUN COMMUNITIES INC	39,952	5,327,599.20	
		UDR INC	100,713	3,897,593.10	
		VENTAS INC	126,173	5,345,950.01	
		VICI PROPERTIES INC	314,744	9,775,948.64	
		WELLTOWER INC	154,040	10,394,619.20	
		WEYERHAEUSER CO	241,709	6,898,374.86	
		WP CAREY INC	68,940	5,326,304.40	
アメリカドル合計			4,048,146	286,955,243.05 (37,490,702,504)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,300	1,082,751.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,169,070.00	
カナダドル合計			81,900	2,251,821.00 (214,283,286)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	314,109	2,371,522.95	
		GOODMAN GROUP	547,446	10,100,378.70	
		GPT GROUP	656,296	2,749,880.24	
		MIRVAC GROUP	1,162,900	2,430,461.00	
		SCENTRE GROUP	1,734,337	4,752,083.38	
		STOCKLAND	815,965	3,141,465.25	
		VICINITY CENTRES	1,315,193	2,571,202.31	
オーストラリアドル合計			6,546,246	28,116,993.83 (2,440,273,894)	
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	317,051	1,160,723.71	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	250,833	1,439,279.75	
		SEGRO PLC	403,906	2,912,162.26	
イギリスポンド合計			971,790	5,512,165.72 (881,285,055)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	659,600	33,045,960.00	
香港ドル合計			659,600	33,045,960.00 (549,884,774)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,134,200	3,141,734.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,879,771	3,609,160.32	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,029,700	1,750,490.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	650,700	1,151,739.00	
シンガポールドル合計			4,694,371	9,653,123.32 (946,874,866)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	13,302	687,048.30	
		GECINA SA	16,340	1,495,927.00	
		KLEPIERRE	71,486	1,476,900.76	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,721	1,666,027.44	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	50,808	1,344,379.68	
ユーロ合計			187,657	6,670,283.18 (938,308,734)	
合計				43,461,613,113 (43,461,613,113)	

(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 604 銘柄	97.48%	—	71.05%
	投資証券 35 銘柄	—	2.52%	1.84%
カナダドル	株式 87 銘柄	99.70%	—	3.51%
	投資証券 2 銘柄	—	0.30%	0.01%
オーストラリアドル	株式 52 銘柄	94.75%	—	2.16%
	投資証券 7 銘柄	—	5.25%	0.12%
イギリスポンド	株式 77 銘柄	99.04%	—	4.47%
	投資証券 3 銘柄	—	0.96%	0.04%
スイスフラン	株式 43 銘柄	100.00%	—	3.02%
香港ドル	株式 28 銘柄	96.71%	—	0.79%
	投資証券 1 銘柄	—	3.29%	0.03%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	88.36%	—	0.35%
	投資証券 4 銘柄	—	11.64%	0.05%
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 45 銘柄	100.00%	—	1.00%
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%	—	0.94%
イスラエルシェケル	株式 11 銘柄	100.00%	—	0.14%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.55%	—	10.17%

	投資証券	5 銘柄	—	0.45%	0.05%
--	------	------	---	-------	-------

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 新興国株式インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

[令和5年3月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	4,909,212,460
コール・ローン	3,742,308,396
株式	378,099,670,726
投資証券	505,631,462
派生商品評価勘定	184,218,169
未収入金	8,045,019
未収配当金	1,005,456,696
差入委託証拠金	2,489,773,001
流動資産合計	390,944,315,929
資産合計	390,944,315,929
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,078,964
未払金	172,564
未払解約金	2,512,415,648
未払利息	1,247
流動負債合計	2,518,668,423
負債合計	2,518,668,423
純資産の部	
元本等	
元本	132,357,255,077
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	256,068,392,429
元本等合計	388,425,647,506
純資産合計	388,425,647,506
負債純資産合計	390,944,315,929

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。なお、ロシア株式(DR(預託証券))を含みます。以下、同じ。)の評価については、「重要な会計上の見積りに関する注
--------------------	---

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

1. ロシア株式（以下、「当該株式」）の時価の算定

(1) 当期の財務諸表に計上した金額

当該株式の評価額 0 円（令和 4 年 3 月 11 日評価額 1,506,109,929 円（保有割合 0.55%））

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

① 当期の財務諸表に計上した金額の算出方法及び算出に用いた主要な仮定

令和 4 年 2 月 24 日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構や S W I F T からの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。

時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、令和 4 年 3 月 14 日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。

なお、令和 4 年 3 月 24 日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。

② 翌期の財務諸表への影響

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 期首	令和 4 年 3 月 26 日
期首元本額	96,332,054,262 円
期中追加設定元本額	61,769,057,738 円
期中一部解約元本額	25,743,856,923 円
元本の内訳※	
MAX I S 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	841,129,494 円
eMAX I S 新興国株式インデックス	11,065,153,296 円
eMAX I S バランス（8資産均等型）	1,756,174,844 円
eMAX I S バランス（波乗り型）	60,571,670 円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	558,832,142 円
コアバランス	66,352 円
eMAX I S S l i m バランス（8資産均等型）	7,560,918,726 円
eMAX I S S l i m 新興国株式インデックス	33,758,762,487 円
つみたて新興国株式	6,955,271,795 円
つみたて8資産均等バランス	3,550,898,320 円
eMAX I S マイマネージャー 1970s	510,590 円



eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,454,731円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,454,933円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	8,472,485,479円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	749,398,271円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	34,168,691,868円
新興国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	1,590,115,284円
つみたて全世界株式	39,931,659円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	782,436,527円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	38,745,046円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	378,133,700円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	372,214,436円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	15,585,125,143円
新興国株式インデックスオープン	490,728,000円
eMAXIS 全世界株式インデックス	936,389,051円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	87,650,708円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	32,096,723円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	185,732,313円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	185,582,610円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	747,502,119円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	1,094,054,574円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	16,885,765円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	61,805,863円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	60,731,444円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	60,437,882円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	54,376,109円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	50,805,123円
合計	132,357,255,077円
2. 受益権の総数	132,357,255,077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 令和 4 年 3 月 26 日 至 令和 5 年 3 月 27 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドは、新株予約権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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有してお</p>

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△4,871,110,981
投資証券	△3,577,400
合計	△4,874,688,381

(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

[令和 5 年 3 月 27 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	11,207,630,606	—	11,385,324,405	177,693,799
合計		11,207,630,606	—	11,385,324,405	177,693,799

(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。

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

[令和 5 年 3 月 27 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	2,838,684,880	—	2,839,130,286	445,406
合計		2,838,684,880	—	2,839,130,286	445,406

(注) 時価の算定方法

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

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

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

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1口当たり純資産額	2.9347円
(1万口当たり純資産額)	(29,347円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM PJSC	3,587,358	—	—	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	535,200	1.36	731,618.40	
	LUKOIL PJSC	122,600	—	—	
	NOVATEK PJSC	282,700	—	—	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	384,962	—	—	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	2,405,300	—	—	

SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	2,315,000	—	—
TATNEFT PJSC	455,759	—	—
ALROSA PJSC	745,960	—	—
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	130,323	8.20	1,068,648.60
MMC NORILSK NICKEL PJSC	19,483	—	—
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	439,080	—	—
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	53,979	—	—
POLYUS PJSC	10,871	—	—
SEVERSTAL PJSC	62,882	—	—
SOUTHERN COPPER CORP	36,830	71.24	2,623,769.20
UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	1,071,810	—	—
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	189,806	28.51	5,411,369.06
NIO INC - ADR	620,335	9.07	5,626,438.45
H WORLD GROUP LTD-ADR	86,802	47.49	4,122,226.98
TAL EDUCATION GROUP- ADR	180,671	6.02	1,087,639.42
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	245,489	36.22	8,891,611.58
YUM CHINA HOLDINGS INC	187,981	61.68	11,594,668.08
AUTOHOME INC-ADR	29,375	30.85	906,218.75
IQIYI INC-ADR	186,085	6.84	1,272,821.40
JOYY INC-ADR	20,462	29.96	613,041.52
KANZHUN LTD - ADR	76,979	19.59	1,508,018.61
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	314,160	7.66	2,406,465.60
VK CO LTD	34,689	—	—
WEIBO CORP-SPON ADR	33,274	18.72	622,889.28
YANDEX NV-A	92,564	—	—
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	46,958	16.42	771,050.36
OZON HOLDINGS PLC - ADR	20,405	—	—
PDD HOLDINGS INC	227,013	73.96	16,789,881.48
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	182,565	15.04	2,745,777.60
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	2	—	—
MAGNIT PJSC	23,556	—	—
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	34,286	—	—
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	27,400	46.06	1,262,044.00
ZAI LAB LTD-ADR	36,082	31.70	1,143,799.40
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	1,570,713	1.32	2,073,341.16
CREDICORP LTD	32,224	124.28	4,004,798.72

	SBERBANK PJSC –SPONSORED ADR	796,628	—	—
	TCS GROUP HOLDING–GDR REG S	38,258	—	—
	VTB BANK PJSC	1,305,990,000	—	—
	360 DIGITECH INC	54,200	18.09	980,478.00
	LUFAX HOLDING LTD–ADR	258,676	1.95	504,418.20
	MOSCOW EXCHANGE MICEX–RTS PJ	425,170	—	—
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE–B	186,810	3.27	611,429.13
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	172,850	—	—
	INTER RAO UES PJSC	12,239,000	—	—
	DAQO NEW ENERGY CORP–ADR	24,020	50.65	1,216,613.00
	KE HOLDINGS INC–ADR	296,983	18.36	5,452,607.88
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD–B	402,594	0.78	317,244.07
	アメリカドル 小計	1,338,045,162		86,360,927.93 (11,283,055,234)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO–H	819,000	5.91	4,840,290.00
	CHINA OILFIELD SERVICES–H	824,000	7.70	6,344,800.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL–H	11,364,000	4.69	53,297,160.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO–H	1,531,500	25.50	39,053,250.00
	PETROCHINA CO LTD–H	9,115,000	4.25	38,738,750.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO–H	658,000	23.00	15,134,000.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD–H	1,820,000	3.99	7,261,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD–H	628,000	27.90	17,521,200.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,077,000	8.04	8,659,080.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA–H	2,036,000	6.93	14,109,480.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	914,000	4.28	3,911,920.00
	CMOC GROUP LTD–H	1,620,000	4.57	7,403,400.00
	DONGYUE GROUP	534,000	8.20	4,378,800.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L–H	91,120	48.75	4,442,100.00
	JIANGXI COPPER CO LTD–H	460,000	12.76	5,869,600.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	722,000	6.11	4,411,420.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT–H	290,250	15.80	4,585,950.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY – H	660,000	12.20	8,052,000.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD–H	2,422,000	12.80	31,001,600.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH–H	1,247,000	4.26	5,312,220.00
	BOC AVIATION LTD	97,300	60.00	5,838,000.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI–H	1,132,000	3.76	4,256,320.00

CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	775,500	14.16	10,981,080.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	499,000	7.31	3,647,690.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,586,000	5.03	7,977,580.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	570,000	9.25	5,272,500.00	
CITIC LTD	2,602,000	9.06	23,574,120.00	
CRRC CORP LTD - H	1,934,000	4.11	7,948,740.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,324,500	6.32	8,370,840.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	339,000	20.00	6,780,000.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	500,000	8.25	4,125,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	756,800	11.62	8,794,016.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	258,000	36.10	9,313,800.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	1,958,111	3.38	6,618,415.18	
AIR CHINA LTD-H	758,000	6.90	5,230,200.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	656,000	6.18	4,054,080.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	844,000	12.20	10,296,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	618,000	5.46	3,374,280.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	1,278,100	9.20	11,758,520.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	630,000	5.57	3,509,100.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	806,000	7.50	6,045,000.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	61,000	150.50	9,180,500.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	816,000	7.13	5,818,080.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	606,000	6.22	3,769,320.00	
BYD CO LTD-H	371,000	211.20	78,355,200.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,236,000	3.62	4,474,320.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	251,200	33.85	8,503,120.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	2,719,000	10.02	27,244,380.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,047,500	9.18	9,616,050.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	888,945	4.95	4,400,277.75	
LI AUTO INC-CLASS A	506,344	92.65	46,912,771.60	
MINTH GROUP LTD	364,000	21.60	7,862,400.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	388,424	39.05	15,167,957.20	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	482,000	18.76	9,042,320.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	545,800	113.00	61,675,400.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	1,462,000	4.33	6,330,460.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	1,014,600	25.55	25,923,030.00	
LI NING CO LTD	1,058,500	60.20	63,721,700.00	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	384,600	85.45	32,864,070.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	549,000	9.18	5,039,820.00	
EAST BUY HOLDING LTD	170,000	33.45	5,686,500.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	590,000	20.65	12,183,500.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	314,000	18.72	5,878,080.00	
MEITUAN-CLASS B	2,248,320	140.20	315,214,464.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	689,780	30.45	21,003,801.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	498,800	17.06	8,509,528.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	548,000	16.44	9,009,120.00	
BAIDU INC-CLASS A	992,074	154.40	153,176,225.60	
BILIBILI INC-CLASS Z	79,435	190.40	15,124,424.00	
CHINA LITERATURE LTD	220,600	41.90	9,243,140.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,556,000	2.12	5,418,720.00	
KINGSOFT CORP LTD	403,600	37.00	14,933,200.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	795,400	56.90	45,258,260.00	
NETEASE INC	886,895	141.00	125,052,195.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	2,804,600	376.80	1,056,773,280.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	6,671,000	85.30	569,036,300.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	234,000	16.74	3,917,160.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	31,400	196.00	6,154,400.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	874,600	15.20	13,293,920.00	
JD.COM INC - CL A	967,983	158.80	153,715,700.40	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	231,000	19.84	4,583,040.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	970,000	7.18	6,964,600.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	231,000	37.00	8,547,000.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,266,000	6.38	14,457,080.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	492,650	64.55	31,800,557.50	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	187,100	22.40	4,191,040.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	47,100	137.87	6,493,677.00	
CHINA FEIHE LTD	1,508,000	6.02	9,078,160.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	—	—	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,425,000	34.65	49,376,250.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	722,000	62.90	45,413,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	927,500	3.27	3,032,925.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	800,000	44.90	35,920,000.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	797,000	10.36	8,256,920.00	

TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	904,000	14.22	12,854,880.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	270,000	82.50	22,275,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	561,000	8.24	4,622,640.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,514,000	5.12	12,871,680.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	292,000	21.55	6,292,600.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	302,500	36.00	10,890,000.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	175,000	20.40	3,570,000.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	133,600	61.45	8,209,720.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	298,400	20.25	6,042,600.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,072,000	12.32	13,207,040.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	265,300	14.74	3,910,522.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	612,400	22.80	13,962,720.00	
3SBIO INC	630,500	7.80	4,917,900.00	
AKESO INC - B	211,000	40.50	8,545,500.00	
BEIGENE LTD	278,423	134.00	37,308,682.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	633,000	12.20	7,722,600.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	847,500	6.99	5,924,025.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,306,000	4.07	5,315,420.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	4,053,840	7.64	30,971,337.60	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	494,000	18.48	9,129,120.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	81,100	81.85	6,638,035.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	506,000	13.84	7,003,040.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	506,500	38.50	19,500,250.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	104,400	40.05	4,181,220.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	240,500	22.20	5,339,100.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	5,020,500	4.34	21,788,970.00	
WUXI APTEC CO LTD-H	123,140	83.20	10,245,248.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	1,615,500	48.90	78,997,950.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	12,820,000	2.88	36,921,600.00	
BANK OF CHINA LTD-H	35,554,000	3.01	107,017,540.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	4,055,900	4.87	19,752,233.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	3,950,000	3.86	15,247,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	43,262,550	5.06	218,908,503.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,189,000	2.47	2,936,830.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,748,550	40.00	69,942,000.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	2,919,320	2.68	7,823,777.60	



IND & COMM BK OF CHINA-H	25,293,350	4.22	106,737,937.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	3,720,000	4.81	17,893,200.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	5,572,000	1.04	5,794,880.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,621,500	4.08	6,615,720.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	634,000	15.50	9,827,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	907,000	16.92	15,346,440.00
FAR EAST HORIZON LTD	513,000	6.82	3,498,660.00
GF SECURITIES CO LTD-H	442,400	11.14	4,928,336.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,798,800	4.90	8,814,120.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	754,800	8.91	6,725,268.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	3,263,000	13.06	42,614,780.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,165,600	20.60	24,011,360.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	486,800	8.62	4,196,216.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	532,400	18.50	9,849,400.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	3,392,000	2.61	8,853,120.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	3,096,000	7.57	23,436,720.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2,845,000	52.00	147,940,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	306,800	25.20	7,731,360.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	1,144,000	5.93	6,783,920.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	351,476	18.84	6,621,807.84
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	1,098,000	13.66	14,998,680.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	250,500	18.68	4,679,340.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	251,000	23.80	5,973,800.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	306,000	27.45	8,399,700.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	449,500	9.57	4,301,715.00
LENOVO GROUP LTD	3,320,000	8.79	29,182,800.00
SUNNY OPTICAL TECH	322,600	97.35	31,405,110.00
XIAOMI CORP-CLASS B	6,840,800	12.44	85,099,552.00
ZTE CORP-H	501,131	24.95	12,503,218.45
CHINA TOWER CORP LTD-H	19,744,000	0.97	19,151,680.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	206,000	27.85	5,737,100.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,488,000	1.94	2,886,720.00
CGN POWER CO LTD-H	4,100,000	1.90	7,790,000.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,295,800	10.60	13,735,480.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,511,000	9.29	14,037,190.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	2,292,000	3.16	7,242,720.00

	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	421,400	28.65	12,073,110.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	932,000	16.86	15,713,520.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	356,900	102.00	36,403,800.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,434,000	7.86	11,271,240.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	1,700,000	4.20	7,140,000.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	1,680,000	6.26	10,516,800.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	146,000	21.60	3,153,600.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	9,280,000	1.89	17,539,200.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	251,000	34.95	8,772,450.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	153,000	31.10	4,758,300.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,238,000	8.95	20,030,100.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	299,000	26.30	7,863,700.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,660,000	1.59	4,229,400.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	1,729,000	19.68	34,026,720.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	610,000	8.94	5,453,400.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	1,444,000	35.40	51,117,600.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	291,600	39.45	11,503,620.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	822,551	12.88	10,594,456.88	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	5,470,232	2.24	12,253,319.68	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	952,000	12.90	12,280,800.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	299,000	10.16	3,037,840.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	480,000	5.02	2,409,600.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	877,500	22.25	19,524,375.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	768,000	11.70	8,985,600.00	
	香港ドル 小計	374,682,794		5,575,231,530.28 (92,771,852,663)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	2,239,880	2.26	5,062,128.80	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	149,300	20.98	3,132,314.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,214,900	6.67	8,103,383.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,634,800	4.67	7,634,516.00	
	GAMUDA BHD	715,000	4.10	2,931,500.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	221,400	5.15	1,140,210.00	
	SIME DARBY BERHAD	1,129,200	2.15	2,427,780.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	349,900	6.78	2,372,322.00	
	MISC BHD	522,300	7.19	3,755,337.00	

	GENTING BHD	916,400	4.50	4,123,800.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	1,221,400	2.55	3,114,570.00	
	MR DIY GROUP M BHD	978,000	1.66	1,623,480.00	
	IOI CORP BHD	1,053,200	3.78	3,981,096.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	189,000	20.80	3,931,200.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	30,900	134.70	4,162,230.00	
	PPB GROUP BERHAD	294,240	16.56	4,872,614.40	
	QL RESOURCES BHD	521,250	5.70	2,971,125.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	967,000	4.22	4,080,740.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	705,300	5.79	4,083,687.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	1,607,000	0.95	1,534,685.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	902,300	3.62	3,266,326.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,108,200	5.19	16,131,558.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	286,800	19.98	5,730,264.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	122,500	17.90	2,192,750.00	
	MALAYAN BANKING BHD	1,991,700	8.43	16,790,031.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	6,503,400	3.90	25,363,260.00	
	RHB BANK BHD	682,449	5.44	3,712,522.56	
	AXIATA GROUP BERHAD	1,195,000	2.99	3,573,050.00	
	CELCOMDIGI BHD	1,398,100	4.27	5,969,887.00	
	MAXIS BHD	1,122,400	3.98	4,467,152.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	653,000	4.81	3,140,930.00	
	PETRONAS GAS BHD	413,000	16.12	6,657,560.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	1,070,800	9.54	10,215,432.00	
	INARI AMERTRON BHD	1,618,200	2.41	3,899,862.00	
	マレーシアリングイト 小計	37,728,219		186,149,302.76 (5,490,399,225)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,493,000	10.80	37,724,400.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	652,200	143.50	93,590,700.00	
	PTT PCL-NVDR	4,402,800	31.00	136,486,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	735,900	51.50	37,898,850.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	787,000	35.00	27,545,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,048,461	46.25	48,491,321.25	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	561,600	46.75	26,254,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	345,150	319.00	110,102,850.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	1,861,600	72.00	134,035,200.00	

BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	3,539,400	8.60	30,438,840.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	2,999,900	7.20	21,599,280.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	3,667,900	5.60	20,540,240.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,449,100	32.75	47,458,025.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	955,517	45.75	43,714,902.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	1,999,001	14.30	28,585,714.30	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	1,193,900	21.00	25,071,900.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	593,600	38.50	22,853,600.00	
CP ALL PCL-NVDR	2,565,900	62.75	161,010,225.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	139,600	99.00	13,820,400.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,531,600	21.70	33,235,720.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	937,200	31.75	29,756,100.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,210,200	14.50	17,547,900.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	4,626,000	29.25	135,310,500.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	263,500	217.00	57,179,500.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	277,200	131.50	36,451,800.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,246,400	16.90	21,064,160.00	
SCB X PCL-NVDR	370,400	102.50	37,966,000.00	
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	398,400	47.00	18,724,800.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	418,000	54.25	22,676,500.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	402,800	33.75	13,594,500.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	355,100	51.00	18,110,100.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	139,500	994.00	138,663,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	551,100	213.00	117,384,300.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	513,100	74.25	38,097,675.00	
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	5,276,828	8.55	45,116,879.40	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	611,700	40.50	24,773,850.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	90,600	157.00	14,224,200.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	751,800	75.75	56,948,850.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	372,600	68.75	25,616,250.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	1,176,000	53.25	62,622,000.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	494,800	38.75	19,173,500.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	809,100	68.50	55,423,350.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	3,795,800	9.60	36,439,680.00	
タイパーツ 小計	59,611,257		2,143,324,162.70 (8,166,065,059)	

フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	641,380	51.20	32,838,656.00	
	AYALA CORPORATION	103,755	666.00	69,100,830.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	1,608,969	52.45	84,390,424.05	
	SM INVESTMENTS CORP	99,935	905.00	90,441,175.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	507,200	213.20	108,135,040.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	261,310	225.20	58,847,012.00	
	MONDE NISSIN CORP	2,742,200	11.34	31,096,548.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	367,600	146.80	53,963,680.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	840,145	101.50	85,274,717.50	
	BDO UNIBANK INC	1,062,476	127.00	134,934,452.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	842,956	58.50	49,312,926.00	
	PLDT INC	35,425	1,350.00	47,823,750.00	
	ACEN CORP	335,365	6.42	2,153,043.30	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	113,060	300.40	33,963,224.00	
	AYALA LAND INC	3,327,220	28.50	94,825,770.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	5,127,700	34.00	174,341,800.00		
	フィリピンペン 小計	18,016,696		1,151,443,047.85 (2,769,335,674)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	6,965,600	2,680.00	18,667,808,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	690,800	27,675.00	19,117,890,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	3,302,400	1,895.00	6,258,048,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	13,337,270	820.00	10,936,561,400.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	1,246,400	7,350.00	9,161,040,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	6,416,400	3,960.00	25,408,944,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	1,836,700	6,300.00	11,571,210,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	995,100	6,425.00	6,393,517,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	9,134,400	5,950.00	54,349,680,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	7,091,700	2,930.00	20,778,681,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	3,067,700	5,125.00	15,721,962,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,010,700	9,975.00	10,081,732,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	2,112,200	6,325.00	13,359,665,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	3,086,500	4,270.00	13,179,355,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	9,978,000	2,130.00	21,253,140,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	25,004,400	8,825.00	220,663,830,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	8,355,300	10,900.00	91,072,770,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	3,445,700	9,625.00	33,164,862,500.00		

	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	30,670,500	4,770.00	146,298,285,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	7,334,800	895.00	6,564,646,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	21,993,500	4,070.00	89,513,545,000.00	
	インドネシアルピア 小計	167,076,070		843,517,173,400.00 (7,338,599,408)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	7,080,668	9.24	65,425,372.32	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,369,970	83.08	113,817,107.60	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	64,905	257.29	16,699,407.45	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	468,098	37.26	17,441,331.48	
	ALFA S. A. B. -A	1,094,600	10.97	12,007,762.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	205,400	85.77	17,617,158.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	158,400	336.85	53,357,040.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	88,800	544.15	48,320,520.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	118,725	188.02	22,322,674.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	1,036,800	17.44	18,081,792.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	2,344,000	72.94	170,971,360.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	172,666	161.69	27,918,365.54	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	270,100	144.76	39,099,676.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	852,700	165.78	141,360,606.00	
	GRUMA S. A. B. -B	89,175	252.19	22,489,043.25	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	566,500	87.17	49,381,805.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	712,600	37.80	26,936,280.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	357,300	64.33	22,985,109.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	1,176,800	149.01	175,354,968.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	991,400	36.97	36,652,058.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	12,408,800	19.18	238,000,784.00	
	メキシコペソ 小計	31,628,407		1,336,240,220.14 (9,472,206,048)	
ブラジルリアル	COSAN SA	560,800	13.99	7,845,592.00	
	PETRO RIO SA	322,100	30.28	9,753,188.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,722,300	25.66	44,194,218.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	2,098,700	22.79	47,829,373.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	306,800	13.09	4,016,012.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	310,700	13.77	4,278,339.00	
	GERDAU SA-PREF	585,900	24.59	14,407,281.00	
	KLABIN SA - UNIT	321,800	18.31	5,892,158.00	

SUZANO SA	338,622	42.63	14,435,455.86
VALE SA	1,721,829	78.67	135,456,287.43
WEG SA	756,688	40.51	30,653,430.88
CCR SA	527,800	11.81	6,233,318.00
LOCALIZA RENT A CAR	329,713	51.29	16,910,979.77
RUMO SA	592,900	18.15	10,761,135.00
LOJAS RENNER S. A.	410,922	16.99	6,981,564.78
MAGAZINE LUIZA SA	1,065,200	3.23	3,440,596.00
VIBRA ENERGIA SA	464,100	13.03	6,047,223.00
ATACADA0 SA	343,900	11.46	3,941,094.00
RAIA DROGASIL SA	485,300	24.00	11,647,200.00
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	370,700	14.95	5,541,965.00
AMBEV SA	2,091,400	13.89	29,049,546.00
JBS SA	318,500	18.11	5,768,035.00
NATURA &CO HOLDING SA	418,400	13.63	5,702,792.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,929,371	2.25	4,341,084.75
REDE D'OR SAO LUIZ SA	264,500	21.10	5,580,950.00
HYPERA SA	205,800	39.67	8,164,086.00
BANCO BRADESCO S. A.	619,437	11.40	7,061,581.80
BANCO BRADESCO SA-PREF	2,505,286	12.71	31,842,185.06
BANCO DO BRASIL S. A.	392,300	37.59	14,746,557.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	177,400	25.85	4,585,790.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,193,130	23.22	50,924,478.60
ITAUSA SA	2,339,145	7.85	18,362,288.25
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	2,771,525	10.56	29,267,304.00
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	513,000	18.58	9,531,540.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	315,000	33.07	10,417,050.00
TOTVS SA	247,700	27.07	6,705,239.00
TELEFONICA BRASIL S. A.	231,375	39.13	9,053,703.75
TIM SA	382,377	12.70	4,856,187.90
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	103,700	33.73	3,497,801.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	558,600	30.99	17,311,014.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	777,990	10.63	8,270,033.70
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	155,400	47.32	7,353,528.00
CPFL ENERGIA SA	104,700	29.82	3,122,154.00
ENERGISA SA-UNITS	86,100	37.39	3,219,279.00

	ENEVA SA	383,000	10.54	4,036,820.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	96,550	39.80	3,842,690.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	437,000	25.37	11,086,690.00	
	ブラジルリアル 小計	34,255,460		707,966,819.53 (17,625,258,752)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	179,570	5,675.00	1,019,059,750.00	
	EMPRESAS CMPC SA	544,129	1,298.90	706,769,158.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	65,190	65,350.00	4,260,166,500.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	6,502,900	77.30	502,674,170.00	
	FALABELLA SA	290,088	1,823.80	529,062,494.00	
	CENCOSUD SA	549,556	1,510.00	829,829,560.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	71,640	6,000.10	429,847,164.00	
	BANCO DE CHILE	20,282,094	76.71	1,555,839,430.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	22,255	23,300.00	518,541,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	34,054,503	34.01	1,158,193,647.00	
	ENEL AMERICAS SA	8,527,077	96.00	818,599,392.00	
	ENEL CHILE SA	12,211,839	38.50	470,155,801.00	
	チリペソ 小計	83,300,841		12,798,738,566.00 (2,063,054,266)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	19,486	56,900.00	1,108,753,400.00	
	S-OIL CORP	21,502	76,200.00	1,638,452,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	25,186	159,600.00	4,019,685,600.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	44,037	41,600.00	1,831,939,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	40,550	33,200.00	1,346,260,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	4,147	527,000.00	2,185,469,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	8,081	140,100.00	1,132,148,100.00	
	LG CHEM LTD	21,775	690,000.00	15,024,750,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	4,941	300,000.00	1,482,300,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	9,469	177,200.00	1,677,906,800.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	12,234	261,000.00	3,193,074,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	32,308	322,000.00	10,403,176,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	12,000	65,000.00	780,000,000.00	
	SKC CO LTD	8,074	102,400.00	826,777,600.00	
	CJ CORP	6,002	100,600.00	603,801,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	23,889	40,900.00	977,060,100.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	187,961	16,300.00	3,063,764,300.00	



ECOPRO BM CO LTD	25,500	233,000.00	5,941,500,000.00	
GS HOLDINGS	28,574	39,050.00	1,115,814,700.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	46,328	35,800.00	1,658,542,400.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	9,100	97,400.00	886,340,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	10,557	66,800.00	705,207,600.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	32,869	43,800.00	1,439,662,200.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	20,092	73,100.00	1,468,725,200.00	
LG CORP	42,409	83,000.00	3,519,947,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	15,692	569,000.00	8,928,748,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	37,807	108,200.00	4,090,717,400.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	71,394	29,250.00	2,088,274,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	235,703	4,935.00	1,163,194,305.00	
SK INC	16,696	165,200.00	2,758,179,200.00	
S-1 CORPORATION	10,022	55,100.00	552,212,200.00	
HMM CO LTD	113,840	20,200.00	2,299,568,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	8,473	155,000.00	1,313,315,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	83,648	22,800.00	1,907,174,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	128,072	5,540.00	709,518,880.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	34,955	32,650.00	1,141,280,750.00	
HANON SYSTEMS	106,991	8,390.00	897,654,490.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	27,520	210,500.00	5,792,960,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	64,296	177,700.00	11,425,399,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	14,465	93,100.00	1,346,691,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	7,269	92,000.00	668,748,000.00	
KIA CORP	116,788	77,600.00	9,062,748,800.00	
COWAY CO LTD	22,456	50,100.00	1,125,045,600.00	
F&F CO LTD / NEW	6,500	134,400.00	873,600,000.00	
LG ELECTRONICS INC	50,381	113,000.00	5,693,053,000.00	
KANGWON LAND INC	47,178	19,350.00	912,894,300.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	30,006	18,890.00	566,813,340.00	
HYBE CO LTD	8,133	187,500.00	1,524,937,500.00	
KAKAO CORP	140,748	61,400.00	8,641,927,200.00	
KAKAO GAMES CORP	16,300	41,200.00	671,560,000.00	
KRAFTON INC	13,066	173,000.00	2,260,418,000.00	
NAVER CORP	59,212	202,500.00	11,990,430,000.00	
NCSOFT CORP	7,497	378,000.00	2,833,866,000.00	

NETMARBLE CORP	6,554	64,000.00	419,456,000.00	
PEARL ABYSS CORP	8,795	46,250.00	406,768,750.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	12,861	78,500.00	1,009,588,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	5,734	79,700.00	456,999,800.00	
BGF RETAIL CO LTD	2,676	180,400.00	482,750,400.00	
E-MART INC	11,844	103,000.00	1,219,932,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	3,867	315,000.00	1,218,105,000.00	
KT&G CORP	49,792	87,500.00	4,356,800,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	9,688	133,400.00	1,292,379,200.00	
AMOREPACIFIC CORP	11,679	128,500.00	1,500,751,500.00	
LG H&H	4,130	581,000.00	2,399,530,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	41,278	63,300.00	2,612,897,400.00	
HLB INC	49,202	34,900.00	1,717,149,800.00	
SD BIOSENSOR INC	10,000	21,200.00	212,000,000.00	
CELLTRION INC	44,853	153,600.00	6,889,420,800.00	
CELLTRION PHARM INC	5,506	92,700.00	510,406,200.00	
HANMI PHARM CO LTD	2,437	254,500.00	620,216,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	7,953	797,000.00	6,338,541,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	17,376	61,100.00	1,061,673,600.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	8,100	69,800.00	565,380,000.00	
YUHAN CORP	22,310	50,500.00	1,126,655,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	135,165	40,350.00	5,453,907,750.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	100,284	9,640.00	966,737,760.00	
KAKAOBANK CORP	64,800	24,800.00	1,607,040,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	175,925	47,050.00	8,277,271,250.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	204,018	34,550.00	7,048,821,900.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	255,624	11,010.00	2,814,420,240.00	
KAKAOPAY CORP	11,248	57,500.00	646,760,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	20,102	54,600.00	1,097,569,200.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	30,021	39,950.00	1,199,338,950.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	108,063	6,370.00	688,361,310.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	119,622	6,310.00	754,814,820.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	60,045	8,630.00	518,188,350.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	23,495	30,800.00	723,646,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	20,186	71,200.00	1,437,243,200.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	13,865	202,500.00	2,807,662,500.00	

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	39,812	62,600.00	2,492,231,200.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	14,353	119,900.00	1,720,924,700.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	10,954	64,000.00	701,056,000.00	
	L&F CO LTD	10,593	268,000.00	2,838,924,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	106,843	15,250.00	1,629,355,750.00	
	LG INNOTEK CO LTD	7,648	258,000.00	1,973,184,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	25,952	154,900.00	4,019,964,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,150,044	63,000.00	135,452,772,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	368,542	52,800.00	19,459,017,600.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	24,743	719,000.00	17,790,217,000.00	
	LG UPLUS CORP	93,715	10,960.00	1,027,116,400.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	103,604	17,940.00	1,858,655,760.00	
	SK HYNIX INC	246,332	87,300.00	21,504,783,600.00	
	SK SQUARE CO LTD	39,940	37,500.00	1,497,750,000.00	
	韓国ウォン 小計	7,114,352		447,697,123,855.00 (44,993,560,947)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	459,150	83.20	38,201,280.00	
	ASIA CEMENT CORP	919,281	43.00	39,529,083.00	
	CHINA STEEL CORP	5,292,947	31.10	164,610,651.70	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	1,561,430	68.80	107,426,384.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	1,856,600	91.40	169,693,240.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	2,126,557	76.80	163,319,577.60	
	TAIWAN CEMENT	2,603,696	37.60	97,898,969.60	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	63,000	1,150.00	72,450,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,246,138	31.10	38,754,891.80	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	30,000	1,705.00	51,150,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	1,314,000	53.10	69,773,400.00	
	CHINA AIRLINES LTD	1,131,000	19.30	21,828,300.00	
	EVA AIRWAYS CORP	1,061,000	26.40	28,010,400.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	460,353	160.50	73,886,656.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	746,000	30.05	22,417,300.00	
	WAN HAI LINES LTD	322,845	70.50	22,760,572.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	791,000	64.20	50,782,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	668,413	37.65	25,165,749.45	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	80,728	474.00	38,265,072.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	180,981	193.00	34,929,333.00	

GIANT MANUFACTURING	152,000	176.00	26,752,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	78,000	334.50	26,091,000.00	
POU CHEN	1,066,500	30.70	32,741,550.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	131,000	626.00	82,006,000.00	
MOMO.COM INC	29,600	891.00	26,373,600.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	256,000	271.00	69,376,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	2,076,624	70.40	146,194,329.60	
PHARMAESSENTIA CORP	80,000	439.50	35,160,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,148,671	17.20	36,957,141.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	7,943,955	21.40	170,000,637.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	5,841,236	24.70	144,278,529.20	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	4,719,164	26.35	124,349,971.40	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	4,028,109	22.10	89,021,208.90	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	4,953,047	33.10	163,945,855.70	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	4,876,888	16.40	79,980,963.20	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	4,934,995	16.50	81,427,417.50	
TAIWAN BUSINESS BANK	2,977,000	13.20	39,296,400.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	4,436,355	26.15	116,010,683.25	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	1,665,000	46.70	77,755,500.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	643,270	232.00	149,238,640.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	4,477,219	22.20	99,394,261.80	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	3,813,366	41.30	157,492,015.80	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	6,416,255	12.40	79,561,562.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	3,319,959	56.30	186,913,691.70	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	5,808,852	8.30	48,213,471.60	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	230,000	315.50	72,565,000.00	
ACER INC	1,364,168	28.00	38,196,704.00	
ADVANTECH CO LTD	213,134	380.00	80,990,920.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	323,774	270.00	87,418,980.00	
AUO CORP	3,377,800	18.50	62,489,300.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	293,000	189.50	55,523,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	2,006,775	24.70	49,567,342.50	
DELTA ELECTRONICS INC	870,220	300.50	261,501,110.00	
E INK HOLDINGS INC	383,000	184.00	70,472,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	5,575,272	105.50	588,191,196.00	
INNOLUX CORP	3,960,381	14.50	57,425,524.50	

	INVENTEC CORP	1,291,429	30.75	39,711,441.75	
	LARGAN PRECISION CO LTD	44,820	2,300.00	103,086,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,029,160	72.30	74,408,268.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	345,000	144.00	49,680,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	82,000	286.50	23,493,000.00	
	PEGATRON CORP	917,976	69.90	64,166,522.40	
	QUANTA COMPUTER INC	1,221,150	87.50	106,850,625.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	631,193	61.80	39,007,727.40	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	571,000	148.00	84,508,000.00	
	WIWYNN CORP	42,000	1,105.00	46,410,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	658,168	48.70	32,052,781.60	
	YAGEO CORPORATION	160,738	527.00	84,708,926.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	270,000	110.50	29,835,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,652,000	119.50	197,414,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	744,000	73.90	54,981,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	780,400	100.50	78,430,200.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,482,294	111.00	164,534,634.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	29,000	1,960.00	56,840,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	101,000	525.00	53,025,000.00	
	MEDIATEK INC	686,236	790.00	542,126,440.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	585,000	63.30	37,030,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	257,000	436.50	112,180,500.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	47,000	1,110.00	52,170,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	1,236,000	34.40	42,518,400.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	210,703	396.00	83,438,388.00	
	SILERGY CORP	148,000	512.00	75,776,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	11,097,000	539.00	5,981,283,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	5,359,000	53.10	284,562,900.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	374,000	98.50	36,839,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	164,000	179.50	29,438,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	1,438,000	25.55	36,740,900.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	961,268	35.85	34,461,457.80	
	ニュー台湾ドル 小計	153,002,243		13,775,436,279.95 (59,344,579,494)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	361,468	345.40	124,851,047.20	
	COAL INDIA LTD	645,260	208.45	134,504,447.00	

HINDUSTAN PETROLEUM CORP	281,412	238.85	67,215,256.20
INDIAN OIL CORP LTD	1,200,931	78.40	94,152,990.40
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,149,442	149.40	171,726,634.80
PETRONET LNG LTD	330,086	223.90	73,906,255.40
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,369,298	2,203.30	3,016,974,283.40
ACC LTD	29,062	1,700.85	49,430,102.70
AMBUJA CEMENTS LTD	287,173	371.80	106,770,921.40
ASIAN PAINTS LTD	168,006	2,798.50	470,164,791.00
BERGER PAINTS INDIA LTD	102,972	573.70	59,075,036.40
GRASIM INDUSTRIES LTD	112,199	1,594.30	178,878,865.70
HINDALCO INDUSTRIES LTD	632,730	388.40	245,752,332.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	179,644	534.10	95,947,860.40
JSW STEEL LTD	326,622	657.80	214,851,951.60
PI INDUSTRIES LTD	35,931	2,934.10	105,425,147.10
PIDILITE INDUSTRIES LTD	70,349	2,364.55	166,343,727.95
SHREE CEMENT LTD	4,903	25,511.65	125,083,619.95
SRF LTD	68,000	2,381.45	161,938,600.00
TATA STEEL LTD	3,191,999	102.10	325,903,097.90
ULTRATECH CEMENT LTD	46,568	7,405.65	344,866,309.20
UPL LTD	227,928	696.90	158,843,023.20
VEDANTA LTD	364,582	269.75	98,345,994.50
ABB INDIA LTD	24,900	3,346.70	83,332,830.00
ADANI ENTERPRISES LTD	72,881	1,740.65	126,860,312.65
BHARAT ELECTRONICS LTD	1,669,456	91.55	152,838,696.80
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	262,989	288.75	75,938,073.75
HAVELLS INDIA LTD	103,125	1,181.45	121,837,031.25
LARSEN & TOUBRO LTD	307,894	2,166.15	666,944,588.10
SIEMENS LTD	29,493	3,333.45	98,313,440.85
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	91,600	600.05	54,964,580.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	242,722	638.00	154,856,636.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	131,294	583.25	76,577,225.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	39,111	1,865.20	72,949,837.20
BAJAJ AUTO LTD	30,404	3,827.90	116,383,471.60
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	38,519	1,967.65	75,791,910.35
BHARAT FORGE LTD	117,494	764.80	89,859,411.20
EICHER MOTORS LTD	63,410	2,909.60	184,497,736.00

HERO MOTOCORP LTD	50, 721	2, 313. 35	117, 335, 425. 35
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	393, 559	1, 150. 80	452, 907, 697. 20
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	54, 595	8, 242. 90	450, 021, 125. 50
MRF LTD	969	83, 878. 50	81, 278, 266. 50
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	967, 001	64. 75	62, 613, 314. 75
TATA MOTORS LTD	767, 605	416. 50	319, 707, 482. 50
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	45, 400	2, 551. 40	115, 833, 560. 00
TVS MOTOR CO LTD	98, 759	1, 042. 00	102, 906, 878. 00
PAGE INDUSTRIES LTD	2, 494	37, 115. 25	92, 565, 433. 50
TITAN CO LTD	159, 871	2, 493. 35	398, 614, 357. 85
INDIAN HOTELS CO LTD	372, 300	310. 45	115, 580, 535. 00
JUBILANT FOODWORKS LTD	184, 460	440. 95	81, 337, 637. 00
ZOMATO LTD	1, 745, 700	50. 65	88, 419, 705. 00
INFO EDGE INDIA LTD	37, 381	3, 475. 60	129, 921, 403. 60
TRENT LTD	81, 716	1, 310. 05	107, 052, 045. 80
AVENUE SUPERMARTS LTD	74, 427	3, 358. 40	249, 955, 636. 80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	49, 279	4, 199. 95	206, 969, 336. 05
ITC LTD	1, 324, 450	378. 70	501, 569, 215. 00
MARICO LTD	250, 392	477. 20	119, 487, 062. 40
NESTLE INDIA LTD	15, 270	18, 953. 10	289, 413, 837. 00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	252, 504	702. 35	177, 346, 184. 40
UNITED SPIRITS LTD	139, 825	763. 75	106, 791, 343. 75
VARUN BEVERAGES LTD	100, 994	1, 352. 00	136, 543, 888. 00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	49, 765	1, 500. 95	74, 694, 776. 75
DABUR INDIA LTD	287, 435	536. 40	154, 180, 134. 00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	175, 156	951. 20	166, 608, 387. 20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	369, 181	2, 480. 80	915, 864, 224. 80
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	45, 957	4, 283. 35	196, 849, 915. 95
AUROBINDO PHARMA LTD	104, 437	500. 45	52, 265, 496. 65
CIPLA LTD	224, 891	877. 25	197, 285, 629. 75
DIVI'S LABORATORIES LTD	61, 659	2, 807. 00	173, 076, 813. 00
DR. REDDY'S LABORATORIES	55, 825	4, 464. 15	249, 211, 173. 75
LUPIN LTD	81, 026	640. 00	51, 856, 640. 00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	419, 017	972. 85	407, 640, 688. 45
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	44, 978	1, 517. 90	68, 272, 106. 20
AU SMALL FINANCE BANK LTD	80, 800	559. 90	45, 239, 920. 00

AXIS BANK LTD	1, 026, 064	839. 90	861, 791, 153. 60
BANDHAN BANK LTD	266, 045	203. 10	54, 033, 739. 50
BANK OF BARODA	485, 008	159. 80	77, 504, 278. 40
ICICI BANK LTD	2, 319, 017	852. 40	1, 976, 730, 090. 80
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	244, 225	1, 692. 15	413, 265, 333. 75
STATE BANK OF INDIA	801, 640	505. 35	405, 108, 774. 00
YES BANK LTD	5, 386, 868	15. 05	81, 072, 363. 40
BAJAJ FINANCE LTD	120, 222	5, 649. 25	679, 164, 133. 50
BAJAJ FINSERV LTD	179, 095	1, 240. 65	222, 194, 211. 75
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	11, 900	6, 034. 25	71, 807, 575. 00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	189, 900	727. 65	138, 180, 735. 00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	777, 545	2, 559. 90	1, 990, 437, 445. 50
MUTHOOT FINANCE LTD	48, 400	962. 35	46, 577, 740. 00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	112, 700	723. 55	81, 544, 085. 00
SHRIRAM FINANCE LTD	96, 620	1, 233. 20	119, 151, 784. 00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	438, 309	492. 25	215, 757, 605. 25
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	111, 710	1, 076. 40	120, 244, 644. 00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	141, 318	420. 25	59, 388, 889. 50
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	204, 214	1, 112. 20	227, 126, 810. 80
HCL TECHNOLOGIES LTD	427, 883	1, 051. 75	450, 025, 945. 25
INFOSYS LTD	1, 515, 686	1, 380. 65	2, 092, 631, 875. 90
LTIMINDTREE LTD	37, 310	4, 601. 45	171, 680, 099. 50
MPHASIS LTD	51, 526	1, 737. 40	89, 521, 272. 40
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	410, 425	3, 120. 50	1, 280, 731, 212. 50
TATA ELXSI LTD	15, 900	6, 000. 70	95, 411, 130. 00
TECH MAHINDRA LTD	273, 157	1, 101. 95	301, 005, 356. 15
WIPRO LTD	623, 940	361. 75	225, 710, 295. 00
BHARTI AIRTEL LTD	999, 819	762. 45	762, 311, 996. 55
INDUS TOWERS LTD	270, 878	148. 05	40, 103, 487. 90
ADANI GREEN ENERGY LTD	130, 888	1, 029. 35	134, 729, 562. 80
ADANI POWER LTD	283, 920	192. 60	54, 682, 992. 00
ADANI TOTAL GAS LTD	123, 984	1, 007. 45	124, 907, 680. 80
ADANI TRANSMISSION LTD	112, 086	1, 124. 55	126, 046, 311. 30
GAIL INDIA LTD	1, 070, 325	103. 50	110, 778, 637. 50
INDRAPRASTHA GAS LTD	135, 251	432. 20	58, 455, 482. 20
NTPC LTD	1, 741, 406	172. 70	300, 740, 816. 20



	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,468,872	222.40	326,677,132.80	
	TATA POWER CO LTD	654,389	192.75	126,133,479.75	
	DLF LTD	281,804	354.25	99,829,067.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	51,331	1,044.85	53,633,195.35	
	インドルピー 小計	47,223,236		30,866,943,775.70 (49,387,110,041)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	32,083	675.00	21,656,025.00	
	MONETA MONEY BANK AS	145,308	81.80	11,886,194.40	
	CEZ AS	75,016	1,002.00	75,166,032.00	
	チェココルナ 小計	252,407		108,708,251.40 (646,020,525)	
クウェートディナール	AGILITY	682,614	0.61	417,077.15	
	BOUBYAN BANK K. S. C	574,856	0.64	370,782.12	
	GULF BANK	816,898	0.29	236,900.42	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	3,286,291	0.82	2,711,190.07	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	3,212,024	1.05	3,385,473.29	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	1,118,010	0.53	601,489.38	
	MABANEE CO KPSC	293,245	0.74	217,001.30	
	クウェートディナール 小計	9,983,938		7,939,913.73 (3,382,323,849)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	114,754	34,000.00	3,901,636,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	190,643	27,310.00	5,206,460,330.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	241,634	15,400.00	3,721,163,600.00	
	コロンビアペソ 小計	547,031		12,829,259,930.00 (354,356,988)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	189,718	2,474.00	469,362,332.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	65,222	7,465.00	486,882,230.00	
	OTP BANK PLC	101,228	9,844.00	996,488,432.00	
	ハンガリーフォリント 小計	356,168		1,952,732,994.00 (714,600,686)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	1,427,401	3.38	4,824,615.38	
	Q HOLDING PJSC	866,439	2.31	2,001,474.09	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	1,323,475	4.18	5,532,125.50	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	1,229,769	8.54	10,502,227.26	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	703,542	9.59	6,746,967.78	
	DUBAI ISLAMIC BANK	1,437,129	5.21	7,487,442.09	

	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,967,479	13.00	25,577,227.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,566,867	23.70	37,134,747.90	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	1,767,691	4.56	8,060,670.96	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	2,813,969	5.43	15,279,851.67	
	アラブディルハム 小計	15,103,761		123,147,349.63 (4,388,971,540)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	296,514	56.26	16,681,877.64	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	66,455	114.95	7,639,002.25	
	LPP SA	460	9,340.00	4,296,400.00	
	CD PROJEKT SA	39,305	110.60	4,347,133.00	
	CYFROWY POLSAT SA	84,090	15.79	1,327,781.10	
	ALLEGRO. EU SA	145,456	26.01	3,784,037.84	
	PEPCO GROUP NV	65,200	41.34	2,695,368.00	
	DINO POLSKA SA	22,170	387.20	8,584,224.00	
	BANK PEKAO SA	84,233	78.90	6,645,983.70	
	MBANK SA	5,779	274.20	1,584,601.80	
	PKO BANK POLSKI SA	400,856	26.72	10,710,872.32	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	13,971	271.20	3,788,935.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	272,464	32.00	8,718,848.00	
	PGE SA	422,950	6.05	2,561,385.20	
	ポーランドズロチ 小計	1,919,903		83,366,450.05 (2,501,552,056)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	101,347	180.34	18,276,917.98	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	64,622	243.22	15,717,362.84	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	22,359	995.34	22,254,807.06	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	187,277	402.70	75,416,447.90	
	GOLD FIELDS LTD	401,399	231.23	92,815,490.77	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	193,027	74.73	14,424,907.71	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	377,694	166.86	63,022,020.84	
	KUMBA IRON ORE LTD	23,695	427.78	10,136,247.10	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	166,313	146.00	24,281,698.00	
	SASOL LTD	258,360	228.62	59,066,263.20	
	SIBANYE STILLWATER LTD	1,293,222	36.93	47,758,688.46	
	BIDVEST GROUP LTD	133,425	258.07	34,432,989.75	
	MULTICHOICE GROUP LTD	209,009	120.06	25,093,620.54	
	MR PRICE GROUP LTD	101,919	140.00	14,268,660.00	

	NASPERS LTD-N SHS	97,828	3,330.00	325,767,240.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	881,388	17.20	15,159,873.60	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	131,787	88.46	11,657,878.02	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	403,060	64.78	26,110,226.80	
	BID CORP LTD	152,607	390.28	59,559,459.96	
	CLICKS GROUP LTD	114,421	253.95	29,057,212.95	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	224,766	216.50	48,661,839.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	177,683	180.45	32,062,897.35	
	ABSA GROUP LTD	385,108	177.08	68,194,924.64	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	39,861	1,615.81	64,407,802.41	
	NEDBANK GROUP LTD	221,373	207.70	45,979,172.10	
	STANDARD BANK GROUP LTD	608,745	167.67	102,068,274.15	
	FIRSTRAND LTD	2,280,072	61.02	139,129,993.44	
	REINET INVESTMENTS SCA	64,885	362.13	23,496,805.05	
	REMGRO LTD	232,196	129.84	30,148,328.64	
	DISCOVERY LTD	213,552	136.98	29,252,352.96	
	OLD MUTUAL LTD	2,345,236	11.04	25,891,405.44	
	OUTSURANCE GROUP LTD	394,727	33.90	13,381,245.30	
	SANLAM LTD	756,539	54.73	41,405,379.47	
	MTN GROUP LTD	768,619	125.63	96,561,604.97	
	VODACOM GROUP LTD	268,705	124.14	33,357,038.70	
	NEPI ROCKCASTLE N. V.	207,413	103.86	21,541,914.18	
	南アフリカランド 小計	14,504,239		1,799,818,991.28 (12,922,700,357)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	176,500	6.99	1,233,735.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	724,325	5.52	3,998,274.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	155,628	28.98	4,510,099.44	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	124,900	13.66	1,706,134.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	235,000	9.08	2,133,800.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	5.95	249,900.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	932,100	5.64	5,257,044.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	289,500	19.21	5,561,295.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	148,000	13.50	1,998,000.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	142,970	10.73	1,534,068.10	
	SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	100,900	20.37	2,055,333.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	100,055	31.35	3,136,724.25	

YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	26.97	245,427.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	350,000	5.62	1,967,000.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	79,700	28.95	2,307,315.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	681,496	6.34	4,320,684.64	
BBMG CORPORATION-A	79,100	2.54	200,914.00	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	15,800	52.65	831,870.00	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	27,200	35.86	975,392.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	110,447	14.84	1,639,033.48	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	123,100	26.14	3,217,834.00	
CHINA RARE EARTH RESOURCES-A	32,500	34.10	1,108,250.00	
CMOC GROUP LTD-A	515,101	5.89	3,033,944.89	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	9,100	70.69	643,279.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	102,531	67.54	6,924,943.74	
GEM CO LTD-A	131,700	7.58	998,286.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	39,780	40.99	1,630,582.20	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	257,100	15.86	4,077,606.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	35,148	7.70	270,639.60	
HESTEEL CO LTD-A	100,800	2.36	237,888.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	27,200	83.11	2,260,592.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	106,636	7.42	791,239.12	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	12,900	16.14	208,206.00	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A	38,600	30.36	1,171,896.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	185,200	5.48	1,014,896.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	951,300	1.92	1,826,496.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	482,916	4.41	2,129,659.56	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	72,300	13.49	975,327.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	2,900	99.62	288,898.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	99,100	19.31	1,913,621.00	
LB GROUP CO LTD-A	59,600	19.65	1,171,140.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	41,100	17.50	719,250.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	319,800	14.73	4,710,654.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	81,700	5.05	412,585.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	118,300	22.75	2,691,325.00	
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	325,971	11.98	3,905,132.58	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	84,740	15.87	1,344,823.80	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	90,424	21.81	1,972,147.44	

SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	49,850	32.98	1,644,053.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	336,100	3.49	1,172,989.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	24,600	12.29	302,334.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	24,080	48.50	1,167,880.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	145,500	8.97	1,305,135.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	145,000	4.41	639,450.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	20,880	48.86	1,020,196.80
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	11,900	196.99	2,344,181.00
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A	17,980	19.74	354,925.20
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A	12,000	21.71	260,520.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	47,100	24.89	1,172,319.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	58,100	3.36	195,216.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,660	116.64	1,126,742.40
TIANQI LITHIUM CORP-A	32,200	76.14	2,451,708.00
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A	100,000	7.95	795,000.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	60,900	13.88	845,292.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	510,800	3.29	1,680,532.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	87,500	95.60	8,365,000.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	4,900	59.88	293,412.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,600	81.46	1,352,236.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	20.75	278,050.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	26,460	13.11	346,890.60
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	11,200	86.00	963,200.00
YOUNGY CO LTD-A	10,000	87.98	879,800.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	34,651	110.49	3,828,588.99
YUNNAN YUNTIANHUA CO-A	40,000	21.23	849,200.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	34,400	25.08	862,752.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	55,015	56.07	3,084,691.05
ZHEJIANG JUHUA CO-A	107,700	16.76	1,805,052.00
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	25,300	21.30	538,890.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	822,400	12.01	9,877,024.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	78,931	24.98	1,971,696.38
AECC AVIATION POWER CO-A	79,200	45.76	3,624,192.00
AVICOPTER PLC-A	37,400	46.09	1,723,766.00
BEIJING EASPRING MATERIAL-A	14,200	57.42	815,364.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	66,800	27.70	1,850,360.00

BEIJING UNITED INFORMATION-A	17,255	84.29	1,454,423.95
CHINA BAOAN GROUP-A	49,260	11.71	576,834.60
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	73,000	24.20	1,766,600.00
CHINA ENERGY ENGINEERING C-A	543,500	2.47	1,342,445.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	98,000	10.53	1,031,940.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	870,900	7.35	6,401,115.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	1,305,480	5.92	7,728,441.60
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	64,708	393.58	25,467,774.64
CRRC CORP LTD-A	1,139,000	5.97	6,799,830.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	144,760	18.75	2,714,250.00
EVE ENERGY CO LTD-A	67,288	68.13	4,584,331.44
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	36,143	6.53	236,013.79
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	9,750	135.85	1,324,537.50
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	35,700	30.12	1,075,284.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	7,800	83.13	648,414.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	9,940	33.78	335,773.20
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	26,032	62.74	1,633,247.68
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	103,700	18.08	1,874,896.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	47,400	17.23	816,702.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	527,534	3.80	2,004,629.20
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	47,900	22.53	1,079,187.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	227,008	27.58	6,260,880.64
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	4,000	257.44	1,029,760.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	24,000	48.10	1,154,400.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	8,300	72.53	601,999.00
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	49,900	23.15	1,155,185.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	512,700	7.47	3,829,869.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,400	234.50	797,300.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	340,616	16.94	5,770,035.04
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	2.79	235,755.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	407,700	4.51	1,838,727.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	91,551	69.10	6,326,174.10
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	132,600	12.96	1,718,496.00
SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	12,000	45.85	550,200.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	38,400	101.40	3,893,760.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	37,600	20.21	759,896.00

SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	3,520	305.37	1,074,902.40
TBEA CO LTD-A	81,400	21.48	1,748,472.00
TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A	12,000	13.79	165,480.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	413,651	11.55	4,777,669.05
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	9,240	98.24	907,737.60
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	363,600	6.49	2,359,764.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	11.88	319,572.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	129,800	11.14	1,445,972.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	36,000	27.72	997,920.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	53.72	248,186.40
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	12,000	46.73	560,760.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	15,000	24.10	361,500.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,500	10.65	963,825.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	143,900	6.23	896,497.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8,800	48.96	430,848.00
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A	58,110	18.59	1,080,264.90
AIR CHINA LTD-A	287,800	10.28	2,958,584.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	547,400	5.24	2,868,376.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	444,100	7.48	3,321,868.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	469,130	11.35	5,324,625.50
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	874,000	7.28	6,362,720.00
LIAONING PORT CO LTD-A	2,697,000	1.63	4,396,110.00
S F HOLDING CO LTD-A	142,200	53.73	7,640,406.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	38,100	54.83	2,089,023.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	139,900	5.55	776,445.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	75,200	18.22	1,370,144.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	78,060	12.09	943,745.40
BYD CO LTD -A	48,000	246.02	11,808,960.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,600	126.70	329,420.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	274,190	11.77	3,227,216.30
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	73,700	8.28	610,236.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	46,838	34.39	1,610,758.82
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	164,354	27.03	4,442,488.62
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	348,900	11.06	3,858,834.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	68,200	16.79	1,145,078.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	12,000	111.95	1,343,400.00

NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	14.82	183,175.20
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	51,300	57.66	2,957,958.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	159,244	14.26	2,270,819.44
SAILUN GROUP CO LTD-A	107,100	10.68	1,143,828.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	11,400	19.78	225,492.00
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A	8,700	124.05	1,079,235.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	11,400	86.49	985,986.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	199,753	36.86	7,362,895.58
HAIER SMART HOME CO LTD-A	208,929	23.48	4,905,652.92
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	28.64	257,760.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	16,120	41.80	673,816.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	12,917	127.91	1,652,213.47
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	310,000	4.60	1,426,000.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	56.29	292,708.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	27,000	58.38	1,576,260.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	268,100	4.84	1,297,604.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	15.68	389,538.24
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	75,300	28.07	2,113,671.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	9.38	261,702.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	280,502	6.65	1,865,338.30
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	700	434.34	304,038.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	25,280	38.09	962,915.20
PERFECT WORLD CO LTD-A	18,300	16.91	309,453.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	126,520	5.30	670,556.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	48,899	186.32	9,110,861.68
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	8.09	249,172.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.89	235,698.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	16,420	35.83	588,328.60
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	6,552	57.51	376,805.52
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	40.08	312,624.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	10,200	275.70	2,812,140.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5,625	68.39	384,693.75
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	21,800	66.46	1,448,828.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	5,900	160.71	948,189.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	7.91	318,773.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	234,000	13.32	3,116,880.00



CHONGQING BREWERY CO-A	16,080	116.39	1,871,551.20
CHONGQING FULING ZHACAI-A	7,500	25.12	188,400.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	91,778	74.94	6,877,843.32
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	23.06	225,988.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	49,519	58.65	2,904,289.35
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	118,600	14.22	1,686,492.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	87,500	25.38	2,220,750.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	161,700	29.13	4,710,321.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	32,590	62.15	2,025,468.50
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	44,981	163.65	7,361,140.65
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	3,600	128.63	463,068.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	37.58	285,608.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	5,500	44.26	243,430.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	34,053	1,778.62	60,567,346.86
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	37,800	245.65	9,285,570.00
MUYUAN FOODS CO LTD-A	190,980	47.49	9,069,640.20
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	59,400	12.91	766,854.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	24,705	38.16	942,742.80
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	34,060	273.60	9,318,816.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	12,600	75.93	956,718.00
TOLY BREAD CO LTD-A	10,192	15.25	155,428.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	40,761	112.31	4,577,867.91
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	261,140	19.42	5,071,338.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	107,100	193.02	20,672,442.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	23,700	43.67	1,034,979.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	12,500	16.79	209,875.00
BY-HEALTH CO LTD-A	15,000	20.00	300,000.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	6,300	177.36	1,117,368.00
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A	9,700	116.82	1,133,154.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	212,910	30.50	6,493,755.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	128,900	31.02	3,998,478.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	84.68	372,592.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	57,140	43.60	2,491,304.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	7,600	30.74	233,624.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	64,300	30.19	1,941,217.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	17,800	15.00	267,000.00

LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	95,160	23.00	2,188,680.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	6.80	241,808.00
OVCTEK CHINA INC-A	17,260	32.87	567,336.20
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	183,900	20.09	3,694,551.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	38,300	304.00	11,643,200.00
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A	10,000	56.54	565,400.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	7,000	131.66	921,620.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	15,000	21.85	327,750.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,640	137.87	501,846.80
BEIJING TONGRENTANG CO-A	29,900	49.58	1,482,442.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	9,860	118.79	1,171,269.40
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3,800	54.94	208,772.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	17,000	63.19	1,074,230.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	8,700	167.37	1,456,119.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	36,000	51.29	1,846,440.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	60,198	86.75	5,222,176.50
DAAN GENE CO LTD-A	19,360	15.77	305,307.20
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	6,200	45.30	280,860.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	106.18	752,710.02
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	54,190	22.11	1,198,140.90
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	29,900	24.78	740,922.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	8,100	520.18	4,213,458.00
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A	234,143	41.70	9,763,763.10
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	12.74	234,416.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	14,840	53.85	799,134.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	34.80	201,840.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	12,522	15.59	195,217.98
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	18,750	57.78	1,083,375.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	10,780	19.47	209,886.60
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	48,600	32.16	1,562,976.00
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	24,600	49.20	1,210,320.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	240,500	6.23	1,498,315.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	15,425	32.41	499,924.25
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	8,200	34.71	284,622.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	16,100	28.07	451,927.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	13,600	26.68	362,848.00

WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	32,480	36.33	1,179,998.40
WUXI APPTec CO LTD-A	116,211	80.14	9,313,149.54
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	80,260	53.24	4,273,042.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	19,300	281.22	5,427,546.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	13,860	19.64	272,210.40
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	25,700	36.89	948,073.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	85,176	17.79	1,515,281.04
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	5,000	49.30	246,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	2,234,800	3.05	6,816,140.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	346,600	4.41	1,528,506.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	137,793	13.44	1,851,937.92
BANK OF CHINA LTD-A	772,400	3.40	2,626,160.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	792,233	5.11	4,048,310.63
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	151,000	11.76	1,775,760.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	324,350	7.06	2,289,911.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	321,500	9.12	2,932,080.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	236,111	27.71	6,542,635.81
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	543,311	6.06	3,292,464.66
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	91,200	5.99	546,288.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	956,010	3.15	3,011,431.50
CHINA MERCHANTS BANK-A	565,699	34.43	19,477,016.57
CHINA MINSHENG BANKING-A	746,028	3.44	2,566,336.32
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	241,200	2.87	692,244.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	56,500	3.65	206,225.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	198,750	5.40	1,073,250.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	1,647,428	4.48	7,380,477.44
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	582,874	16.78	9,780,625.72
PING AN BANK CO LTD-A	679,061	12.82	8,705,562.02
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	526,500	4.68	2,464,020.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	884,337	7.21	6,376,069.77
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	749,400	5.85	4,383,990.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	461,900	4.15	1,916,885.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	452,855	7.58	3,432,640.90
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	644,434	5.58	3,595,941.72
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	70,200	10.36	727,272.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	8.43	488,940.00

CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A	32,692	39.63	1,295,583.96
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	159,900	14.03	2,243,397.00
CITIC SECURITIES CO-A	397,445	20.52	8,155,571.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	192,700	26.34	5,075,718.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	8.51	222,962.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	435,279	20.24	8,810,046.96
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	101,600	15.18	1,542,288.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	97,100	6.03	585,513.00
GF SECURITIES CO LTD-A	281,900	15.71	4,428,649.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	110,261	6.64	732,133.04
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	51,600	11.04	569,664.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	419,100	9.52	3,989,832.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	173,625	14.43	2,505,408.75
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	6.80	216,920.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	242,979	8.82	2,143,074.78
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	13,530	176.26	2,384,797.80
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	115,240	12.62	1,454,328.80
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	24,900	8.27	205,923.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	180,700	6.18	1,116,726.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	139,500	9.82	1,369,890.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	40,000	3.45	138,000.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	26,900	5.87	157,903.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	1,048,114	4.22	4,423,041.08
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	28,500	6.93	197,505.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	3.95	212,115.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	247,600	6.43	1,592,068.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	74,000	10.20	754,800.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	132,200	6.70	885,740.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	85,400	33.77	2,883,958.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	212,000	26.29	5,573,480.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	31,386	29.75	933,733.50
PICC HOLDING CO-A	1,251,900	5.32	6,660,108.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	290,422	46.20	13,417,496.40
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	319,600	16.78	5,362,888.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	17,500	392.00	6,860,000.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	16,464	18.29	301,126.56

DHC SOFTWARE CO LTD -A	281,500	7.19	2,023,985.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	50,398	47.40	2,388,865.20
IFLYTEK CO LTD - A	48,285	60.02	2,898,065.70
NAVINFO CO LTD-A	18,600	14.33	266,538.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	8,500	137.12	1,165,520.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	35,230	55.80	1,965,834.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	12,400	115.50	1,432,200.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	87,015	25.99	2,261,519.85
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	36,700	33.36	1,224,312.00
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	8,200	79.25	649,850.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,709,200	4.49	7,674,308.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	26,600	36.92	982,072.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	48,197	29.92	1,442,054.24
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	164,000	14.33	2,350,120.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	296,998	5.48	1,627,549.04
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	13,700	93.02	1,274,374.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	222,100	17.66	3,922,286.00
GOERTEK INC -A	71,400	22.49	1,605,786.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	166,500	11.98	1,994,670.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	21,800	10.56	230,208.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	8,400	82.15	690,060.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	54,900	40.20	2,206,980.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	109,400	13.88	1,518,472.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	217,700	6.25	1,360,625.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	210,512	31.30	6,589,025.60
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	10,752	122.57	1,317,872.64
NINESTAR CORP-A	39,700	46.40	1,842,080.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	21,600	19.85	428,760.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,480	96.36	431,692.80
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	12,000	109.15	1,309,800.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	72,200	29.79	2,150,838.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	9,000	32.84	295,560.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	111,100	10.94	1,215,434.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	110,648	31.63	3,499,796.24
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	25,000	56.58	1,414,500.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	120,794	12.60	1,522,004.40

WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	18,040	21.60	389,664.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	6,300	146.35	922,005.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	22,450	81.44	1,828,328.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	75,700	22.48	1,701,736.00
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY-A	35,500	100.01	3,550,355.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	5,700	52.23	297,711.00
ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A	10,000	46.41	464,100.00
ZTE CORP-A	81,600	35.39	2,887,824.00
CHINA UNITED NETWORK-A	1,185,800	5.50	6,521,900.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	240,000	6.56	1,574,400.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	661,300	5.53	3,656,989.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	608,240	20.78	12,639,227.20
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	73,600	18.72	1,377,792.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	570,400	3.74	2,133,296.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	64,400	5.77	371,588.00
HUANENG POWER INTL INC-A	324,300	8.69	2,818,167.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	37,560	6.24	234,374.40
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	180,400	13.11	2,365,044.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	9,900	128.14	1,268,586.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,000	61.76	1,296,960.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	101,300	32.90	3,332,770.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A	13,556	117.90	1,598,252.40
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	44,516	58.35	2,597,508.60
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	33,200	36.37	1,207,484.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	10,100	85.43	862,843.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	103,200	55.96	5,775,072.00
JCET GROUP CO LTD-A	47,200	33.40	1,576,480.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	207,189	40.05	8,297,919.45
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	18,400	70.17	1,291,128.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	20,900	259.01	5,413,309.00
SG MICRO CORP-A	6,075	154.60	939,195.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	8,600	111.20	956,320.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,500	275.00	962,500.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	131,600	45.15	5,941,740.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	201,300	10.24	2,061,312.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	24.79	721,389.00

	TONGWEI CO LTD-A	109,600	39.05	4,279,880.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	56,200	51.91	2,917,342.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	18,199	112.30	2,043,747.70	
	WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A	55,915	93.85	5,247,622.75	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	29,700	62.19	1,847,043.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	242,622	13.48	3,270,544.56	
	CHINA VANKE CO LTD -A	194,956	15.81	3,082,254.36	
	GEMDALE CORP-A	42,900	8.67	371,943.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	357,000	14.34	5,119,380.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	58,700	17.36	1,019,032.00	
	SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	160,740	13.22	2,124,982.80	
	YOUNGOR GROUP CO-A	106,400	6.56	697,984.00	
	オフショア元 小計	67,512,208		1,061,104,368.79 (20,181,143,990)	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	202,319	10.02	2,027,236.38	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	1,063,148	32.15	34,180,208.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	57,072	46.50	2,653,848.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	122,759	11.96	1,468,197.64	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	98,800	139.40	13,772,720.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	167,519	36.10	6,047,435.90	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	383,909	63.60	24,416,612.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	403,621	90.30	36,446,976.30	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	194,677	23.60	4,594,377.20	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	362,675	11.58	4,199,776.50	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	104,973	41.55	4,361,628.15	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	15,573	193.00	3,005,589.00	
	JARIR MARKETING CO	24,000	160.00	3,840,000.00	
	NAHDI MEDICAL CO	18,802	173.40	3,260,266.80	
	ALMARAI CO	103,694	54.70	5,672,061.80	
	SAVOLA	104,437	27.00	2,819,799.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	17,729	142.00	2,517,518.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	38,669	262.00	10,131,278.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	19,343	216.80	4,193,562.40	
	AL RAJHI BANK	882,261	73.60	64,934,409.60	
	ALINMA BANK	452,830	29.65	13,426,409.50	
	ARAB NATIONAL BANK	280,049	26.65	7,463,305.85	

	BANK AL-JAZIRA	183,665	17.52	3,217,810.80	
	BANK ALBILAD	226,137	38.15	8,627,126.55	
	BANQUE SAUDI FRANSI	278,276	36.05	10,031,849.80	
	RIYAD BANK	613,578	30.00	18,407,340.00	
	SAUDI BRITISH BANK	415,939	34.75	14,453,880.25	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	205,040	16.00	3,280,640.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	989,194	45.60	45,107,246.40	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	22,457	141.00	3,166,437.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	34,678	163.00	5,652,514.00	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	10,771	249.60	2,688,441.60	
	ELM CO	10,228	423.20	4,328,489.60	
	ETIHAD ETISALAT CO	171,916	40.70	6,996,981.20	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	228,789	11.84	2,708,861.76	
	SAUDI TELECOM CO	673,338	40.00	26,933,520.00	
	ACWA POWER CO	36,473	138.00	5,033,274.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	375,918	23.10	8,683,705.80	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	248,669	15.24	3,789,715.56	
	EMAAR ECONOMIC CITY	162,006	7.55	1,223,145.30	
	サウジアラビアリアル 小計	10,005,931		429,764,196.24 (14,968,686,955)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	59,228	533.80	31,615,906.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	631,874	37.10	23,442,525.40	
	HEKTAS TICARET T. A. S	473,600	30.26	14,331,136.00	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	491,871	22.10	10,870,349.10	
	SASA POLYESTER SANAYI	189,000	106.50	20,128,500.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	318,713	56.30	17,943,541.90	
	KOC HOLDING AS	330,276	78.85	26,042,262.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	688,169	44.88	30,885,024.72	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	23,874	484.10	11,557,403.40	
	TURK HAVA YOLLARI AO	257,239	128.40	33,029,487.60	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	32,070	601.90	19,302,933.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	206,059	141.80	29,219,166.20	
	AKBANK T. A. S.	1,330,071	18.00	23,941,278.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	478,800	41.36	19,803,168.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,541,777	13.85	21,353,611.45	
	YAPI VE KREDI BANKASI	1,348,324	10.29	13,874,253.96	



	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	496,142	31.68	15,717,778.56
	トルコリラ 小計	8,897,087		363,058,326.29 (2,487,348,899)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	27,212	22.12	601,929.44
	MYTILINEOS S. A.	65,300	24.66	1,610,298.00
	FF GROUP	5,889	4.80	28,267.20
	OPAP SA	72,528	14.60	1,058,908.80
	JUMBO SA	66,836	18.67	1,247,828.12
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	974,172	1.09	1,061,847.48
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	1,015,188	1.19	1,208,073.72
	NATIONAL BANK OF GREECE	201,393	4.35	876,059.55
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	76,208	13.09	997,562.72
	PUBLIC POWER CORP	111,882	7.76	868,204.32
	TERNA ENERGY SA	32,000	18.40	588,800.00
	ユーロ 小計	2,648,608		10,147,779.35 (1,427,488,121)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	288,993	16.76	4,843,522.68
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	970,867	3.21	3,116,483.07
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,634,477	1.95	3,200,305.96
	INDUSTRIES QATAR	664,301	12.90	8,569,482.90
	COMMERCIAL BANK PSQC	1,369,997	5.86	8,028,182.42
	MASRAF AL RAYAN	2,468,651	2.59	6,401,212.04
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	429,709	9.72	4,176,771.48
	QATAR ISLAMIC BANK	710,327	18.12	12,871,125.24
	QATAR NATIONAL BANK	2,073,889	16.40	34,011,779.60
	OOREDOO QPSC	397,674	9.60	3,817,670.40
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	266,231	16.91	4,501,966.21
	BARWA REAL ESTATE CO	892,615	2.57	2,296,698.39
	カタールリアル 小計	12,167,731		95,835,200.39 (3,419,399,949)
	合 計	2,495,583,749		378,099,670,726 (378,099,670,726)

(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
メキシコペソ	投資証券	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	648,200	11,991,700.00	
		TRUST FIBRA UNO	1,521,600	37,507,440.00	
メキシコペソ合計			2,169,800	49,499,140.00 (350,884,553)	
南アフリカランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	1,670,736	21,552,494.40	
南アフリカランド合計			1,670,736	21,552,494.40 (154,746,909)	
合計				505,631,462 (505,631,462)	

(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 54 銘柄	100.00%	—	2.98%
香港ドル	株式 191 銘柄	100.00%	—	24.50%
マレーシアリングット	株式 34 銘柄	100.00%	—	1.45%
タイバーツ	株式 43 銘柄	100.00%	—	2.16%
フィリピンペソ	株式 16 銘柄	100.00%	—	0.73%
インドネシアルピア	株式 21 銘柄	100.00%	—	1.94%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	96.43%	—	2.50%
	投資証券 2 銘柄	—	3.57%	0.09%
ブラジルリアル	株式 47 銘柄	100.00%	—	4.66%
チリペソ	株式 12 銘柄	100.00%	—	0.54%
韓国ウォン	株式 103 銘柄	100.00%	—	11.88%
ニュー台湾ドル	株式 88 銘柄	100.00%	—	15.67%
インドルピー	株式 114 銘柄	100.00%	—	13.04%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.17%
クウェートディナール	株式 7 銘柄	100.00%	—	0.89%
コロンビアペソ	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.09%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.00%	—	0.19%
アラブディルハム	株式 10 銘柄	100.00%	—	1.16%
ポーランドズロチ	株式 14 銘柄	100.00%	—	0.66%
南アフリカランド	株式 36 銘柄	98.82%	—	3.41%
	投資証券 1 銘柄	—	1.18%	0.04%

オフショア元	株式	420 銘柄	100.00%	—	5.33%
サウジアラビアリアル	株式	40 銘柄	100.00%	—	3.95%
トルコリラ	株式	17 銘柄	100.00%	—	0.66%
ユーロ	株式	11 銘柄	100.00%	—	0.38%
カタールリアル	株式	12 銘柄	100.00%	—	0.90%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 国内債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

[令和5年3月27日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	813,782,475
国債証券	126,798,078,050
地方債証券	8,287,315,230
特殊債証券	7,727,163,856
社債証券	11,700,838,000
派生商品評価勘定	6,337,800
未収入金	166,448,800
未収利息	141,677,732
前払費用	30,214,002
差入委託証拠金	4,260,000
流動資産合計	155,676,115,945
資産合計	155,676,115,945
負債の部	
流動負債	
前受金	6,460,000
未払金	1,901,102,700
未払解約金	177,679,453
未払利息	271
流動負債合計	2,085,242,424
負債合計	2,085,242,424
純資産の部	
元本等	
元本	162,384,089,172
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△8,793,215,651
元本等合計	153,590,873,521
純資産合計	153,590,873,521

## 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)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 期首	令和 4 年 3 月 26 日
期首元本額	238,082,798,205 円
期中追加設定元本額	259,248,586,339 円
期中一部解約元本額	334,947,295,372 円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー（国内債券）	25,926,390,575 円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	31,969,900,828 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	254,853,988 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	8,463,166 円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	25,114,726 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	10,354,398,012 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	9,476,234,696 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,007,917,035 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	10,060,144,833 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	5,884,177,411 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）	28,489,433,261 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）	9,143,065,087 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）	26,970,512,782 円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	2,036,157,792 円
MUKAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	898,880 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）	776,426,100 円
合計	162,384,089,172 円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	8,793,215,651 円
3. 受益権の総数	162,384,089,172 円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 4 年 3 月 26 日 至 令和 5 年 3 月 27 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）

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、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。</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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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。</p>

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 5 年 3 月 27 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	[令和 5 年 3 月 27 日現在] 当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	70,066,370
地方債証券	△76,770,190
特殊債券	△84,027,111
社債券	△52,378,300
合計	△143,109,231

(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

[令和 5 年 3 月 27 日現在]

区分	種類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引				

買建	290,940,000	—	297,280,000	6,340,000
合計	290,940,000	—	297,280,000	6,340,000

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1口当たり純資産額	0.9458 円
(1万口当たり純資産額)	(9,458 円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第438回利付国債(2年)	400,000,000	400,628,000	
	第439回利付国債(2年)	2,310,000,000	2,313,557,400	
	第440回利付国債(2年)	300,000,000	300,471,000	
	第441回利付国債(2年)	720,000,000	721,144,800	
	第442回利付国債(2年)	1,680,000,000	1,682,805,600	
	第443回利付国債(2年)	370,000,000	370,651,200	
	第445回利付国債(2年)	1,370,000,000	1,372,274,200	
	第141回利付国債(5年)	460,000,000	461,361,600	
	第142回利付国債(5年)	503,000,000	504,700,140	
	第143回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,806,768,000	
	第144回利付国債(5年)	1,960,000,000	1,968,094,800	
	第145回利付国債(5年)	790,000,000	793,531,300	
	第146回利付国債(5年)	1,370,000,000	1,376,548,600	
	第147回利付国債(5年)	1,630,000,000	1,633,390,400	
	第148回利付国債(5年)	960,000,000	961,862,400	

第149回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,612,511,600	
第150回利付国債（5年）	1,400,000,000	1,401,302,000	
第151回利付国債（5年）	710,000,000	710,134,900	
第152回利付国債（5年）	1,500,000,000	1,505,955,000	
第153回利付国債（5年）	1,260,000,000	1,259,193,600	
第154回利付国債（5年）	2,450,000,000	2,456,566,000	
第155回利付国債（5年）	70,000,000	70,792,400	
第156回利付国債（5年）	350,000,000	352,226,000	
第1回利付国債（40年）	310,000,000	385,190,500	
第2回利付国債（40年）	220,000,000	263,047,400	
第3回利付国債（40年）	150,000,000	179,109,000	
第4回利付国債（40年）	70,000,000	83,697,600	
第5回利付国債（40年）	90,000,000	103,697,100	
第6回利付国債（40年）	271,000,000	305,086,380	
第7回利付国債（40年）	280,000,000	301,406,000	
第8回利付国債（40年）	330,000,000	329,633,700	
第9回利付国債（40年）	610,000,000	447,630,200	
第10回利付国債（40年）	600,000,000	515,490,000	
第11回利付国債（40年）	430,000,000	355,240,200	
第12回利付国債（40年）	451,000,000	332,405,040	
第13回利付国債（40年）	580,000,000	425,348,800	
第14回利付国債（40年）	650,000,000	507,006,500	
第15回利付国債（40年）	560,000,000	477,047,200	
第335回利付国債（10年）	370,000,000	373,293,000	
第336回利付国債（10年）	600,000,000	606,186,000	
第338回利付国債（10年）	400,000,000	403,880,000	
第339回利付国債（10年）	230,000,000	232,490,900	
第340回利付国債（10年）	750,000,000	758,947,500	
第341回利付国債（10年）	300,000,000	303,078,000	
第342回利付国債（10年）	110,000,000	110,541,200	
第343回利付国債（10年）	540,000,000	542,705,400	
第344回利付国債（10年）	770,000,000	773,757,600	
第345回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,356,048,000	
第346回利付国債（10年）	300,000,000	301,191,000	
第347回利付国債（10年）	940,000,000	943,177,200	
第349回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,202,256,000	

第350回利付国債（10年）	450,000,000	450,553,500	
第351回利付国債（10年）	950,000,000	950,741,000	
第352回利付国債（10年）	1,020,000,000	1,020,275,400	
第353回利付国債（10年）	1,243,000,000	1,242,639,530	
第354回利付国債（10年）	1,560,000,000	1,558,143,600	
第355回利付国債（10年）	860,000,000	858,400,400	
第356回利付国債（10年）	720,000,000	718,149,600	
第357回利付国債（10年）	1,620,000,000	1,614,589,200	
第358回利付国債（10年）	610,000,000	607,682,000	
第359回利付国債（10年）	890,000,000	885,229,600	
第360回利付国債（10年）	890,000,000	883,431,800	
第361回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,624,420,000	
第362回利付国債（10年）	1,910,000,000	1,888,321,500	
第363回利付国債（10年）	1,800,000,000	1,776,078,000	
第364回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,271,282,100	
第365回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,329,277,500	
第366回利付国債（10年）	130,000,000	129,314,900	
第368回利付国債（10年）	30,000,000	30,083,700	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	57,829,000	
第7回利付国債（30年）	50,000,000	58,979,500	
第10回利付国債（30年）	50,000,000	53,512,000	
第12回利付国債（30年）	100,000,000	117,102,000	
第14回利付国債（30年）	190,000,000	229,117,200	
第15回利付国債（30年）	100,000,000	121,849,000	
第16回利付国債（30年）	100,000,000	122,115,000	
第17回利付国債（30年）	250,000,000	302,802,500	
第18回利付国債（30年）	280,000,000	336,386,400	
第19回利付国債（30年）	100,000,000	120,329,000	
第22回利付国債（30年）	280,000,000	344,884,400	
第23回利付国債（30年）	150,000,000	185,046,000	
第24回利付国債（30年）	200,000,000	246,936,000	
第25回利付国債（30年）	250,000,000	302,190,000	
第26回利付国債（30年）	100,000,000	122,345,000	
第27回利付国債（30年）	450,000,000	557,239,500	
第28回利付国債（30年）	200,000,000	248,130,000	
第29回利付国債（30年）	270,000,000	331,335,900	



第30回利付国債（30年）	210,000,000	254,625,000	
第31回利付国債（30年）	180,000,000	215,285,400	
第32回利付国債（30年）	270,000,000	327,115,800	
第33回利付国債（30年）	600,000,000	697,062,000	
第34回利付国債（30年）	540,000,000	644,635,800	
第35回利付国債（30年）	590,000,000	685,237,800	
第36回利付国債（30年）	540,000,000	627,134,400	
第37回利付国債（30年）	320,000,000	365,766,400	
第38回利付国債（30年）	410,000,000	460,778,500	
第39回利付国債（30年）	270,000,000	308,291,400	
第40回利付国債（30年）	261,000,000	293,254,380	
第41回利付国債（30年）	360,000,000	397,807,200	
第42回利付国債（30年）	240,000,000	264,996,000	
第43回利付国債（30年）	330,000,000	364,075,800	
第44回利付国債（30年）	370,000,000	407,865,800	
第45回利付国債（30年）	360,000,000	382,903,200	
第46回利付国債（30年）	410,000,000	435,936,600	
第47回利付国債（30年）	500,000,000	540,790,000	
第48回利付国債（30年）	446,000,000	464,669,560	
第49回利付国債（30年）	350,000,000	364,451,500	
第50回利付国債（30年）	610,000,000	561,498,900	
第51回利付国債（30年）	440,000,000	359,889,200	
第52回利付国債（30年）	370,000,000	316,461,000	
第53回利付国債（30年）	320,000,000	279,372,800	
第54回利付国債（30年）	370,000,000	337,103,300	
第55回利付国債（30年）	450,000,000	408,915,000	
第56回利付国債（30年）	390,000,000	353,457,000	
第57回利付国債（30年）	360,000,000	325,396,800	
第58回利付国債（30年）	320,000,000	288,198,400	
第59回利付国債（30年）	420,000,000	367,928,400	
第60回利付国債（30年）	280,000,000	256,351,200	
第61回利付国債（30年）	288,000,000	250,335,360	
第62回利付国債（30年）	430,000,000	353,580,400	
第63回利付国債（30年）	350,000,000	278,838,000	
第64回利付国債（30年）	370,000,000	293,694,900	
第65回利付国債（30年）	370,000,000	293,180,600	

第66回利付国債（30年）	390,000,000	307,308,300	
第67回利付国債（30年）	520,000,000	431,605,200	
第68回利付国債（30年）	390,000,000	322,635,300	
第69回利付国債（30年）	440,000,000	373,621,600	
第70回利付国債（30年）	630,000,000	533,830,500	
第71回利付国債（30年）	480,000,000	406,257,600	
第72回利付国債（30年）	390,000,000	330,041,400	
第73回利付国債（30年）	330,000,000	278,671,800	
第74回利付国債（30年）	620,000,000	566,537,400	
第75回利付国債（30年）	400,000,000	393,332,000	
第76回利付国債（30年）	530,000,000	535,019,100	
第77回利付国債（30年）	310,000,000	327,133,700	
第70回利付国債（20年）	50,000,000	51,552,000	
第72回利付国債（20年）	100,000,000	103,265,000	
第75回利付国債（20年）	100,000,000	104,339,000	
第77回利付国債（20年）	150,000,000	156,211,500	
第78回利付国債（20年）	100,000,000	104,435,000	
第80回利付国債（20年）	100,000,000	104,882,000	
第81回利付国債（20年）	100,000,000	105,173,000	
第83回利付国債（20年）	200,000,000	211,906,000	
第84回利付国債（20年）	200,000,000	211,358,000	
第86回利付国債（20年）	140,000,000	149,878,400	
第89回利付国債（20年）	200,000,000	214,592,000	
第90回利付国債（20年）	300,000,000	323,430,000	
第92回利付国債（20年）	700,000,000	755,412,000	
第93回利付国債（20年）	50,000,000	53,978,000	
第94回利付国債（20年）	60,000,000	65,011,800	
第95回利付国債（20年）	400,000,000	438,544,000	
第96回利付国債（20年）	100,000,000	108,791,000	
第97回利付国債（20年）	100,000,000	109,664,000	
第98回利付国債（20年）	200,000,000	218,432,000	
第99回利付国債（20年）	300,000,000	328,950,000	
第100回利付国債（20年）	650,000,000	718,679,000	
第102回利付国債（20年）	200,000,000	224,166,000	
第103回利付国債（20年）	200,000,000	223,124,000	
第105回利付国債（20年）	220,000,000	244,123,000	

第106回利付国債（20年）	140,000,000	156,114,000	
第107回利付国債（20年）	250,000,000	278,492,500	
第108回利付国債（20年）	300,000,000	330,771,000	
第109回利付国債（20年）	300,000,000	331,794,000	
第110回利付国債（20年）	100,000,000	111,785,000	
第111回利付国債（20年）	40,000,000	45,144,800	
第112回利付国債（20年）	500,000,000	561,220,000	
第113回利付国債（20年）	620,000,000	698,287,400	
第114回利付国債（20年）	100,000,000	113,070,000	
第115回利付国債（20年）	100,000,000	113,737,000	
第116回利付国債（20年）	150,000,000	171,294,000	
第117回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,203,153,000	
第118回利付国債（20年）	350,000,000	395,885,000	
第119回利付国債（20年）	100,000,000	111,681,000	
第120回利付国債（20年）	250,000,000	275,630,000	
第121回利付国債（20年）	610,000,000	686,951,500	
第122回利付国債（20年）	160,000,000	179,003,200	
第123回利付国債（20年）	180,000,000	205,882,200	
第124回利付国債（20年）	400,000,000	454,472,000	
第125回利付国債（20年）	510,000,000	588,708,300	
第126回利付国債（20年）	110,000,000	125,252,600	
第127回利付国債（20年）	40,000,000	45,233,200	
第128回利付国債（20年）	190,000,000	215,279,500	
第129回利付国債（20年）	490,000,000	551,245,100	
第130回利付国債（20年）	180,000,000	203,004,000	
第131回利付国債（20年）	540,000,000	604,530,000	
第132回利付国債（20年）	290,000,000	325,374,200	
第133回利付国債（20年）	702,000,000	793,618,020	
第134回利付国債（20年）	610,000,000	691,502,100	
第135回利付国債（20年）	100,000,000	112,485,000	
第136回利付国債（20年）	100,000,000	111,609,000	
第137回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,125,740,000	
第138回利付国債（20年）	70,000,000	77,543,900	
第139回利付国債（20年）	380,000,000	424,365,000	
第140回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,386,210,000	
第141回利付国債（20年）	370,000,000	417,397,000	

第142回利付国債（20年）	2,060,000,000	2,343,291,200	
第143回利付国債（20年）	60,000,000	67,133,400	
第144回利付国債（20年）	530,000,000	587,913,100	
第145回利付国債（20年）	944,000,000	1,066,172,480	
第146回利付国債（20年）	560,000,000	632,917,600	
第147回利付国債（20年）	870,000,000	974,913,300	
第148回利付国債（20年）	540,000,000	599,313,600	
第149回利付国債（20年）	540,000,000	599,005,800	
第150回利付国債（20年）	630,000,000	691,941,600	
第151回利付国債（20年）	600,000,000	645,108,000	
第152回利付国債（20年）	430,000,000	461,927,500	
第153回利付国債（20年）	860,000,000	933,375,200	
第154回利付国債（20年）	820,000,000	879,679,600	
第155回利付国債（20年）	700,000,000	733,117,000	
第156回利付国債（20年）	492,000,000	477,559,800	
第157回利付国債（20年）	850,000,000	800,955,000	
第158回利付国債（20年）	350,000,000	342,006,000	
第159回利付国債（20年）	490,000,000	483,556,500	
第160回利付国債（20年）	830,000,000	827,891,800	
第161回利付国債（20年）	860,000,000	843,952,400	
第162回利付国債（20年）	350,000,000	342,468,000	
第163回利付国債（20年）	440,000,000	429,250,800	
第164回利付国債（20年）	724,000,000	694,019,160	
第165回利付国債（20年）	730,000,000	697,427,400	
第166回利付国債（20年）	560,000,000	549,253,600	
第167回利付国債（20年）	740,000,000	701,623,600	
第168回利付国債（20年）	480,000,000	446,160,000	
第169回利付国債（20年）	390,000,000	355,098,900	
第170回利付国債（20年）	700,000,000	634,249,000	
第171回利付国債（20年）	550,000,000	496,237,500	
第172回利付国債（20年）	460,000,000	420,550,400	
第173回利付国債（20年）	550,000,000	500,390,000	
第174回利付国債（20年）	490,000,000	443,935,100	
第175回利付国債（20年）	690,000,000	633,744,300	
第176回利付国債（20年）	390,000,000	357,017,700	
第177回利付国債（20年）	850,000,000	761,957,000	

	第178回利付国債(20年)	530,000,000	482,262,900	
	第179回利付国債(20年)	640,000,000	580,806,400	
	第180回利付国債(20年)	660,000,000	630,894,000	
	第181回利付国債(20年)	370,000,000	359,107,200	
	第182回利付国債(20年)	880,000,000	882,824,800	
	第183回利付国債(20年)	540,000,000	569,030,400	
国債証券 合計		124,965,000,000	126,798,078,050	
地方債証券	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,872,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,243,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	80,000,000	94,135,200	
	第9回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,620,000	
	第13回東京都公募公債(20年)	200,000,000	218,342,000	
	第31回東京都公募公債(5年)	100,000,000	99,982,000	
	第732回東京都公募公債	100,000,000	100,771,000	
	第749回東京都公募公債	300,000,000	302,907,000	
	第750回東京都公募公債	100,000,000	101,060,000	
	第753回東京都公募公債	150,000,000	150,025,500	
	第792回東京都公募公債	100,000,000	98,652,000	
	第1回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	120,532,000	
	第12回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,995,000	
	第26回神奈川県公募公債(20年)	20,000,000	21,652,200	
	第40回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	87,841,000	
	第209回神奈川県公募公債	200,000,000	201,552,000	
	第211回神奈川県公募公債	200,000,000	201,412,000	
	第11回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	110,310,000	
	第171回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	199,720,000	
	第176回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	99,821,000	
	第182回大阪府公募公債(5年)	340,000,000	339,126,200	
	第187回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	199,208,000	
	第388回大阪府公募公債	200,000,000	201,500,000	
	第391回大阪府公募公債	300,000,000	302,448,000	
	第451回大阪府公募公債	152,000,000	149,169,760	
	第466回大阪府公募公債	137,000,000	134,001,070	
	平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	93,484,000	
	第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	119,412,000	
	第4回兵庫県公募公債(12年)	200,000,000	204,224,000	

第5回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	421,616,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,725,000	
第15回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	216,130,000	
第11回静岡県公募公債（20年）	200,000,000	221,154,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,018,000	
令和2年度第7回静岡県公募公債（5年）	200,000,000	199,888,000	
平成20年度第2回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	111,560,000	
平成27年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,079,000	
平成26年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,781,000	
平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	99,950,000	
平成26年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,550,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	110,041,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	200,000,000	210,106,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	100,790,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,789,000	
平成28年度第2回島根県公募公債（20年）	100,000,000	95,594,000	
令和3年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	97,034,000	
平成27年度第1回新潟市公募公債	10,000,000	10,112,100	
平成26年度第5回大阪市公募公債	200,000,000	201,690,000	
第1回名古屋市長公募公債（30年）	100,000,000	120,231,000	
第3回名古屋市長公募公債（20年）	100,000,000	104,427,000	
第490回名古屋市長公募公債	120,000,000	121,062,000	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	110,252,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	101,145,000	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	111,921,000	
平成26年度第5回札幌市公募公債	100,000,000	104,178,000	
第9回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	112,572,000	
平成23年度第4回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	111,519,000	
2021年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	97,088,000	
平成30年度第3回千葉市公募公債	10,000,000	10,002,200	
第148回福岡北九州高速道路債券（20年）	100,000,000	97,293,000	
地方債証券 合計	8,019,000,000	8,287,315,230	
特殊債券	第3回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,793,000
	第4回政府保証新関西国際空港債券	278,000,000	280,916,220
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	120,480,000

第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	110,991,000	
第42回道路債券（財投機関債）	110,000,000	114,670,600	
第50回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	91,598,000	
第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	56,024,000	
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	111,160,000	
第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,905,000	
第225回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,778,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,805,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,713,000	
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	106,398,560	
第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,817,000	
第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）	100,000,000	123,208,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	111,663,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,525,000	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,925,000	
第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）	400,000,000	435,092,000	
第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,012,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	108,226,000	
第48回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	103,655,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,748,000	
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,562,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	13,000,000	13,127,530	
F89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,953,000	
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券	118,000,000	118,213,580	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	122,000,000	122,140,300	
F149回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,930,000	
第17回政府保証民間都市開発債券	200,000,000	200,792,000	
第21回政府保証中部国際空港債券	204,000,000	205,764,600	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	38,956,000	38,744,079	

第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,588,000	34,317,119	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,045,000	19,908,881	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,877,000	56,179,164	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,093,000	35,117,494	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	89,921,600	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,775,000	98,432,756	
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,724,000	113,389,126	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,814,000	119,712,155	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,446,000	96,477,827	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,157,000	59,870,433	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	213,540,000	209,598,051	
第120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,288,000	70,778,626	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,346,000	145,201,064	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,300,000	148,580,834	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,977,000	75,945,699	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,615,000	76,795,848	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,622,000	78,825,630	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,707,000	87,295,509	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,611,000	89,219,585	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,900,000	89,769,339	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,410,000	91,156,622	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,352,000	92,377,971	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,261,000	93,007,378	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,888,000	93,828,276	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,609,000	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,410,000	
い第832号商工債券	100,000,000	99,983,000	
い第853号商工債券	100,000,000	99,661,000	
い第854号商工債券	100,000,000	99,603,000	
い第862号商工債券	200,000,000	199,374,000	
第11号商工債券（10年）	100,000,000	100,881,000	
第84回中日本高速道路	100,000,000	99,897,000	
第25回西日本高速道路	100,000,000	100,741,000	
第26回西日本高速道路	100,000,000	101,048,000	
第30回西日本高速道路	130,000,000	129,919,400	



特殊債券 合計		7,554,292,000	7,727,163,856	
社債券	第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,375,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,400,000	
	第35回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	97,637,000	
	第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,810,000	
	第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	97,597,000	
	第4回フランス預金供託公庫	100,000,000	100,605,000	
	第1回サントンドール銀行(2019)	100,000,000	99,079,000	
	第12回新関西国際空港	100,000,000	103,861,000	
	第21回新関西国際空港	100,000,000	87,159,000	
	第24回成田国際空港	100,000,000	99,465,000	
	第27回成田国際空港	200,000,000	186,950,000	
	第48回鹿島建設(サステナビリティ)	200,000,000	201,440,000	
	第9回サントリーホールディングス	100,000,000	99,849,000	
	第5回サントリー食品インターナショナル	100,000,000	99,859,000	
	第3回 キューピー	100,000,000	99,963,000	
	第13回日本たばこ産業	100,000,000	99,388,000	
	第14回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	99,858,000	
	第9回クラレ	100,000,000	100,014,000	
	第16回旭化成	100,000,000	99,796,000	
	第56回三井化学	100,000,000	100,238,000	
	第19回オリエンタルランド	100,000,000	99,878,000	
	第13回ヤフー	100,000,000	96,820,000	
	第19回Zホールディングス	100,000,000	99,151,000	
	第22回Zホールディングス	100,000,000	100,015,000	
	第11回ブリヂストン	200,000,000	199,586,000	
	第4回新日本製鐵	100,000,000	99,973,000	
	第28回ジェイ エフ イー ホールディングス	200,000,000	199,912,000	
	第14回LIXIL	100,000,000	99,842,000	
	第30回ダイキン工業	100,000,000	99,795,000	
	第7回ジェイテクト	100,000,000	99,221,000	
	第17回パナソニック	200,000,000	200,722,000	
	第18回パナソニック	200,000,000	199,400,000	
	第36回三菱重工業(グリーン)	300,000,000	299,562,000	
	第18回アイシン精機	100,000,000	99,600,000	
	第1回明治安田生命2018基金	200,000,000	199,990,000	

第1回明治安田生命2019基金	100,000,000	99,864,000	
第63回三井物産	100,000,000	108,138,000	
第61回住友商事	100,000,000	100,711,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	100,280,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	98,532,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	100,000,000	103,508,000	
第33回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	200,000,000	209,920,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	299,697,000	
第70回ホンダファイナンス	100,000,000	99,756,000	
第72回ホンダファイナンス	100,000,000	99,733,000	
第79回アコム	100,000,000	99,861,000	
第80回アコム	100,000,000	99,030,000	
第61回日立キャピタル	200,000,000	199,304,000	
第201回オリックス	100,000,000	99,094,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	100,000,000	100,204,000	
第1回三菱HCキャピタル	200,000,000	199,286,000	
第3回野村ホールディングス	100,000,000	98,721,000	
第118回三菱地所	100,000,000	99,868,000	
第137回三菱地所	100,000,000	99,801,000	
第107回住友不動産	200,000,000	199,506,000	
第111回住友不動産(グリーン)	100,000,000	100,684,000	
第78回東京急行電鉄	100,000,000	105,141,000	
第57回東日本旅客鉄道	100,000,000	110,634,000	
第147回東日本旅客鉄道	100,000,000	97,925,000	
第184回東日本旅客鉄道	100,000,000	99,974,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	108,640,000	
第68回東海旅客鉄道	100,000,000	107,152,000	
第73回東海旅客鉄道	100,000,000	100,517,000	
第13回東京地下鉄	100,000,000	107,804,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	100,000,000	99,412,000	
第64回名古屋鉄道	100,000,000	99,118,000	
第9回九州旅客鉄道	100,000,000	99,638,000	
第31回KDDI(サステナビリティ)	100,000,000	100,355,000	
第7回ソフトバンク	100,000,000	96,873,000	
第9回ソフトバンク	200,000,000	197,676,000	
第13回ソフトバンク	100,000,000	94,746,000	

第503回中部電力	10,000,000	10,072,000	
第496回関西電力	100,000,000	101,176,000	
第554回関西電力	200,000,000	200,152,000	
第389回中国電力	300,000,000	299,502,000	
第513回東北電力	100,000,000	97,151,000	
第525回東北電力	100,000,000	98,503,000	
第552回東北電力	100,000,000	100,822,000	
第476回九州電力	100,000,000	98,260,000	
第484回九州電力	100,000,000	97,499,000	
第493回九州電力	200,000,000	197,880,000	
第514回九州電力	100,000,000	100,204,000	
第325回北海道電力	100,000,000	102,801,000	
第357回北海道電力	100,000,000	98,584,000	
第84回電源開発	100,000,000	100,871,000	
第85回電源開発	100,000,000	100,878,000	
第34回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,175,000	
第44回東京電力パワーグリッド	100,000,000	98,790,000	
第49回東京電力パワーグリッド	200,000,000	197,390,000	
第50回東京電力パワーグリッド	100,000,000	95,908,000	
第55回東京電力パワーグリッド	300,000,000	299,763,000	
第1回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	200,000,000	198,886,000	
第13回広島ガス	100,000,000	98,658,000	
社債券 合計	11,710,000,000	11,700,838,000	
合計	152,248,292,000	154,513,395,136	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[令和5年3月27日現在]

### 資産の部

流動資産

預金	300,017,044
コール・ローン	1,510,966,035
国債証券	216,547,725,129
派生商品評価勘定	7,169,885,718
未収入金	15,658,283
未収利息	1,238,396,610
前払費用	354,717,380
流動資産合計	227,137,366,199
資産合計	227,137,366,199
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	256,165
未払金	163,838,260
未払解約金	43,296,217
未払利息	503
流動負債合計	207,391,145
負債合計	207,391,145
純資産の部	
元本等	
元本	194,810,700,487
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	32,119,274,567
元本等合計	226,929,975,054
純資産合計	226,929,975,054
負債純資産合計	227,137,366,199

## 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)

	[令和5年3月27日現在]
1. 期首	令和4年3月26日
期首元本額	205,868,338,141円
期中追加設定元本額	304,294,746,285円
期中一部解約元本額	315,352,383,939円
元本の内訳※	
eMAXIS 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	518,808,275円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	4,136,529,726円
ラップ向けインデックスf 先進国債券(為替ヘッジあり)	2,841,697,918円

ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	29,568,623円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	5,614,581円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	16,822,399円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,135,680,137円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,296,990,755円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	890,046,889円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	4,036,808,104円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	2,364,631,793円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	79,702,814円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド(適格機関投資家転売制限付)	92,041,172,433円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	9,730,891,156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)	11,405,717,813円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,699,638,734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)	767,455,615円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	10,327,632,919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)	818,567,443円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)	16,910,797,497円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン(適格機関投資家限定)	8,046,977,665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)	764,138,227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)	310,133,205円
マルチアセット運用戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,512,193円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,292,590,386円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07(適格機関投資家限定)	325,643,502円
MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定)	2,280,758,521円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09(適格機関投資家限定)	322,196,277円
MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定)	2,269,914,309円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11(適格機関投資家限定)	322,720,012円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01(適格機関投資家限定)	321,351,725円
MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定)	2,002,113,906円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03(適格機関投資家限定)	315,633,120円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05(適格機関投資家限定)	316,748,113円
MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定)	2,036,651,970円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07(適格機関投資家限定)	312,894,225円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09(適格機関投資家限定)	315,490,691円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11(適格機関投資家限定)	315,059,067円

MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	329,350,862円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	336,722,167円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	352,830,037円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	359,565,752円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	371,026,379円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	379,989,610円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	376,017,480円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	377,895,462円
合計	194,810,700,487円
2. 受益権の総数	194,810,700,487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 令和 4年 3月 26日 至 令和 5年 3月 27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。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 5年 3月 27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

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和 5 年 3 月 27 日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
国債証券		623,976,068
合計		623,976,068

(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

[令和 5 年 3 月 27 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	117,520,200	—	117,567,270	47,070
	ユーロ	35,365,000	—	35,164,275	△200,725
	売建				
	アメリカドル	109,097,309,453	—	104,945,877,115	4,151,432,338
	カナダドル	4,525,145,390	—	4,305,620,040	219,525,350
	オーストラリアドル	3,534,065,838	—	3,346,620,000	187,445,838
	イギリスポンド	10,370,477,220	—	10,116,627,570	253,849,650
	シンガポールドル	1,032,330,283	—	1,004,291,925	28,038,358
	マレーシアリンギット	1,227,874,710	—	1,189,259,760	38,614,950
	ニュージーランドドル	426,349,800	—	412,756,260	13,593,540
	スウェーデンクローネ	464,499,296	—	445,007,002	19,492,294
	ノルウェークローネ	441,417,350	—	418,314,820	23,102,530
	デンマーククローネ	688,281,696	—	670,102,560	18,179,136
	メキシコペソ	1,959,259,728	—	1,888,172,832	71,086,896
	イスラエルシケル	792,056,568	—	777,828,672	14,227,896
ポーランドズロチ	1,025,980,705	—	1,009,536,967	16,443,738	

	中国元	10,302,971,234	—	10,015,642,668	287,328,566
	ユーロ	72,669,398,806	—	70,841,976,678	1,827,422,128
	合計	218,710,303,277	—	211,540,366,414	7,169,629,553

(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)

	[令和5年3月27日現在]
1口当たり純資産額	1.1649円
(1万口当たり純資産額)	(11,649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 240315	5,000,000.00	4,805,891.40	
		0.25 T-NOTE 240615	6,500,000.00	6,199,882.78	
		0.25 T-NOTE 250531	5,200,000.00	4,825,335.94	
		0.25 T-NOTE 250630	4,000,000.00	3,707,343.76	
		0.25 T-NOTE 250731	5,000,000.00	4,616,992.20	
		0.25 T-NOTE 250831	1,900,000.00	1,749,707.03	
		0.25 T-NOTE 250930	5,050,000.00	4,647,084.92	
		0.25 T-NOTE 251031	4,000,000.00	3,665,781.24	
		0.375 T-NOTE 240715	1,000,000.00	953,105.47	
		0.375 T-NOTE 240815	3,600,000.00	3,422,742.19	
		0.375 T-NOTE 240915	300,000.00	284,613.28	



0.375 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,730,156.24	
0.375 T-NOTE 251130	4,000,000.00	3,668,906.24	
0.375 T-NOTE 251231	2,000,000.00	1,833,242.18	
0.375 T-NOTE 260131	6,600,000.00	6,024,175.80	
0.375 T-NOTE 270731	4,000,000.00	3,498,281.24	
0.375 T-NOTE 270930	4,200,000.00	3,659,085.94	
0.5 T-NOTE 260228	2,700,000.00	2,467,599.60	
0.5 T-NOTE 270430	4,200,000.00	3,718,230.47	
0.5 T-NOTE 270531	500,000.00	441,601.56	
0.5 T-NOTE 270630	1,000,000.00	881,562.50	
0.5 T-NOTE 270831	3,850,000.00	3,380,931.63	
0.5 T-NOTE 271031	5,200,000.00	4,543,703.11	
0.625 T-NOTE 241015	4,200,000.00	3,989,261.72	
0.625 T-NOTE 260731	2,700,000.00	2,450,513.68	
0.625 T-NOTE 270331	1,500,000.00	1,337,929.68	
0.625 T-NOTE 271130	4,500,000.00	3,950,332.02	
0.625 T-NOTE 271231	5,480,000.00	4,801,100.77	
0.625 T-NOTE 300515	6,300,000.00	5,205,375.00	
0.625 T-NOTE 300815	8,900,000.00	7,311,732.43	
0.75 T-NOTE 241115	5,600,000.00	5,318,578.10	
0.75 T-NOTE 260331	4,300,000.00	3,956,335.91	
0.75 T-NOTE 260430	5,300,000.00	4,860,990.24	
0.75 T-NOTE 260531	5,200,000.00	4,759,421.88	
0.75 T-NOTE 260831	6,000,000.00	5,457,539.04	
0.75 T-NOTE 280131	4,300,000.00	3,784,083.97	
0.875 T-NOTE 260630	5,000,000.00	4,586,914.05	
0.875 T-NOTE 260930	3,000,000.00	2,735,742.18	
0.875 T-NOTE 301115	8,250,000.00	6,888,266.61	
1 T-NOTE 241215	6,000,000.00	5,714,648.46	
1 T-NOTE 280731	3,090,000.00	2,720,829.48	
1.125 T-BOND 400515	2,520,000.00	1,690,368.75	
1.125 T-BOND 400815	4,800,000.00	3,202,500.00	
1.125 T-NOTE 250115	4,500,000.00	4,285,546.87	
1.125 T-NOTE 261031	4,400,000.00	4,040,609.35	
1.125 T-NOTE 270228	1,900,000.00	1,734,640.62	
1.125 T-NOTE 280229	4,400,000.00	3,936,882.79	

1. 125 T-NOTE 280831	2,900,000.00	2,565,423.83	
1. 125 T-NOTE 310215	8,890,000.00	7,549,728.30	
1. 25 T-BOND 500515	3,850,000.00	2,252,400.38	
1. 25 T-NOTE 240831	1,200,000.00	1,153,687.50	
1. 25 T-NOTE 261130	5,700,000.00	5,249,677.71	
1. 25 T-NOTE 261231	3,700,000.00	3,401,832.01	
1. 25 T-NOTE 280331	5,590,000.00	5,023,248.23	
1. 25 T-NOTE 280430	4,000,000.00	3,589,765.64	
1. 25 T-NOTE 280531	3,700,000.00	3,314,896.48	
1. 25 T-NOTE 280630	6,200,000.00	5,545,246.08	
1. 25 T-NOTE 280930	7,300,000.00	6,492,009.78	
1. 25 T-NOTE 310815	9,460,000.00	7,996,841.00	
1. 375 T-BOND 401115	4,100,000.00	2,848,859.37	
1. 375 T-BOND 500815	5,990,000.00	3,616,462.50	
1. 375 T-NOTE 250131	4,000,000.00	3,825,625.00	
1. 375 T-NOTE 260831	900,000.00	836,296.87	
1. 375 T-NOTE 281031	3,340,000.00	2,986,755.84	
1. 375 T-NOTE 281231	3,000,000.00	2,679,316.41	
1. 375 T-NOTE 311115	10,230,000.00	8,708,687.07	
1. 5 T-NOTE 240229	5,000,000.00	4,870,142.00	
1. 5 T-NOTE 240930	4,000,000.00	3,854,921.88	
1. 5 T-NOTE 241031	2,000,000.00	1,924,531.24	
1. 5 T-NOTE 241130	4,000,000.00	3,844,218.76	
1. 5 T-NOTE 250215	5,000,000.00	4,787,402.35	
1. 5 T-NOTE 260815	5,000,000.00	4,669,726.55	
1. 5 T-NOTE 270131	4,700,000.00	4,356,128.91	
1. 5 T-NOTE 281130	6,300,000.00	5,667,415.99	
1. 5 T-NOTE 300215	3,750,000.00	3,317,871.06	
1. 625 T-BOND 501115	4,500,000.00	2,899,511.73	
1. 625 T-NOTE 260215	2,120,000.00	2,005,842.96	
1. 625 T-NOTE 260515	3,500,000.00	3,298,476.58	
1. 625 T-NOTE 260930	1,950,000.00	1,827,363.29	
1. 625 T-NOTE 261031	1,600,000.00	1,495,500.00	
1. 625 T-NOTE 261130	2,200,000.00	2,055,539.06	
1. 625 T-NOTE 290815	3,400,000.00	3,058,007.80	
1. 625 T-NOTE 310515	8,080,000.00	7,086,570.29	

1. 75 T-BOND 410815	4,900,000.00	3,570,779.30	
1. 75 T-NOTE 240630	4,850,000.00	4,711,036.15	
1. 75 T-NOTE 240731	5,000,000.00	4,847,753.90	
1. 75 T-NOTE 250315	6,200,000.00	5,961,324.24	
1. 75 T-NOTE 261231	2,800,000.00	2,623,687.50	
1. 75 T-NOTE 290131	5,100,000.00	4,642,693.35	
1. 75 T-NOTE 291115	4,000,000.00	3,623,125.00	
1. 875 T-BOND 410215	5,220,000.00	3,931,516.39	
1. 875 T-BOND 510215	5,700,000.00	3,913,406.25	
1. 875 T-BOND 511115	6,550,000.00	4,477,411.13	
1. 875 T-NOTE 260630	1,000,000.00	947,812.50	
1. 875 T-NOTE 260731	2,700,000.00	2,556,984.37	
1. 875 T-NOTE 270228	3,800,000.00	3,570,515.64	
1. 875 T-NOTE 290228	5,500,000.00	5,037,978.49	
1. 875 T-NOTE 320215	7,450,000.00	6,594,414.06	
2 T-BOND 411115	5,890,000.00	4,471,568.36	
2 T-BOND 500215	5,400,000.00	3,851,296.84	
2 T-BOND 510815	5,440,000.00	3,841,468.72	
2 T-NOTE 250215	4,800,000.00	4,639,781.23	
2 T-NOTE 250815	5,150,000.00	4,951,745.13	
2 T-NOTE 261115	5,000,000.00	4,736,523.45	
2. 125 T-NOTE 240229	2,900,000.00	2,840,882.16	
2. 125 T-NOTE 240331	4,500,000.00	4,401,779.08	
2. 125 T-NOTE 240930	4,000,000.00	3,891,796.88	
2. 125 T-NOTE 241130	4,000,000.00	3,884,921.88	
2. 125 T-NOTE 250515	5,100,000.00	4,931,361.30	
2. 125 T-NOTE 260531	1,400,000.00	1,339,242.18	
2. 25 T-BOND 410515	4,140,000.00	3,309,735.91	
2. 25 T-BOND 460815	2,500,000.00	1,900,488.27	
2. 25 T-BOND 490815	2,760,000.00	2,091,239.04	
2. 25 T-BOND 520215	4,490,000.00	3,361,799.81	
2. 25 T-NOTE 240430	3,100,000.00	3,033,156.25	
2. 25 T-NOTE 241031	2,300,000.00	2,239,310.54	
2. 25 T-NOTE 241115	3,000,000.00	2,919,902.34	
2. 25 T-NOTE 241231	3,600,000.00	3,500,648.42	
2. 25 T-NOTE 251115	6,400,000.00	6,174,124.99	

2.25 T-NOTE 260331	3,250,000.00	3,128,061.52	
2.25 T-NOTE 270215	4,200,000.00	4,005,914.05	
2.25 T-NOTE 270815	4,000,000.00	3,800,312.48	
2.25 T-NOTE 271115	4,200,000.00	3,979,828.10	
2.375 T-BOND 420215	5,000,000.00	4,044,042.95	
2.375 T-BOND 491115	2,560,000.00	1,992,300.00	
2.375 T-BOND 510515	6,500,000.00	5,013,759.79	
2.375 T-NOTE 240815	4,600,000.00	4,496,589.83	
2.375 T-NOTE 260430	2,100,000.00	2,026,664.05	
2.375 T-NOTE 270515	5,800,000.00	5,548,062.50	
2.375 T-NOTE 290331	2,650,000.00	2,495,088.87	
2.375 T-NOTE 290515	4,100,000.00	3,856,162.09	
2.5 T-BOND 450215	2,180,000.00	1,749,620.30	
2.5 T-BOND 460215	1,900,000.00	1,520,074.21	
2.5 T-BOND 460515	2,570,000.00	2,054,694.92	
2.5 T-NOTE 240430	5,300,000.00	5,203,005.86	
2.5 T-NOTE 240515	3,700,000.00	3,631,492.20	
2.5 T-NOTE 240531	5,000,000.00	4,904,101.55	
2.5 T-NOTE 250131	2,700,000.00	2,636,033.19	
2.5 T-NOTE 260228	3,000,000.00	2,907,832.02	
2.5 T-NOTE 270331	4,500,000.00	4,327,558.60	
2.625 T-NOTE 250331	3,900,000.00	3,815,677.74	
2.625 T-NOTE 250415	3,100,000.00	3,030,068.37	
2.625 T-NOTE 251231	4,000,000.00	3,894,609.36	
2.625 T-NOTE 260131	1,600,000.00	1,557,343.74	
2.625 T-NOTE 270531	4,900,000.00	4,730,892.57	
2.625 T-NOTE 290215	3,500,000.00	3,343,115.23	
2.625 T-NOTE 290731	4,500,000.00	4,292,050.77	
2.75 T-BOND 420815	830,000.00	710,201.15	
2.75 T-BOND 421115	2,900,000.00	2,472,363.26	
2.75 T-BOND 470815	1,820,000.00	1,523,823.42	
2.75 T-BOND 471115	3,400,000.00	2,849,093.74	
2.75 T-NOTE 250228	5,000,000.00	4,904,980.45	
2.75 T-NOTE 250515	4,000,000.00	3,918,125.00	
2.75 T-NOTE 250831	3,000,000.00	2,933,847.66	
2.75 T-NOTE 270430	2,200,000.00	2,135,503.89	

2.75 T-NOTE 270731	2,800,000.00	2,716,382.81	
2.75 T-NOTE 280215	6,650,000.00	6,437,771.50	
2.75 T-NOTE 290531	2,000,000.00	1,922,265.62	
2.75 T-NOTE 320815	8,300,000.00	7,874,625.00	
2.875 T-BOND 430515	2,920,000.00	2,534,696.88	
2.875 T-BOND 450815	1,800,000.00	1,543,007.80	
2.875 T-BOND 461115	970,000.00	832,381.25	
2.875 T-BOND 490515	3,000,000.00	2,585,859.36	
2.875 T-BOND 520515	5,700,000.00	4,897,212.91	
2.875 T-NOTE 250430	4,800,000.00	4,714,781.23	
2.875 T-NOTE 250615	4,100,000.00	4,027,449.22	
2.875 T-NOTE 251130	4,500,000.00	4,412,021.49	
2.875 T-NOTE 280515	5,600,000.00	5,444,031.26	
2.875 T-NOTE 280815	6,160,000.00	5,979,892.19	
2.875 T-NOTE 290430	4,500,000.00	4,357,353.51	
2.875 T-NOTE 320515	8,000,000.00	7,676,093.75	
3 T-BOND 420515	1,950,000.00	1,742,126.95	
3 T-BOND 441115	1,700,000.00	1,492,546.87	
3 T-BOND 450515	1,800,000.00	1,576,617.17	
3 T-BOND 451115	1,610,000.00	1,409,567.57	
3 T-BOND 470215	1,980,000.00	1,734,356.25	
3 T-BOND 470515	2,050,000.00	1,796,552.73	
3 T-BOND 480215	2,980,000.00	2,617,860.14	
3 T-BOND 480815	3,980,000.00	3,501,778.12	
3 T-BOND 490215	4,300,000.00	3,792,902.33	
3 T-BOND 520815	4,300,000.00	3,792,062.50	
3 T-NOTE 240630	6,000,000.00	5,915,976.54	
3 T-NOTE 240731	6,000,000.00	5,914,804.68	
3 T-NOTE 250715	4,100,000.00	4,035,216.80	
3 T-NOTE 250930	3,500,000.00	3,443,056.63	
3 T-NOTE 251031	3,000,000.00	2,951,074.23	
3.125 T-BOND 411115	550,000.00	505,097.65	
3.125 T-BOND 420215	1,340,000.00	1,224,372.65	
3.125 T-BOND 430215	1,350,000.00	1,219,693.35	
3.125 T-BOND 440815	2,640,000.00	2,369,709.38	
3.125 T-BOND 480515	2,860,000.00	2,571,989.07	

3. 125 T-NOTE 250815	1,300,000.00	1,282,835.94	
3. 125 T-NOTE 270831	5,000,000.00	4,928,710.95	
3. 125 T-NOTE 281115	3,900,000.00	3,831,826.16	
3. 125 T-NOTE 290831	3,250,000.00	3,191,474.61	
3. 25 T-BOND 420515	3,000,000.00	2,783,320.32	
3. 25 T-NOTE 240831	4,500,000.00	4,450,693.36	
3. 25 T-NOTE 270630	4,500,000.00	4,454,648.46	
3. 25 T-NOTE 290630	3,500,000.00	3,461,171.87	
3. 375 T-BOND 420815	2,520,000.00	2,380,218.75	
3. 375 T-BOND 440515	1,850,000.00	1,730,761.72	
3. 375 T-BOND 481115	3,900,000.00	3,674,988.27	
3. 5 T-BOND 390215	700,000.00	697,908.20	
3. 5 T-NOTE 250915	3,450,000.00	3,436,995.12	
3. 5 T-NOTE 280131	2,400,000.00	2,406,562.51	
3. 5 T-NOTE 300131	3,500,000.00	3,519,140.62	
3. 5 T-NOTE 330215	3,000,000.00	3,030,468.75	
3. 625 T-BOND 430815	1,100,000.00	1,073,015.62	
3. 625 T-BOND 440215	1,300,000.00	1,264,503.90	
3. 625 T-BOND 530215	1,350,000.00	1,346,097.65	
3. 75 T-BOND 410815	1,900,000.00	1,911,949.21	
3. 75 T-BOND 431115	2,210,000.00	2,193,425.00	
3. 875 T-BOND 400815	910,000.00	940,694.72	
3. 875 T-NOTE 260115	5,100,000.00	5,132,472.66	
3. 875 T-NOTE 271130	2,980,000.00	3,035,642.20	
3. 875 T-NOTE 271231	1,000,000.00	1,018,710.94	
3. 875 T-NOTE 290930	2,650,000.00	2,716,664.05	
3. 875 T-NOTE 291130	3,060,000.00	3,141,400.77	
3. 875 T-NOTE 291231	1,700,000.00	1,746,750.00	
4 T-BOND 421115	3,180,000.00	3,286,828.12	
4 T-BOND 521115	4,890,000.00	5,212,434.37	
4 T-NOTE 251215	1,800,000.00	1,817,472.65	
4 T-NOTE 260215	3,900,000.00	3,940,218.75	
4 T-NOTE 291031	2,840,000.00	2,934,296.86	
4. 125 T-NOTE 270930	1,700,000.00	1,745,455.07	
4. 125 T-NOTE 271031	2,400,000.00	2,465,531.25	
4. 125 T-NOTE 321115	7,040,000.00	7,461,299.99	

		4. 25 T-BOND 390515	700,000.00	761,468.75	
		4. 25 T-BOND 401115	1,410,000.00	1,525,388.67	
		4. 25 T-NOTE 240930	4,000,000.00	4,013,671.88	
		4. 25 T-NOTE 251015	1,000,000.00	1,013,671.88	
		4. 375 T-BOND 380215	390,000.00	430,881.44	
		4. 375 T-BOND 391115	1,680,000.00	1,850,625.00	
		4. 375 T-BOND 400515	1,050,000.00	1,154,958.98	
		4. 375 T-BOND 410515	1,580,000.00	1,731,766.41	
		4. 375 T-NOTE 241031	5,000,000.00	5,029,882.80	
		4. 5 T-BOND 360215	900,000.00	1,009,599.60	
		4. 5 T-BOND 380515	150,000.00	167,789.06	
		4. 5 T-BOND 390815	900,000.00	1,007,824.22	
		4. 625 T-BOND 400215	500,000.00	567,167.97	
		4. 75 T-BOND 410215	1,260,000.00	1,445,997.65	
		5 T-BOND 370515	440,000.00	517,696.09	
		5. 25 T-BOND 281115	1,000,000.00	1,092,695.31	
		5. 375 T-BOND 310215	520,000.00	592,068.75	
		6 T-BOND 260215	1,100,000.00	1,172,960.93	
		6. 125 T-BOND 271115	800,000.00	891,187.50	
		6. 25 T-BOND 300515	660,000.00	779,173.83	
アメリカドル合計			900,300,000.00	824,824,390.75 (107,763,306,651)	
カナダドル	国債証券	0. 25 CAN GOVT 240401	1,000,000.00	964,109.00	
		0. 25 CAN GOVT 260301	1,200,000.00	1,106,494.80	
		0. 5 CAN GOVT 250901	2,500,000.00	2,342,300.00	
		0. 5 CAN GOVT 301201	3,300,000.00	2,805,782.10	
		0. 75 CAN GOVT 241001	1,750,000.00	1,677,957.75	
		1 CAN GOVT 260901	1,300,000.00	1,218,899.50	
		1 CAN GOVT 270601	600,000.00	559,077.60	
		1. 25 CAN GOVT 250301	850,000.00	817,374.45	
		1. 25 CAN GOVT 270301	3,200,000.00	3,009,500.80	
		1. 25 CAN GOVT 300601	1,870,000.00	1,698,846.38	
		1. 5 CAN GOVT 240501	1,500,000.00	1,462,725.00	
		1. 5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	964,641.00	
		1. 5 CAN GOVT 260601	1,150,000.00	1,100,981.25	
		1. 5 CAN GOVT 310601	2,350,000.00	2,147,162.10	

		1. 5 CAN GOVT 311201	2,700,000.00	2,451,508.20	
		1. 75 CAN GOVT 531201	2,380,000.00	1,829,317.98	
		2 CAN GOVT 280601	1,000,000.00	967,527.00	
		2 CAN GOVT 320601	2,250,000.00	2,120,494.50	
		2 CAN GOVT 511201	3,410,000.00	2,802,627.85	
		2. 25 CAN GOVT 250601	1,600,000.00	1,568,004.80	
		2. 25 CAN GOVT 290601	700,000.00	684,352.20	
		2. 25 CAN GOVT 291201	400,000.00	390,470.40	
		2. 5 CAN GOVT 240601	1,000,000.00	985,645.00	
		2. 5 CAN GOVT 321201	1,300,000.00	1,274,486.20	
		2. 75 CAN GOVT 240801	2,000,000.00	1,975,014.00	
		2. 75 CAN GOVT 330601	300,000.00	299,846.10	
		2. 75 CAN GOVT 481201	970,000.00	939,211.23	
		2. 75 CANADA GOVER 641201	590,000.00	566,156.33	
		3 CAN GOVT 241101	2,000,000.00	1,982,998.00	
		3. 5 CAN GOVT 280301	100,000.00	103,399.00	
		3. 5 CAN GOVT 451201	560,000.00	610,298.64	
		4 CAN GOVT 410601	710,000.00	813,095.55	
		5 CAN GOVT 370601	300,000.00	372,809.40	
		5. 75 CAN GOVT 290601	600,000.00	704,665.20	
		5. 75 CAN GOVT 330601	910,000.00	1,148,629.30	
		カナダドル合計	49,350,000.00	46,466,408.61 (4,421,743,443)	
オーストラリアドル	国債証券	0. 25 AUST GOVT 241121	1,700,000.00	1,626,370.28	
		0. 25 AUST GOVT 251121	1,450,000.00	1,355,294.80	
		0. 5 AUST GOVT 260921	2,000,000.00	1,844,109.02	
		1 AUST GOVT 301221	1,100,000.00	939,282.66	
		1 AUST GOVT 311121	2,600,000.00	2,172,834.94	
		1. 25 AUST GOVT 320521	2,610,000.00	2,208,721.84	
		1. 5 AUST GOVT 310621	2,550,000.00	2,243,459.96	
		1. 75 AUST GOVT 321121	1,900,000.00	1,670,740.88	
		1. 75 AUST GOVT 510621	1,450,000.00	943,043.55	
		2. 25 AUST GOVT 280521	1,400,000.00	1,352,709.97	
		2. 5 AUST GOVT 300521	1,770,000.00	1,702,661.21	
		2. 75 AUST GOVT 240421	1,000,000.00	996,472.46	
		2. 75 AUST GOVT 271121	1,500,000.00	1,488,241.44	



		2.75 AUST GOVT 281121	450,000.00	444,285.35	
		2.75 AUST GOVT 291121	1,280,000.00	1,256,419.58	
		2.75 AUST GOVT 350621	800,000.00	751,976.81	
		2.75 AUST GOVT 410521	890,000.00	780,014.17	
		3 AUST GOVT 331121	1,700,000.00	1,663,104.52	
		3 AUST GOVT 470321	1,130,000.00	994,690.21	
		3.25 AUST GOVT 250421	2,200,000.00	2,216,648.94	
		3.25 AUST GOVT 290421	1,800,000.00	1,822,154.94	
		3.25 AUST GOVT 390621	1,150,000.00	1,101,480.32	
		3.75 AUST GOVT 340521	1,100,000.00	1,149,319.38	
		3.75 AUST GOVT 370421	960,000.00	989,703.36	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,950,000.00	3,070,779.78	
		4.5 AUST GOVT 330421	1,830,000.00	2,030,782.65	
		4.75 AUST GOVT 270421	900,000.00	963,638.19	
		オーストラリアドル合計	42,170,000.00	39,778,941.21 (3,452,414,307)	
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	1,100,000.00	1,010,020.00	
		0.125 GILT 280131	1,210,000.00	1,046,589.50	
		0.25 GILT 250131	150,000.00	141,056.40	
		0.25 GILT 310731	2,550,000.00	2,010,114.00	
		0.375 GILT 261022	2,000,000.00	1,804,711.60	
		0.375 GILT 301022	1,670,000.00	1,361,617.80	
		0.5 GILT 290131	1,830,000.00	1,564,232.76	
		0.5 GILT 611022	1,720,000.00	634,005.41	
		0.625 GILT 250607	2,050,000.00	1,940,304.09	
		0.625 GILT 350731	1,900,000.00	1,368,243.20	
		0.625 GILT 501022	930,000.00	439,175.76	
		0.875 GILT 291022	1,280,000.00	1,112,005.12	
		0.875 GILT 330731	900,000.00	711,819.00	
		0.875 GILT 460131	1,160,000.00	653,539.82	
		1 GILT 240422	2,000,000.00	1,942,563.20	
		1 GILT 320131	2,950,000.00	2,452,335.00	
		1.125 GILT 390131	1,050,000.00	734,364.96	
		1.125 GILT 731022	910,000.00	414,947.98	
		1.25 GILT 270722	1,300,000.00	1,202,071.00	
		1.25 GILT 411022	2,380,000.00	1,608,389.72	

1. 25 GILT 510731	2, 220, 000. 00	1, 269, 396. 00	
1. 5 GILT 260722	1, 370, 000. 00	1, 297, 442. 60	
1. 5 GILT 470722	1, 860, 000. 00	1, 197, 408. 85	
1. 5 GILT 530731	870, 000. 00	522, 983. 10	
1. 625 GILT 281022	1, 000, 000. 00	925, 200. 00	
1. 625 GILT 541022	1, 340, 000. 00	829, 165. 20	
1. 625 GILT 711022	1, 170, 000. 00	667, 373. 14	
1. 75 GILT 370907	1, 500, 000. 00	1, 197, 300. 00	
1. 75 GILT 490122	740, 000. 00	498, 353. 00	
1. 75 GILT 570722	1, 440, 000. 00	910, 008. 00	
2 GILT 250907	1, 200, 000. 00	1, 163, 808. 00	
2. 5 GILT 650722	1, 030, 000. 00	785, 998. 76	
2. 75 GILT 240907	1, 050, 000. 00	1, 036, 242. 06	
3. 25 GILT 330131	300, 000. 00	299, 755. 08	
3. 25 GILT 440122	1, 900, 000. 00	1, 767, 878. 18	
3. 5 GILT 251022	1, 000, 000. 00	996, 683. 28	
3. 5 GILT 450122	1, 310, 000. 00	1, 261, 168. 96	
3. 5 GILT 680722	1, 130, 000. 00	1, 108, 551. 24	
3. 75 GILT 380129	500, 000. 00	508, 685. 00	
3. 75 GILT 520722	950, 000. 00	953, 724. 00	
3. 75 GILT 531022	500, 000. 00	500, 635. 00	
4 GILT 600122	920, 000. 00	986, 659. 88	
4. 125 GILT 270129	1, 330, 000. 00	1, 360, 802. 80	
4. 25 GILT 271207	1, 160, 000. 00	1, 217, 071. 07	
4. 25 GILT 320607	1, 530, 000. 00	1, 666, 078. 20	
4. 25 GILT 360307	1, 610, 000. 00	1, 749, 909. 00	
4. 25 GILT 390907	1, 070, 000. 00	1, 150, 369. 41	
4. 25 GILT 401207	910, 000. 00	976, 037. 60	
4. 25 GILT 461207	1, 230, 000. 00	1, 324, 851. 45	
4. 25 GILT 491207	1, 190, 000. 00	1, 289, 650. 60	
4. 25 GILT 551207	1, 320, 000. 00	1, 456, 427. 80	
4. 5 GILT 340907	1, 180, 000. 00	1, 310, 331. 00	
4. 5 GILT 421207	1, 650, 000. 00	1, 836, 037. 50	
4. 75 GILT 301207	1, 070, 000. 00	1, 189, 522. 85	
4. 75 GILT 381207	1, 340, 000. 00	1, 528, 227. 65	
5 GILT 250307	1, 830, 000. 00	1, 883, 611. 31	

		6 GILT 281207	900,000.00	1,032,210.00	
イギリスポンド合計			75,660,000.00	65,807,663.89 (10,521,329,302)	
シンガポ ールドル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	550,000.00	519,475.00	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	450,000.00	410,175.00	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	590,000.00	521,560.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	460,000.00	414,126.50	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,000,000.00	977,000.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	500,000.00	469,937.50	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	800,000.00	791,796.00	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	250,000.00	236,750.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	250,000.00	248,500.00	
		2.625 SINGAPORGOV 320801	400,000.00	392,894.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	500,000.00	512,147.50	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	400,000.00	409,200.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	950,000.00	955,700.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	800,000.00	804,000.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	1,500,000.00	1,498,561.95	
		3 SINGAPORGOVT 720801	170,000.00	197,965.00	
3.375 SINGAPORGOV 330901	600,000.00	629,100.00			
3.5 SINGAPORGOVT 270301	570,000.00	583,110.00			
シンガポールドドル合計			10,740,000.00	10,571,998.45 (1,037,007,327)	
マレーシ アリング ット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	1,500,000.00	1,367,100.81	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	1,000,000.00	997,991.35	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	2,300,000.00	2,243,287.61	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,300,000.00	2,311,419.04	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	800,000.00	753,097.82	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	1,000,000.00	974,793.31	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	1,950,000.00	1,921,681.18	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	3,000,000.00	3,036,294.00	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	2,500,000.00	2,502,039.75	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	1,500,000.00	1,525,047.75	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	1,500,000.00	1,521,235.80	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	1,500,000.00	1,524,169.20	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3,000,000.00	3,038,586.30	

		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	3,100,000.00	2,936,003.49	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	1,200,000.00	1,209,743.28	
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	3,000,000.00	3,082,202.10	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	1,700,000.00	1,773,301.62	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	2,500,000.00	2,678,047.00	
		4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1,200,000.00	1,270,278.84	
		4. 762 MALAYSIAGOV 370407	1,600,000.00	1,686,153.44	
		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	700,000.00	761,875.10	
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	640,000.00	682,913.02	
マレーシアリングット合計			39,490,000.00	39,797,261.81 (1,173,804,318)	
ニュージーランドドル	国債証券	1. 75 NZ GOVT 410515	300,000.00	199,995.01	
		2 NZ GOVT 320515	1,200,000.00	1,007,607.72	
		2. 75 NZ GOVT 250415	900,000.00	871,073.97	
		2. 75 NZ GOVT 370415	700,000.00	584,126.81	
		2. 75 NZ GOVT 510515	400,000.00	293,115.65	
		3 NZ GOVT 290420	800,000.00	752,082.37	
		3. 5 NZ GOVT 330414	700,000.00	664,440.65	
		4. 5 NZ GOVT 270415	800,000.00	810,041.44	
ニュージーランドドル合計			5,800,000.00	5,182,483.62 (419,988,472)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	5,300,000.00	4,540,192.00	
		0. 75 SWD GOVT 280512	4,000,000.00	3,726,594.44	
		0. 75 SWD GOVT 291112	6,200,000.00	5,685,097.00	
		1 SWD GOVT 261112	6,150,000.00	5,869,601.08	
		1. 75 SWD GOVT 331111	2,000,000.00	1,944,007.02	
		2. 25 SWD GOVT 320601	3,100,000.00	3,143,183.00	
		2. 5 SWD GOVT 250512	7,200,000.00	7,176,624.40	
		3. 5 SWD GOVT 390330	3,550,000.00	4,199,685.50	
スウェーデンクローネ合計			37,500,000.00	36,284,984.44 (454,650,855)	
ノルウェークローネ	国債証券	1. 25 NORWE GOVT 310917	3,800,000.00	3,334,234.00	
		1. 375 NORWE GOVT 300819	5,400,000.00	4,870,188.72	
		1. 5 NORWE GOVT 260219	2,850,000.00	2,742,213.00	
		1. 75 NORWE GOVT 250313	6,300,000.00	6,153,222.60	
		1. 75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	4,079,001.25	

		1.75 NORWE GOVT 290906	3,500,000.00	3,279,920.00	
		2 NORWE GOVT 280426	2,650,000.00	2,544,795.00	
		2.125 NORWE GOVT 320518	2,800,000.00	2,625,756.00	
		3 NORWE GOVT 240314	4,450,000.00	4,439,972.37	
ノルウェークローネ合計			36,000,000.00	34,069,302.94	(425,184,900)
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 241115	3,500,000.00	3,363,517.50	
		0 DMK GOVT 311115	5,400,000.00	4,432,002.48	
		0.25 DMK GOVT 521115	5,000,000.00	2,791,160.00	
		0.5 DMK GOVT 271115	6,900,000.00	6,353,720.10	
		0.5 DMK GOVT 291115	3,300,000.00	2,937,095.70	
		1.75 DMK GOVT 251115	5,500,000.00	5,401,433.34	
		4.5 DMK GOVT 391115	8,720,000.00	11,070,999.20	
デンマーククローネ合計			38,320,000.00	36,349,928.32	(686,286,646)
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	26,750,000.00	26,625,011.16	
		10 MEXICAN BONOS 361120	3,000,000.00	3,257,190.00	
		5 MEXICAN BONOS 250306	23,000,000.00	20,888,025.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	20,000,000.00	17,546,000.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	41,350,000.00	37,382,214.85	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	9,750,000.00	9,209,655.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	7,000,000.00	6,338,920.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	37,000,000.00	34,504,720.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	10,800,000.00	9,908,352.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	23,600,000.00	20,473,944.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	18,000,000.00	17,338,392.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	16,500,000.00	14,562,240.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	9,000,000.00	7,895,655.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	22,900,000.00	22,442,916.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	18,200,000.00	17,273,256.00	
メキシコペソ合計			286,850,000.00	265,646,491.01	(1,883,088,280)
イスラエルシェケル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	4,000,000.00	3,732,200.00	
		0.5 ISRAEL FIXED 260227	1,800,000.00	1,639,620.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	1,800,000.00	1,490,940.00	
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	1,500,000.00	1,233,450.00	

		1. 5 ISRAEL FIXED 370531	1, 800, 000. 00	1, 335, 060. 00	
		1. 75 ISRAEL FIXED 250831	1, 800, 000. 00	1, 721, 880. 00	
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	2, 500, 000. 00	2, 384, 375. 00	
		2. 8 ISRAEL FIXED 521129	800, 000. 00	621, 120. 00	
		3. 75 ISRAEL FIXED 240331	3, 000, 000. 00	2, 985, 600. 00	
		3. 75 ISRAEL FIXED 470331	1, 650, 000. 00	1, 551, 247. 50	
		5. 5 ISRAEL FIXED 420131	1, 510, 000. 00	1, 786, 028. 00	
		6. 25 ISRAEL FIXED 261030	700, 000. 00	770, 210. 00	
イスラエルシェケル合計			22, 860, 000. 00	21, 251, 730. 50	(774, 714, 833)
ポーランド ドズロチ	国債証券	0. 25 POLAND 261025	4, 000, 000. 00	3, 289, 920. 00	
		0. 75 POLAND 250425	1, 000, 000. 00	901, 900. 00	
		1. 25 POLAND 301025	4, 400, 000. 00	3, 176, 641. 60	
		1. 75 POLAND 320425	1, 800, 000. 00	1, 279, 980. 00	
		2. 25 POLAND 241025	4, 000, 000. 00	3, 783, 080. 00	
		2. 5 POLAND 240425	3, 000, 000. 00	2, 892, 900. 00	
		2. 5 POLAND 260725	2, 500, 000. 00	2, 248, 450. 00	
		2. 5 POLAND 270725	2, 300, 000. 00	2, 006, 865. 00	
		2. 75 POLAND 280425	3, 700, 000. 00	3, 202, 291. 91	
		2. 75 POLAND 291025	3, 000, 000. 00	2, 497, 140. 00	
		3. 25 POLAND 250725	3, 550, 000. 00	3, 352, 698. 10	
		3. 75 POLAND 270525	4, 000, 000. 00	3, 685, 520. 00	
		5. 75 POLAND 290425	1, 400, 000. 00	1, 391, 810. 00	
ポーランドドズロチ合計			38, 650, 000. 00	33, 709, 196. 61	(1, 011, 501, 749)
中国元	国債証券	1. 99 CHINA GOVT 240915	10, 000, 000. 00	9, 953, 783. 80	
		1. 99 CHINA GOVT 250409	4, 000, 000. 00	3, 962, 974. 16	
		2. 18 CHINA GOVT 250825	11, 000, 000. 00	10, 925, 750. 00	
		2. 24 CHINA GOVT 250525	9, 000, 000. 00	8, 957, 333. 25	
		2. 26 CHINA GOVT 250224	10, 000, 000. 00	9, 969, 307. 10	
		2. 28 CHINA GOVT 240317	10, 000, 000. 00	10, 002, 189. 00	
		2. 28 CHINA GOVT 251125	12, 000, 000. 00	11, 930, 770. 32	
		2. 37 CHINA GOVT 270120	7, 000, 000. 00	6, 927, 200. 00	
		2. 44 CHINA GOVT 271015	4, 000, 000. 00	3, 961, 400. 00	
		2. 47 CHINA GOVT 240902	10, 000, 000. 00	10, 013, 749. 00	
		2. 48 CHINA GOVT 270415	8, 000, 000. 00	7, 949, 200. 00	

2.5 CHINA GOVT 270725	8,000,000.00	7,942,800.00	
2.6 CHINA GOVT 320901	7,000,000.00	6,843,964.05	
2.62 CHINA GOVT 290925	7,000,000.00	6,917,636.74	
2.64 CHINA GOVT 280115	6,000,000.00	5,991,000.00	
2.68 CHINA GOVT 300521	12,000,000.00	11,871,251.40	
2.69 CHINA GOVT 260812	11,000,000.00	11,034,650.00	
2.69 CHINA GOVT 320815	9,000,000.00	8,866,433.61	
2.74 CHINA GOVT 260804	5,000,000.00	5,025,750.00	
2.75 CHINA GOVT 290615	15,000,000.00	14,940,134.85	
2.75 CHINA GOVT 320217	7,000,000.00	6,937,077.14	
2.76 CHINA GOVT 320515	9,000,000.00	8,926,551.45	
2.79 CHINA GOVT 291215	9,000,000.00	8,985,555.54	
2.8 CHINA GOVT 290324	8,000,000.00	8,001,434.40	
2.8 CHINA GOVT 321115	7,000,000.00	6,943,291.60	
2.84 CHINA GOVT 240408	15,000,000.00	15,091,905.00	
2.85 CHINA GOVT 270604	15,000,000.00	15,112,500.00	
2.89 CHINA GOVT 311118	10,000,000.00	10,031,134.00	
2.9 CHINA GOVT 260505	2,000,000.00	2,021,300.00	
2.91 CHINA GOVT 281014	12,000,000.00	12,108,600.00	
2.94 CHINA GOVT 241017	9,000,000.00	9,084,519.90	
2.99 CHINA GOVT 251015	3,000,000.00	3,044,250.00	
3.01 CHINA GOVT 280513	8,000,000.00	8,125,205.60	
3.02 CHINA GOVT 251022	17,000,000.00	17,247,350.00	
3.02 CHINA GOVT 310527	11,000,000.00	11,160,050.00	
3.03 CHINA GOVT 260311	11,000,000.00	11,170,500.00	
3.12 CHINA GOVT 261205	10,000,000.00	10,192,000.00	
3.12 CHINA GOVT 521025	4,000,000.00	3,905,114.60	
3.13 CHINA GOVT 291121	10,000,000.00	10,239,160.00	
3.22 CHINA GOVT 251206	9,000,000.00	9,192,600.00	
3.25 CHINA GOVT 260606	7,000,000.00	7,166,250.00	
3.25 CHINA GOVT 281122	8,000,000.00	8,251,525.60	
3.27 CHINA GOVT 301119	13,000,000.00	13,481,650.00	
3.28 CHINA GOVT 271203	12,000,000.00	12,345,600.00	
3.29 CHINA GOVT 290523	6,000,000.00	6,211,849.80	
3.32 CHINA GOVT 520415	6,000,000.00	6,095,443.20	
3.39 CHINA GOVT 500316	10,000,000.00	10,234,811.00	

		3. 52 CHINA GOVT 270504	4,000,000.00	4,165,000.00	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	5,000,000.00	5,256,063.50	
		3. 54 CHINA GOVT 280816	4,000,000.00	4,198,008.40	
		3. 57 CHINA GOVT 240622	9,000,000.00	9,164,287.80	
		3. 59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,327,950.00	
		3. 6 CHINA GOVT 250906	9,000,000.00	9,293,850.00	
		3. 61 CHINA GOVT 250607	7,000,000.00	7,213,301.20	
		3. 69 CHINA GOVT 240921	4,000,000.00	4,096,742.40	
		3. 69 CHINA GOVT 280517	5,000,000.00	5,283,004.00	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	6,000,000.00	6,511,032.00	
		3. 77 CHINA GOVT 250308	2,000,000.00	2,062,283.40	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	10,000,000.00	11,001,054.00	
		3. 86 CHINA GOVT 490722	8,000,000.00	8,858,376.00	
		4. 08 CHINA GOVT 481022	9,000,000.00	10,334,886.30	
中国元合計			512,000,000.00	520,060,345.11 (9,890,403,631)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 240715	2,000,000.00	1,937,588.00	
		0 AUSTRIA GOVT 250420	1,000,000.00	950,090.00	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	200,000.00	173,962.00	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	1,250,000.00	1,044,050.00	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	1,100,000.00	892,320.00	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	420,000.00	251,607.30	
		0 BEL GOVT 271022	800,000.00	716,117.20	
		0 BEL GOVT 311022	600,000.00	477,990.00	
		0 BUND 260815	1,700,000.00	1,582,717.00	
		0 BUND 271115	2,150,000.00	1,954,145.75	
		0 BUND 281115	1,180,000.00	1,052,943.50	
		0 BUND 290815	2,300,000.00	2,022,452.10	
		0 BUND 300215	2,500,000.00	2,178,165.00	
		0 BUND 300815	2,250,000.00	1,940,229.00	
		0 BUND 300815	1,200,000.00	1,036,572.00	
		0 BUND 310215	2,070,000.00	1,766,900.25	
		0 BUND 310815	2,400,000.00	2,026,953.60	
		0 BUND 310815	850,000.00	718,640.15	
		0 BUND 320215	2,050,000.00	1,711,089.90	
		0 BUND 350515	1,920,000.00	1,477,541.76	



0 BUND 360515	2, 170, 000. 00	1, 626, 964. 01	
0 BUND 500815	2, 650, 000. 00	1, 498, 500. 80	
0 BUND 500815	840, 000. 00	476, 475. 29	
0 BUND 520815	1, 850, 000. 00	1, 001, 009. 10	
0 FINNISH GOVT 240915	400, 000. 00	385, 604. 26	
0 FINNISH GOVT 260915	420, 000. 00	386, 363. 04	
0 FINNISH GOVT 300915	400, 000. 00	330, 391. 40	
0 IRISH GOVT 311018	750, 000. 00	605, 611. 50	
0 ITALY GOVT 240415	3, 000, 000. 00	2, 908, 677. 00	
0 ITALY GOVT 240815	1, 500, 000. 00	1, 442, 002. 50	
0 ITALY GOVT 241215	1, 300, 000. 00	1, 236, 786. 20	
0 ITALY GOVT 260401	600, 000. 00	546, 147. 60	
0 ITALY GOVT 260801	1, 800, 000. 00	1, 620, 369. 00	
0 NETH GOVT 260115	1, 000, 000. 00	936, 718. 00	
0 NETH GOVT 270115	600, 000. 00	550, 059. 60	
0 NETH GOVT 290115	1, 330, 000. 00	1, 163, 185. 41	
0 NETH GOVT 300715	1, 500, 000. 00	1, 265, 503. 50	
0 NETH GOVT 310715	750, 000. 00	617, 094. 00	
0 NETH GOVT 380115	580, 000. 00	397, 156. 16	
0 NETH GOVT 520115	1, 520, 000. 00	773, 027. 92	
0 O. A. T 240325	2, 000, 000. 00	1, 945, 806. 00	
0 O. A. T 250225	2, 750, 000. 00	2, 623, 750. 25	
0 O. A. T 250325	5, 300, 000. 00	5, 046, 177. 70	
0 O. A. T 260225	4, 200, 000. 00	3, 917, 293. 80	
0 O. A. T 270225	2, 200, 000. 00	2, 003, 082. 40	
0 O. A. T 291125	3, 900, 000. 00	3, 316, 834. 28	
0 O. A. T 301125	4, 220, 000. 00	3, 490, 100. 36	
0 O. A. T 311125	4, 700, 000. 00	3, 774, 161. 10	
0 O. A. T 320525	2, 700, 000. 00	2, 132, 634. 15	
0 OBL 240405	2, 200, 000. 00	2, 144, 205. 80	
0 OBL 241018	1, 500, 000. 00	1, 445, 482. 50	
0 OBL 250411	1, 000, 000. 00	954, 194. 16	
0 OBL 251010	1, 200, 000. 00	1, 133, 997. 60	
0 OBL 251010	900, 000. 00	852, 396. 30	
0 OBL 260410	3, 200, 000. 00	2, 997, 488. 00	
0 OBL 261009	1, 750, 000. 00	1, 623, 867. 00	

0 OBL 270416	2,000,000.00	1,838,072.00	
0 SPAIN GOVT 240531	1,300,000.00	1,257,824.02	
0 SPAIN GOVT 250131	2,000,000.00	1,905,720.00	
0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,360,337.50	
0 SPAIN GOVT 260131	1,500,000.00	1,392,195.00	
0 SPAIN GOVT 270131	900,000.00	811,223.55	
0 SPAIN GOVT 280131	2,100,000.00	1,837,668.00	
0.1 BEL GOVT 300622	1,370,000.00	1,150,240.01	
0.1 SPAIN GOVT 310430	2,500,000.00	1,991,897.50	
0.125 FINNISH GOV 310915	500,000.00	405,857.75	
0.125 FINNISH GOV 360415	300,000.00	211,027.02	
0.125 FINNISH GOV 520415	580,000.00	285,328.10	
0.2 IRISH GOVT 301018	1,200,000.00	1,015,518.90	
0.2 SCHATS 240614	1,000,000.00	972,895.00	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	400,000.00	281,906.00	
0.25 BUND 270215	2,300,000.00	2,143,328.60	
0.25 BUND 280815	2,620,000.00	2,381,097.92	
0.25 BUND 290215	2,800,000.00	2,525,314.40	
0.25 FINNISH GOVT 400915	270,000.00	172,777.59	
0.25 ITALY GOVT 280315	1,400,000.00	1,202,202.40	
0.25 NETH GOVT 250715	2,250,000.00	2,145,255.75	
0.25 NETH GOVT 290715	960,000.00	844,235.52	
0.25 O. A. T 261125	4,450,000.00	4,115,722.14	
0.25 SPAIN GOVT 240730	1,200,000.00	1,160,848.80	
0.35 BEL GOVT 320622	1,150,000.00	928,123.31	
0.35 IRISH GOVT 321018	700,000.00	571,401.60	
0.35 ITALY GOVT 250201	1,200,000.00	1,143,724.80	
0.4 BEL GOVT 400622	600,000.00	385,799.40	
0.4 IRISH GOVT 350515	550,000.00	415,906.70	
0.4 SCHATS 240913	2,000,000.00	1,942,370.00	
0.45 ITALY GOVT 290215	1,500,000.00	1,260,420.00	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	540,000.00	499,492.44	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	1,150,000.00	1,021,225.30	
0.5 BUND 250215	3,150,000.00	3,044,991.60	
0.5 BUND 260215	3,450,000.00	3,288,450.02	
0.5 BUND 270815	2,260,000.00	2,113,063.84	

0. 5 BUND 280215	2, 000, 000. 00	1, 856, 554. 00	
0. 5 FINNISH GOVT 260415	250, 000. 00	236, 631. 12	
0. 5 FINNISH GOVT 270915	1, 100, 000. 00	1, 011, 282. 80	
0. 5 FINNISH GOVT 290915	480, 000. 00	421, 722. 24	
0. 5 FINNISH GOVT 430415	610, 000. 00	391, 809. 83	
0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 000, 000. 00	1, 857, 890. 60	
0. 5 ITALY GOVT 280715	1, 400, 000. 00	1, 204, 047. 60	
0. 5 NETH GOVT 260715	1, 550, 000. 00	1, 462, 393. 22	
0. 5 NETH GOVT 320715	1, 320, 000. 00	1, 111, 170. 72	
0. 5 NETH GOVT 400115	1, 310, 000. 00	944, 584. 67	
0. 5 O. A. T 250525	2, 400, 000. 00	2, 301, 878. 40	
0. 5 O. A. T 260525	3, 600, 000. 00	3, 390, 332. 40	
0. 5 O. A. T 290525	3, 980, 000. 00	3, 540, 078. 66	
0. 5 O. A. T 400525	1, 900, 000. 00	1, 269, 226. 64	
0. 5 O. A. T 440625	1, 360, 000. 00	836, 228. 64	
0. 5 O. A. T 720525	830, 000. 00	351, 812. 10	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	1, 800, 000. 00	1, 529, 586. 00	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	1, 390, 000. 00	1, 129, 179. 01	
0. 55 IRISH GOVT 410422	430, 000. 00	285, 451. 20	
0. 6 ITALY GOVT 310801	2, 230, 000. 00	1, 735, 370. 39	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	2, 750, 000. 00	2, 384, 406. 75	
0. 65 BEL GOVT 710622	570, 000. 00	255, 369. 27	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	200, 000. 00	96, 189. 80	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	1, 950, 000. 00	1, 589, 103. 75	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	800, 000. 00	755, 029. 60	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	1, 150, 000. 00	1, 059, 408. 75	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	740, 000. 00	443, 114. 22	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	280, 000. 00	242, 183. 48	
0. 75 NETH GOVT 270715	1, 750, 000. 00	1, 639, 295. 00	
0. 75 NETH GOVT 280715	1, 100, 000. 00	1, 015, 425. 40	
0. 75 O. A. T 280225	3, 770, 000. 00	3, 475, 325. 49	
0. 75 O. A. T 280525	4, 170, 000. 00	3, 830, 687. 10	
0. 75 O. A. T 281125	4, 520, 000. 00	4, 118, 673. 72	
0. 75 O. A. T 520525	2, 450, 000. 00	1, 393, 711. 90	
0. 75 O. A. T 530525	2, 830, 000. 00	1, 569, 919. 86	
0. 8 BEL GOVT 250622	2, 900, 000. 00	2, 798, 340. 50	

0. 8 BEL GOVT 270622	1, 190, 000. 00	1, 111, 780. 11	
0. 8 BEL GOVT 280622	500, 000. 00	460, 246. 50	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	2, 600, 000. 00	2, 395, 718. 00	
0. 8 SPAIN GOVT 290730	800, 000. 00	705, 264. 00	
0. 85 AUSTRIA GOVT 200630	450, 000. 00	204, 277. 50	
0. 85 ITALY GOVT 270115	1, 300, 000. 00	1, 191, 534. 50	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	1, 450, 000. 00	1, 021, 596. 96	
0. 875 FINNISH GOV 250915	500, 000. 00	481, 513. 50	
0. 9 AUSTRIA GOVT 320220	800, 000. 00	686, 120. 00	
0. 9 BEL GOVT 290622	2, 300, 000. 00	2, 093, 046. 00	
0. 9 IRISH GOVT 280515	450, 000. 00	416, 836. 80	
0. 9 ITALY GOVT 310401	1, 600, 000. 00	1, 292, 960. 00	
0. 95 ITALY GOVT 270915	2, 250, 000. 00	2, 034, 877. 50	
0. 95 ITALY GOVT 300801	1, 150, 000. 00	952, 047. 08	
0. 95 ITALY GOVT 311201	2, 100, 000. 00	1, 667, 441. 45	
0. 95 ITALY GOVT 320601	2, 170, 000. 00	1, 694, 509. 60	
0. 95 ITALY GOVT 370301	1, 550, 000. 00	1, 045, 235. 68	
1 BEL GOVT 260622	1, 300, 000. 00	1, 242, 692. 10	
1 BEL GOVT 310622	1, 900, 000. 00	1, 672, 425. 60	
1 BUND 240815	2, 500, 000. 00	2, 452, 348. 12	
1 BUND 250815	3, 200, 000. 00	3, 105, 267. 20	
1 BUND 380515	980, 000. 00	822, 953. 04	
1 IRISH GOVT 260515	1, 550, 000. 00	1, 486, 293. 45	
1 O. A. T 251125	2, 800, 000. 00	2, 699, 054. 40	
1 O. A. T 270525	4, 500, 000. 00	4, 245, 583. 50	
1 SPAIN GOVT 420730	620, 000. 00	399, 580. 08	
1 SPAIN GOVT 501031	1, 470, 000. 00	807, 563. 61	
1. 1 IRISH GOVT 290515	820, 000. 00	758, 803. 40	
1. 1 ITALY GOVT 270401	2, 300, 000. 00	2, 118, 281. 60	
1. 125 FINNISH GOV 340415	280, 000. 00	236, 514. 04	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	400, 000. 00	388, 004. 40	
1. 2 ITALY GOVT 250815	900, 000. 00	861, 879. 62	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	1, 800, 000. 00	1, 246, 662. 42	
1. 25 BEL GOVT 330422	970, 000. 00	843, 939. 28	
1. 25 BUND 480815	2, 860, 000. 00	2, 369, 349. 84	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2, 200, 000. 00	2, 054, 187. 80	

1. 25 O. A. T 340525	3, 800, 000. 00	3, 239, 492. 40	
1. 25 O. A. T 360525	4, 360, 000. 00	3, 585, 053. 60	
1. 25 O. A. T 380525	600, 000. 00	475, 334. 40	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	2, 630, 000. 00	2, 333, 201. 87	
1. 3 IRISH GOVT 330515	630, 000. 00	557, 912. 88	
1. 3 OBL 271015	1, 370, 000. 00	1, 323, 587. 82	
1. 3 OBL 271015	1, 000, 000. 00	969, 100. 00	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	1, 900, 000. 00	1, 812, 176. 30	
1. 35 ITALY GOVT 300401	1, 200, 000. 00	1, 033, 833. 58	
1. 375 FINNISH GOV 270415	300, 000. 00	288, 389. 52	
1. 375 FINNISH GOV 470415	160, 000. 00	122, 052. 96	
1. 4 BEL GOVT 530622	730, 000. 00	482, 578. 91	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	2, 050, 000. 00	1, 916, 489. 65	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	1, 450, 000. 00	1, 351, 067. 46	
1. 45 BEL GOVT 370622	610, 000. 00	500, 586. 74	
1. 45 ITALY GOVT 241115	2, 100, 000. 00	2, 051, 969. 93	
1. 45 ITALY GOVT 250515	1, 300, 000. 00	1, 258, 955. 10	
1. 45 ITALY GOVT 360301	1, 300, 000. 00	964, 273. 70	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	2, 850, 000. 00	2, 691, 139. 82	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	1, 640, 000. 00	1, 517, 057. 40	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	570, 000. 00	287, 793. 00	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	700, 000. 00	533, 335. 60	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	310, 000. 00	197, 785. 56	
1. 5 BUND 240515	2, 500, 000. 00	2, 472, 634. 17	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	700, 000. 00	631, 341. 69	
1. 5 IRISH GOVT 500515	760, 000. 00	553, 093. 80	
1. 5 ITALY GOVT 250601	2, 280, 000. 00	2, 207, 377. 44	
1. 5 ITALY GOVT 450430	1, 100, 000. 00	680, 195. 42	
1. 5 O. A. T 310525	4, 690, 000. 00	4, 349, 965. 62	
1. 5 O. A. T 500525	3, 010, 000. 00	2, 172, 106. 30	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	1, 550, 000. 00	1, 477, 945. 15	
1. 6 BEL GOVT 470622	560, 000. 00	414, 761. 20	
1. 6 ITALY GOVT 260601	2, 550, 000. 00	2, 431, 688. 13	
1. 6 SPAIN GOVT 250430	1, 700, 000. 00	1, 665, 913. 30	
1. 65 AUSTRIA GOVT 241021	680, 000. 00	671, 124. 64	
1. 65 ITALY GOVT 301201	2, 130, 000. 00	1, 845, 073. 79	

1.65 ITALY GOVT 320301	1,240,000.00	1,042,776.76	
1.7 BEL GOVT 500622	1,320,000.00	975,165.84	
1.7 BUND 320815	2,700,000.00	2,615,066.10	
1.7 IRISH GOVT 370515	280,000.00	242,018.28	
1.7 ITALY GOVT 510901	1,050,000.00	632,570.71	
1.75 ITALY GOVT 240701	2,000,000.00	1,970,694.00	
1.75 O.A.T 241125	2,700,000.00	2,664,910.80	
1.75 O.A.T 390625	2,570,000.00	2,183,816.38	
1.75 O.A.T 660525	1,060,000.00	761,313.20	
1.8 BUND 530815	530,000.00	483,763.86	
1.8 ITALY GOVT 410301	1,430,000.00	1,006,426.85	
1.85 AUSTRIA GOVT 490523	260,000.00	209,790.88	
1.85 ITALY GOVT 240515	2,000,000.00	1,976,328.00	
1.85 ITALY GOVT 250701	1,600,000.00	1,559,627.20	
1.85 SPAIN GOVT 350730	1,730,000.00	1,474,030.93	
1.9 BEL GOVT 380622	870,000.00	748,793.34	
1.9 SPAIN GOVT 521031	950,000.00	644,842.90	
1.95 SPAIN GOVT 260430	1,500,000.00	1,469,998.50	
1.95 SPAIN GOVT 300730	1,870,000.00	1,753,504.61	
2 AUSTRIA GOVT 260715	500,000.00	493,640.50	
2 IRISH GOVT 450218	620,000.00	520,294.08	
2 ITALY GOVT 251201	1,400,000.00	1,360,730.00	
2 ITALY GOVT 280201	1,750,000.00	1,647,336.25	
2 NETH GOVT 240715	900,000.00	894,707.69	
2 NETH GOVT 540115	420,000.00	378,538.77	
2 O.A.T 321125	3,300,000.00	3,120,315.00	
2 O.A.T 480525	2,360,000.00	1,933,812.32	
2.05 ITALY GOVT 270801	1,820,000.00	1,731,846.77	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	460,000.00	358,770.56	
2.1 BUND 291115	1,000,000.00	1,001,798.00	
2.1 ITALY GOVT 260715	1,400,000.00	1,354,424.40	
2.15 BEL GOVT 660622	410,000.00	325,380.06	
2.15 ITALY GOVT 520901	850,000.00	560,563.10	
2.15 ITALY GOVT 720301	170,000.00	101,972.80	
2.15 SPAIN GOVT 251031	2,700,000.00	2,673,673.61	
2.2 ITALY GOVT 270601	400,000.00	383,918.00	

2.25 BEL GOVT 570622	800,000.00	653,328.80	
2.25 ITALY GOVT 360901	1,260,000.00	1,025,233.02	
2.25 O. A. T 240525	3,800,000.00	3,778,703.01	
2.3 BUND 330215	850,000.00	863,950.20	
2.35 SPAIN GOVT 330730	1,780,000.00	1,653,050.40	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	660,000.00	633,957.72	
2.4 IRISH GOVT 300515	540,000.00	540,804.60	
2.45 ITALY GOVT 330901	1,900,000.00	1,655,660.00	
2.45 ITALY GOVT 500901	1,130,000.00	811,255.25	
2.5 BUND 440704	2,430,000.00	2,548,149.03	
2.5 BUND 460815	2,520,000.00	2,668,967.28	
2.5 ITALY GOVT 241201	1,500,000.00	1,490,355.00	
2.5 ITALY GOVT 251115	1,150,000.00	1,133,480.25	
2.5 ITALY GOVT 321201	1,440,000.00	1,282,063.68	
2.5 NETH GOVT 330115	1,250,000.00	1,255,122.50	
2.5 NETH GOVT 330715	200,000.00	201,212.00	
2.5 O. A. T 300525	4,800,000.00	4,813,876.80	
2.5 O. A. T 430525	350,000.00	320,524.40	
2.55 SPAIN GOVT 321031	1,400,000.00	1,335,712.00	
2.6 BEL GOVT 240622	700,000.00	699,852.30	
2.625 FINNISH GOV 420704	480,000.00	463,912.56	
2.65 ITALY GOVT 271201	1,500,000.00	1,457,154.00	
2.7 ITALY GOVT 470301	1,650,000.00	1,286,265.75	
2.7 SPAIN GOVT 481031	1,690,000.00	1,427,036.00	
2.75 BEL GOVT 390422	500,000.00	479,492.50	
2.75 FINNISH GOVT 280704	590,000.00	597,983.88	
2.75 NETH GOVT 470115	1,530,000.00	1,597,647.42	
2.75 O. A. T 271025	3,980,000.00	4,032,894.20	
2.75 SPAIN GOVT 241031	2,200,000.00	2,201,711.60	
2.8 ITALY GOVT 281201	1,560,000.00	1,510,637.92	
2.8 ITALY GOVT 290615	1,600,000.00	1,536,115.20	
2.8 ITALY GOVT 670301	980,000.00	702,777.60	
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	500,000.00	506,034.50	
2.9 SPAIN GOVT 461031	1,620,000.00	1,439,804.16	
2.95 ITALY GOVT 380901	1,290,000.00	1,116,407.55	
3 BEL GOVT 330622	650,000.00	660,479.17	

3 BEL GOVT 340622	740,000.00	745,390.90	
3 IRISH GOVT 431018	260,000.00	262,872.74	
3 ITALY GOVT 290801	2,250,000.00	2,186,887.50	
3 O. A. T 540525	300,000.00	294,100.50	
3. 1 ITALY GOVT 400301	1,570,000.00	1,363,077.92	
3. 15 AUSTRIA GOVT 440620	630,000.00	657,867.42	
3. 15 SPAIN GOVT 330430	700,000.00	698,453.70	
3. 25 BUND 420704	1,680,000.00	1,937,896.80	
3. 25 ITALY GOVT 380301	780,000.00	699,524.28	
3. 25 ITALY GOVT 460901	1,260,000.00	1,084,071.24	
3. 25 O. A. T 450525	2,620,000.00	2,710,017.96	
3. 3 BEL GOVT 540622	250,000.00	253,382.50	
3. 35 ITALY GOVT 350301	1,670,000.00	1,550,754.95	
3. 4 IRISH GOVT 240318	600,000.00	604,245.00	
3. 4 ITALY GOVT 280401	450,000.00	449,876.25	
3. 45 ITALY GOVT 480301	1,480,000.00	1,305,226.80	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	500,000.00	484,125.50	
3. 45 SPAIN GOVT 660730	1,160,000.00	1,091,618.00	
3. 5 ITALY GOVT 260115	1,400,000.00	1,413,011.60	
3. 5 ITALY GOVT 300301	2,930,000.00	2,918,204.23	
3. 5 O. A. T 260425	2,400,000.00	2,475,988.80	
3. 75 BEL GOVT 450622	890,000.00	976,134.20	
3. 75 ITALY GOVT 240901	1,400,000.00	1,416,189.60	
3. 75 NETH GOVT 420115	1,450,000.00	1,696,688.50	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	280,000.00	338,147.60	
3. 8 SPAIN GOVT 240430	1,000,000.00	1,009,799.40	
3. 85 ITALY GOVT 291215	550,000.00	557,333.42	
3. 85 ITALY GOVT 490901	1,230,000.00	1,151,268.93	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	300,000.00	311,464.74	
4 BEL GOVT 320328	710,000.00	781,854.84	
4 BUND 370104	2,070,000.00	2,504,079.00	
4 FINNISH GOVT 250704	450,000.00	465,547.50	
4 ITALY GOVT 350430	550,000.00	544,087.66	
4 ITALY GOVT 370201	2,190,000.00	2,169,573.87	
4 NETH GOVT 370115	1,650,000.00	1,919,986.20	
4 O. A. T 381025	2,120,000.00	2,389,229.40	



4 O. A. T 550425	1, 600, 000. 00	1, 894, 619. 20	
4 O. A. T 600425	1, 490, 000. 00	1, 792, 544. 50	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	1, 350, 000. 00	1, 534, 048. 20	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	1, 590, 000. 00	1, 721, 852. 34	
4. 25 BEL GOVT 410328	1, 210, 000. 00	1, 394, 083. 35	
4. 25 BUND 390704	1, 670, 000. 00	2, 120, 552. 64	
4. 4 ITALY GOVT 330501	600, 000. 00	621, 552. 00	
4. 45 ITALY GOVT 430901	450, 000. 00	458, 847. 90	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 200, 000. 00	1, 271, 583. 60	
4. 5 ITALY GOVT 260301	1, 700, 000. 00	1, 764, 604. 59	
4. 5 ITALY GOVT 531001	400, 000. 00	411, 400. 00	
4. 5 O. A. T 410425	3, 150, 000. 00	3, 789, 632. 70	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	1, 000, 000. 00	1, 046, 203. 00	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	1, 680, 000. 00	1, 926, 205. 68	
4. 75 BUND 280704	1, 300, 000. 00	1, 472, 422. 90	
4. 75 BUND 340704	1, 820, 000. 00	2, 290, 335. 32	
4. 75 BUND 400704	1, 420, 000. 00	1, 923, 354. 50	
4. 75 ITALY GOVT 280901	1, 800, 000. 00	1, 920, 762. 00	
4. 75 ITALY GOVT 440901	1, 650, 000. 00	1, 764, 039. 75	
4. 75 O. A. T 350425	1, 250, 000. 00	1, 492, 017. 50	
4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1, 600, 000. 00	1, 709, 497. 60	
4. 9 SPAIN GOVT 400730	1, 430, 000. 00	1, 675, 525. 28	
5 BEL GOVT 350328	1, 390, 000. 00	1, 675, 297. 50	
5 ITALY GOVT 250301	2, 150, 000. 00	2, 229, 919. 80	
5 ITALY GOVT 340801	1, 620, 000. 00	1, 756, 472. 04	
5 ITALY GOVT 390801	1, 820, 000. 00	1, 988, 790. 44	
5 ITALY GOVT 400901	1, 420, 000. 00	1, 556, 902. 20	
5. 15 SPAIN GOVT 281031	1, 100, 000. 00	1, 230, 546. 90	
5. 15 SPAIN GOVT 441031	1, 150, 000. 00	1, 411, 395. 00	
5. 25 ITALY GOVT 291101	2, 980, 000. 00	3, 287, 920. 42	
5. 4 IRISH GOVT 250313	1, 200, 000. 00	1, 273, 561. 92	
5. 5 BEL GOVT 280328	1, 610, 000. 00	1, 839, 698. 70	
5. 5 BUND 310104	1, 770, 000. 00	2, 204, 004. 00	
5. 5 NETH GOVT 280115	700, 000. 00	799, 464. 82	
5. 5 O. A. T 290425	3, 690, 000. 00	4, 312, 263. 15	
5. 625 BUND 280104	1, 850, 000. 00	2, 144, 497. 06	

	5.75 ITALY GOVT 330201	1,500,000.00	1,718,391.00	
	5.75 O.A.T 321025	2,730,000.00	3,447,959.97	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	2,000,000.00	2,435,154.99	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	1,800,000.00	1,982,575.80	
	6 ITALY GOVT 310501	2,770,000.00	3,220,474.02	
	6 O.A.T 251025	2,600,000.00	2,828,207.20	
	6 SPAIN GOVT 290131	2,600,000.00	3,044,028.00	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	900,000.00	1,035,426.69	
	6.25 BUND 300104	1,300,000.00	1,643,825.30	
	6.5 BUND 270704	1,070,000.00	1,260,734.99	
	6.5 ITALY GOVT 271101	1,720,000.00	1,956,740.11	
	7.25 ITALY GOVT 261101	900,000.00	1,023,596.19	
ユーロ合計		554,490,000.00	516,331,132.55 (72,632,300,415)	
合計			216,547,725,129 (216,547,725,129)	

(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 247 銘柄	100.00%	49.76%
カナダドル	国債証券 35 銘柄	100.00%	2.04%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.00%	1.59%
イギリスポンド	国債証券 57 銘柄	100.00%	4.86%
シンガポールドル	国債証券 18 銘柄	100.00%	0.48%
マレーシアリングット	国債証券 22 銘柄	100.00%	0.54%
ニュージーランドドル	国債証券 8 銘柄	100.00%	0.19%
スウェーデンクローネ	国債証券 8 銘柄	100.00%	0.21%
ノルウェークローネ	国債証券 9 銘柄	100.00%	0.20%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.32%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.00%	0.87%
イスラエルシェケル	国債証券 12 銘柄	100.00%	0.36%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.47%
中国元	国債証券 61 銘柄	100.00%	4.57%
ユーロ	国債証券 356 銘柄	100.00%	33.54%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

### ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

[令和5年3月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	60,561,862
コール・ローン	99,770,282
国債証券	8,935,877,845
派生商品評価勘定	341,358,168
未収入金	24,431,967
未収利息	98,923,752
前払費用	21,360,877
流動資産合計	9,582,284,753
資産合計	9,582,284,753
負債の部	
流動負債	
未払金	40,841,389
未払解約金	64,932,407
未払利息	33
流動負債合計	105,773,829
負債合計	105,773,829
純資産の部	
元本等	
元本	10,761,426,460
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△1,284,915,536
元本等合計	9,476,510,924
純資産合計	9,476,510,924
負債純資産合計	9,582,284,753

#### 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)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 期首	令和 4 年 3 月 26 日
期首元本額	6,107,710,139 円
期中追加設定元本額	14,004,201,981 円
期中一部解約元本額	9,350,485,660 円
元本の内訳※	
eMAXIS 新興国債券インデックス (為替ヘッジあり)	1,539,348,689 円
ラップ向けインデックス f 米ドル建て新興国債券 (為替ヘッジあり)	854,749 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	1,174,090,936 円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	261,215,869 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)	378,279,281 円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	264,272,563 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)	372,750,265 円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	263,028,387 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)	372,500,390 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)	370,234,599 円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	236,415,940 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)	382,245,543 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)	383,605,620 円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	237,389,808 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)	376,301,180 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)	366,441,416 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)	381,631,658 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)	398,551,706 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)	395,577,061 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)	418,262,983 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)	438,387,288 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)	436,051,392 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)	444,716,786 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)	426,594,147 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)	442,678,204 円
合計	10,761,426,460 円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,284,915,536 円
3. 受益権の総数	10,761,426,460 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 令和 4 年 3 月 26 日 至 令和 5 年 3 月 27 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。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)

国債証券	△274,059,625
合計	△274,059,625

(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

[令和 5 年 3 月 27 日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	9,389,728,141	—	9,048,369,973	341,358,168
合計		9,389,728,141	—	9,048,369,973	341,358,168

(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)

	[令和 5 年 3 月 27 日現在]
1口当たり純資産額	0.8806 円
(1万口当たり純資産額)	(8,806 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	0.55 CHINA GOVT I 251021	800,000.00	735,465.80	
		1 ARGENTINA 290709	91,576.00	23,337.18	

1. 2 CHINA GOVT IN 301021	400,000.00	342,921.96	
1. 25 CHINA GOVT I 261026	800,000.00	737,078.76	
1. 625 ABU DHABI G 280602	400,000.00	358,324.00	
1. 7 ABU DHABI GOV 310302	200,000.00	169,789.60	
1. 875 ABU DHABI G 310915	200,000.00	169,831.80	
2. 125 ABU DHABI G 240930	400,000.00	385,784.80	
2. 125 CHINA GOVT 291203	600,000.00	555,296.85	
2. 125 HUNGARY 310922	800,000.00	624,020.00	
2. 25 KSA SUKUK LT 310517	200,000.00	173,625.00	
2. 25 SAUDI INTERN 330202	600,000.00	499,273.20	
2. 252 PANAMA 320929	800,000.00	617,164.64	
2. 45 CHILE 310131	400,000.00	346,176.68	
2. 5 ABU DHABI GOV 250416	800,000.00	775,604.00	
2. 5 ABU DHABI GOV 290930	400,000.00	366,658.00	
2. 55 CHILE 320127	400,000.00	342,181.22	
2. 55 CHILE 330727	600,000.00	494,985.55	
2. 65 PHILIPPINE 451210	400,000.00	276,678.32	
2. 659 MEXICO 310524	600,000.00	500,715.25	
2. 7 ABU DHABI GOV 700902	200,000.00	126,907.00	
2. 75 CHILE 270131	400,000.00	378,378.75	
2. 78 PERU 601201	550,000.00	330,501.24	
2. 783 PERU 310123	1,050,000.00	902,822.36	
2. 875 BRAZIL 250606	400,000.00	383,588.00	
2. 9 SAUDI INTERNA 251022	600,000.00	579,120.00	
2. 969 KSA SUKUK L 291029	400,000.00	371,238.40	
3 COLOMBIA 300130	400,000.00	308,263.78	
3 PERU 340115	550,000.00	451,195.06	
3. 05 INDONESIA 510312	600,000.00	454,914.39	
3. 1 CHILE 410507	800,000.00	604,371.36	
3. 1 CHILE 610122	400,000.00	262,132.36	
3. 125 ABU DHABI G 300416	600,000.00	568,170.00	
3. 125 ABU DHABI G 490930	800,000.00	605,532.80	
3. 125 COLOMBIA 310415	600,000.00	448,322.49	
3. 125 HUNGARY 510921	600,000.00	374,016.00	
3. 16 PANAMA 300123	400,000.00	353,072.58	
3. 2 PHILIPPINE 460706	600,000.00	450,703.95	

3.25 CHINA GOVT I 231019	200,000.00	199,316.00	
3.25 COLOMBIA 320422	600,000.00	437,405.67	
3.25 MEXICO 300416	400,000.00	357,838.15	
3.25 SAUDI INTERN 301022	200,000.00	185,552.40	
3.25 UAE INT'L GO 611019	400,000.00	304,233.20	
3.4 QATAR 250416	800,000.00	784,363.20	
3.45 SAUDI INTERN 610202	200,000.00	143,608.00	
3.5 CHILE 340131	400,000.00	356,604.06	
3.5 CHILE 500125	600,000.00	450,872.53	
3.5 CHILE 530415	400,000.00	298,572.64	
3.5 MEXICO 340212	400,000.00	338,199.70	
3.55 PERU 510310	450,000.00	332,213.86	
3.75 BRAZIL 310912	600,000.00	520,062.66	
3.75 MEXICO 710419	400,000.00	262,629.24	
3.75 PHILIPPINE 290114	600,000.00	579,029.58	
3.75 QATAR 300416	600,000.00	587,629.20	
3.75 SAUDI INTERN 550121	400,000.00	312,615.20	
3.771 MEXICO 610524	600,000.00	400,392.22	
3.85 INDONESIA 301015	400,000.00	383,078.70	
3.87 PANAMA 600723	800,000.00	521,301.69	
3.875 ABU DHABI G 500416	800,000.00	685,426.40	
3.875 BRAZIL 300612	800,000.00	715,949.72	
4 QATAR 290314	1,000,000.00	996,976.00	
4 ROMANIA 510214	540,000.00	382,989.60	
4 SAUDI INTERNATI 250417	400,000.00	396,642.40	
4.05 UAE INT'L GO 320707	600,000.00	601,209.00	
4.125 COLOMBIA 510515	400,000.00	238,521.13	
4.2 INDONESIA 501015	400,000.00	350,113.04	
4.25 TURKEY 250313	400,000.00	378,268.00	
4.28 MEXICO 410814	600,000.00	486,433.98	
4.303 KSA SUKUK L 290119	200,000.00	201,032.40	
4.34 CHILE 420307	400,000.00	354,606.02	
4.375 SAUDI INTER 290416	600,000.00	602,719.20	
4.375 URUGUAY 310123	650,000.00	650,293.41	
4.4 MEXICO 520212	600,000.00	463,348.78	
4.4 PERUSAHAAN PE 270606	600,000.00	597,553.90	



4. 4 QATAR 500416	1,000,000.00	937,640.00	
4. 5 BRAZIL 290530	600,000.00	568,019.34	
4. 5 COLOMBIA 290315	600,000.00	523,135.00	
4. 5 DOMINICAN 300130	450,000.00	390,333.56	
4. 5 MEXICO 290422	600,000.00	586,471.08	
4. 5 MEXICO 500131	400,000.00	318,913.92	
4. 5 PANAMA 500416	600,000.00	458,078.61	
4. 5 PANAMA 560401	600,000.00	446,333.28	
4. 5 PANAMA 630119	400,000.00	289,491.14	
4. 5 QATAR 280423	200,000.00	203,606.00	
4. 5 SAUDI INTERNA 300417	200,000.00	201,454.80	
4. 5 SAUDI INTERNA 600422	400,000.00	353,714.00	
4. 7 PERUSAHAAN PE 320606	400,000.00	401,032.01	
4. 75 BRAZIL 500114	1,000,000.00	736,792.54	
4. 75 MEXICO 320427	400,000.00	383,723.98	
4. 75 SAUDI INTERN 280118	200,000.00	204,375.00	
4. 75 TURKEY 260126	600,000.00	556,602.00	
4. 817 QATAR 490314	1,200,000.00	1,188,493.20	
4. 85 SOUTH AFRICA 290930	600,000.00	537,648.00	
4. 875 DOMINICAN 320923	750,000.00	634,602.44	
4. 875 MEXICO 330519	400,000.00	381,760.66	
4. 875 OMAN SOVERE 300615	400,000.00	399,777.60	
4. 875 SAUDI INTER 330718	600,000.00	613,242.00	
4. 975 URUGUAY 550420	700,000.00	694,671.90	
5 MEXICO 510427	400,000.00	339,750.62	
5 SAUDI INTERNATI 490417	400,000.00	378,529.20	
5 SAUDI INTERNATI 530118	400,000.00	378,300.00	
5. 103 QATAR 480423	1,000,000.00	1,024,151.00	
5. 125 HAZINE MUST 260622	200,000.00	183,788.40	
5. 2 COLOMBIA 490515	800,000.00	543,597.06	
5. 25 HUNGARY 290616	400,000.00	393,147.20	
5. 25 SAUDI INTERN 500116	600,000.00	590,245.20	
5. 25 TURKEY 300313	400,000.00	336,052.00	
5. 268 KSA SUKUK L 281025	400,000.00	420,000.00	
5. 3 DOMINICAN 410121	300,000.00	232,925.99	
5. 5 DOMINICAN 290222	450,000.00	423,097.83	

5. 5 SAUDI INTERNA 321025	400,000.00	431,644.40	
5. 6 TURKEY 241114	600,000.00	585,684.00	
5. 75 SOUTH AFRICA 490930	800,000.00	584,742.40	
5. 875 ARAB REPUB 310216	400,000.00	236,648.40	
5. 875 DOMINICAN 600130	900,000.00	682,912.36	
5. 875 TURKEY 310626	400,000.00	338,402.40	
5. 932 OMAN SOVERE 251031	200,000.00	204,635.80	
5. 95 TURKEY 310115	200,000.00	171,920.80	
6 DOMINICAN 330222	600,000.00	547,111.56	
6 OMAN GOV INTERN 290801	600,000.00	604,684.20	
6. 125 HUNGARY 280522	400,000.00	411,306.40	
6. 125 TURKEY 281024	400,000.00	364,438.00	
6. 25 HUNGARY 320922	200,000.00	204,623.20	
6. 25 OMAN GOV INT 310125	600,000.00	610,275.00	
6. 35 MEXICO 350209	600,000.00	634,982.41	
6. 35 TURKEY 240810	400,000.00	398,408.00	
6. 375 TURKEY 251014	600,000.00	582,727.80	
6. 4 DOMINICAN 490605	450,000.00	374,306.23	
6. 4 PANAMA 350214	400,000.00	415,450.18	
6. 5 TURKEY 330920	200,000.00	173,009.60	
6. 876 UKRAINE 310521	200,000.00	36,646.40	
7. 125 ROMANIA 330117	400,000.00	425,130.00	
7. 25 HAZINE MUSTE 270224	200,000.00	194,102.00	
7. 253 UKRAINE 350315	600,000.00	105,750.00	
7. 3 SOUTH AFRICA 520420	400,000.00	345,920.00	
7. 375 NIGERIA REP 330928	400,000.00	269,772.00	
7. 5 ARAB REPUBLIC 610216	400,000.00	213,760.00	
7. 5 COLOMBIA 340202	200,000.00	193,717.22	
7. 6003 ARAB REPUB 290301	1,000,000.00	679,648.00	
7. 625 ARAB REPUB 320529	400,000.00	248,584.80	
7. 625 TURKEY 290426	600,000.00	578,500.80	
8 COLOMBIA 330420	800,000.00	809,486.60	
8. 6 TURKEY 270924	600,000.00	613,225.20	
8. 7002 ARAB REPUB 490301	400,000.00	230,753.60	
8. 875 ARAB REPUB 500529	400,000.00	232,724.80	
9. 375 TURKEY 330119	400,000.00	412,893.60	

	9.75 UKRAINE 301101	200,000.00	38,755.00	
	9.758 HAZINE MUST 251113	200,000.00	207,734.00	
	9.875 TURKEY 280115	600,000.00	631,866.00	
	FRN ARGENTINA 300709	2,450,000.00	638,899.06	
	FRN ARGENTINA 350709	2,800,000.00	656,809.32	
	FRN ARGENTINA 380109	1,900,000.00	540,027.72	
	FRN ARGENTINA 410709	1,400,000.00	355,737.17	
	FRN ARGENTINA 460709	155,500.00	37,023.88	
	FRN ECUADOR 300731	1,000,000.00	499,283.05	
	FRN ECUADOR 350731	2,350,000.00	822,573.57	
	FRN ECUADOR 400731	800,000.00	259,046.67	
アメリカドル合計		87,937,076.00	68,395,544.17 (8,935,877,845)	
合計			8,935,877,845 (8,935,877,845)	

(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 157 銘柄	100.00%	100.00%

#### 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3月28日から2023年9月27日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC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

#### 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 バランス・イノベーション（株式抑制型）の2023年3月28日から2023年9月27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 バランス・イノベーション（株式抑制型）の2023年9月27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3月28日から2023年9月27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、継続企業的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 バランス・イノベーション（株式抑制型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 [ 2023年3月27日現在 ]	第11期中間計算期間末 [ 2023年9月27日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,664,777,430	359,554,471
親投資信託受益証券	17,273,657,493	16,968,236,058
未収入金	422,000,000	934,000,000
流動資産合計	19,360,434,923	18,261,790,529
資産合計	19,360,434,923	18,261,790,529
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	23,203,307	8,602,575
未払受託者報酬	5,428,812	5,199,161
未払委託者報酬	135,720,202	129,978,953
未払利息	555	778
その他未払費用	390,819	374,274
流動負債合計	164,743,695	144,155,741
負債合計	164,743,695	144,155,741
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,743,252,194	16,654,021,814
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,452,439,034	1,463,612,974
（分配準備積立金）	646,516,838	606,364,749
元本等合計	19,195,691,228	18,117,634,788
純資産合計	19,195,691,228	18,117,634,788
負債純資産合計	19,360,434,923	18,261,790,529

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期中間計算期間 自 2022年3月26日 至 2022年9月25日	第11期中間計算期間 自 2023年3月28日 至 2023年9月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,407	1,604
有価証券売買等損益	△400,626,649	251,578,565
営業収益合計	△400,621,242	251,580,169
<b>営業費用</b>		
支払利息	914,984	153,423
受託者報酬	5,844,721	5,199,161
委託者報酬	146,117,986	129,978,953
その他費用	420,755	374,274

営業費用合計	153,298,446	135,705,811
営業利益又は営業損失(△)	△553,919,688	115,874,358
経常利益又は経常損失(△)	△553,919,688	115,874,358
中間純利益又は中間純損失(△)	△553,919,688	115,874,358
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(△)	△10,617,224	15,718,943
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,546,788,477	1,452,439,034
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,614,827	1,259,448
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,614,827	1,259,448
剰余金減少額又は欠損金増加額	116,186,501	90,240,923
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	116,186,501	90,240,923
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	1,892,914,339	1,463,612,974

### (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は2023年3月28日から2023年9月27日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27日現在]
1. 期首元本額	19,265,644,331円	17,743,252,194円
期中追加設定元本額	66,798,497円	13,112,251円
期中一部解約元本額	1,589,190,634円	1,102,342,631円
2. 受益権の総数	17,743,252,194口	16,654,021,814口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期中間計算期間 自2022年3月26日 至2022年9月25日	第11期中間計算期間 自2023年3月28日 至2023年9月27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10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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>	<p>(3) 上記以外の金融商品  同左</p> <p>同左</p>
----------------------------	--	--

(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10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27日現在]
1口当たり純資産額	1,0819円	1,0879円
(1万口当たり純資産額)	(10,819円)	(10,879円)



三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

#### 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 バランス・イノベーション（株式重視型）の2023年3月28日から2023年9月27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 バランス・イノベーション（株式重視型）の2023年9月27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3月28日から2023年9月27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、継続企業的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 バランス・イノベーション（株式重視型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 [ 2023年3月27日現在 ]	第11期中間計算期間末 [ 2023年9月27日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	428,473,405	407,303,748
親投資信託受益証券	19,281,578,605	17,805,642,882
未収入金	446,000,000	1,709,000,000
流動資産合計	20,156,052,010	19,921,946,630
資産合計	20,156,052,010	19,921,946,630
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	21,350,277	24,360,495
未払受託者報酬	5,706,450	5,555,039
未払委託者報酬	142,661,139	138,875,903
未払利息	142	882
その他未払費用	410,807	399,902
流動負債合計	170,128,815	169,192,221
負債合計	170,128,815	169,192,221
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	16,004,523,401	14,954,549,686
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	3,981,399,794	4,798,204,723
(分配準備積立金)	1,809,391,171	1,683,322,457
元本等合計	19,985,923,195	19,752,754,409
純資産合計	19,985,923,195	19,752,754,409
負債純資産合計	20,156,052,010	19,921,946,630

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期中間計算期間 自 2022年3月26日 至 2022年9月25日	第11期中間計算期間 自 2023年3月28日 至 2023年9月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,504	1,608
有価証券売買等損益	△314,840,773	1,275,667,101
営業収益合計	△314,835,269	1,275,668,709
<b>営業費用</b>		
支払利息	849,102	155,455
受託者報酬	6,107,567	5,555,039
委託者報酬	152,689,066	138,875,903
その他費用	439,683	399,902

営業費用合計	160,085,418	144,986,299
営業利益又は営業損失(△)	△474,920,687	1,130,682,410
経常利益又は経常損失(△)	△474,920,687	1,130,682,410
中間純利益又は中間純損失(△)	△474,920,687	1,130,682,410
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(△)	△4,834,431	56,642,351
期首剰余金又は期首欠損金(△)	5,526,216,415	3,981,399,794
剰余金増加額又は欠損金減少額	53,844,062	20,683,786
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	53,844,062	20,683,786
剰余金減少額又は欠損金増加額	253,588,953	277,918,916
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	253,588,953	277,918,916
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	4,856,385,268	4,798,204,723

### (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は2023年3月28日から2023年9月27日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27日現在]
1. 期首元本額	17,165,644,448円	16,004,523,401円
期中追加設定元本額	255,946,355円	66,969,048円
期中一部解約元本額	1,417,067,402円	1,116,942,763円
2. 受益権の総数	16,004,523,401口	14,954,549,686口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期中間計算期間 自2022年3月26日 至2022年9月25日	第11期中間計算期間 自2023年3月28日 至2023年9月27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10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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>	<p>(3) 上記以外の金融商品  同左</p> <p>同左</p>
----------------------------	--	--

(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10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27日現在]
1口当たり純資産額	1,248 円	1,320 円
(1万口当たり純資産額)	(12,488 円)	(13,209 円)

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

#### 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 バランス・イノベーション（新興国投資型）の2023年3月28日から2023年9月27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 バランス・イノベーション（新興国投資型）の2023年9月27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3月28日から2023年9月27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、継続企業的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 バランス・イノベーション（新興国投資型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 [ 2023年3月27日現在 ]	第11期中間計算期間末 [ 2023年9月27日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	89,469,385	88,395,866
親投資信託受益証券	4,089,503,973	3,301,141,892
未収入金	205,000,000	1,028,000,000
流動資産合計	4,383,973,358	4,417,537,758
資産合計	4,383,973,358	4,417,537,758
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,032,768	6,285,845
未払受託者報酬	1,258,298	1,221,595
未払委託者報酬	31,457,523	30,539,973
未払利息	29	191
その他未払費用	90,537	87,894
流動負債合計	33,839,155	38,135,498
負債合計	33,839,155	38,135,498
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,908,166,997	3,741,006,986
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	441,967,206	638,395,274
(分配準備積立金)	197,797,272	188,898,043
元本等合計	4,350,134,203	4,379,402,260
純資産合計	4,350,134,203	4,379,402,260
負債純資産合計	4,383,973,358	4,417,537,758

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期中間計算期間 自 2022年3月26日 至 2022年9月25日	第11期中間計算期間 自 2023年3月28日 至 2023年9月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	951	355
有価証券売買等損益	△208,702,910	253,917,919
営業収益合計	△208,701,959	253,918,274
<b>営業費用</b>		
支払利息	136,658	30,904
受託者報酬	1,358,576	1,221,595
委託者報酬	33,964,313	30,539,973
その他費用	97,755	87,894



営業費用合計	35,557,302	31,880,366
営業利益又は営業損失(△)	△244,259,261	222,037,908
経常利益又は経常損失(△)	△244,259,261	222,037,908
中間純利益又は中間純損失(△)	△244,259,261	222,037,908
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(△)	△6,049,285	7,068,972
期首剰余金又は期首欠損金(△)	878,724,641	441,967,206
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,068,634	1,372,011
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,068,634	1,372,011
剰余金減少額又は欠損金増加額	49,814,699	19,912,879
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	49,814,699	19,912,879
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	593,768,600	638,395,274

### (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年3月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は2023年3月28日から2023年9月27日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27日現在]
1. 期首元本額	4,322,205,525円	3,908,166,997円
期中追加設定元本額	31,065,353円	8,872,708円
期中一部解約元本額	445,103,881円	176,032,719円
2. 受益権の総数	3,908,166,997口	3,741,006,986口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期中間計算期間 自2022年3月26日 至2022年9月25日	第11期中間計算期間 自2023年3月28日 至2023年9月27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10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左

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

(有価証券に関する注記)  
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)  
取引の時価等に関する事項  
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第10期 [2023年3月27日現在]	第11期中間計算期間末 [2023年9月27日現在]
1口当たり純資産額	1,1131円	1,1706円
(1万口当たり純資産額)	(11,131円)	(11,706円)

(参考)

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

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年9月27日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	53,978,032,105
株式	1,165,887,219,520
派生商品評価勘定	21,359,450
未収入金	168,687,870
未収配当金	450,276,216
未収利息	1,772,372
前払金	106,340,000
その他未収収益	8,877,544
差入委託証拠金	675,675,000
流動資産合計	1,221,298,240,077
資産合計	1,221,298,240,077
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	76,075,900
未払金	11,868,437,831
未払解約金	418,726,020
未払利息	116,932
受入担保金	34,873,185,443
流動負債合計	47,236,542,126
負債合計	47,236,542,126
純資産の部	
元本等	
元本	410,918,215,351
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	763,143,482,600
元本等合計	1,174,061,697,951
純資産合計	1,174,061,697,951
負債純資産合計	1,221,298,240,077

## 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9月27日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	368,050,508,229円
期中追加設定元本額	112,992,350,885円
期中一部解約元本額	70,124,643,763円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,702,343,073円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	849,616,303円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,722,324,818円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,552,247,112円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,473,543,828円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	6,484,769,032円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	35,754,417,966円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	41,585,212,414円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	95,833,605円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	264,335,999円
ファンド・マネジャー(国内株式)	741,230,777円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,289,663,309円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,143,242,103円
eMAXIS バランス(波乗り型)	444,378,645円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	2,802,081,093円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	851,846,663円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年	1,043,797,928円

金)	
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	992,654,763円
eMAXIS Slim 国内株式 (TOPIX)	32,497,360,174円
国内株式セレクション (ラップ向け)	4,471,710,426円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	9,881,501,445円
つみたて日本株式 (TOPIX)	8,128,124,463円
つみたて8資産均等バランス	4,757,455,474円
つみたて4資産均等バランス	1,625,406,020円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,559,879円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,504,128円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	8,181,603円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	688,012,866円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	856,347,116円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	580,367,290円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	557,874,350円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,729,808,746円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	3,708,153,153円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,023,959,901円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	3,592,147,570円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	510,262,290円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	153,088,457円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	15,508,363,616円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	222,171,910円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,804,657,296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)	2,041,168,583円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1,149,752,522円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	27,657,638円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	9,958,913,720円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	155,944,649円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	20,498,421円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	41,657,413円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	1,620,881円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	1,393,248,220円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,946,466,972円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	491,557,811円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1,579,488,919円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	380,977,061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)	669,733,947円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	131,902,835円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	162,905,792円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	593,645,787円
eMAXIS 最適化バランス (マイフワード)	483,002,551円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	952,029,761円
三菱UFJ トピックスオープン	986,266,166円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,937,742,563円

三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	55,213,774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)	4,676,651,821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)	10,899円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,959,945円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,112,605,707円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	74,772,828円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,352,938,729円
MUAM 日本株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	42,045,855,533円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	205,046,174円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	232,650円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	134,308円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	218,326,038円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	378,900,906円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,359,058,329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)	4,117,971,678円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	1,274,015,590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)	83,236,768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)	3,774,435,349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)	3,026,106,639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)	296,254,101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)	20,502,081,532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)	110,984,296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)	102,755,479円
日本株式インデックスファンドS	2,035,436,528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)	97,295,626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)	273,907,682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)	619,589,861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	5,183,343,899円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,850,270円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	7,485,861円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,524,442円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	6,206,079円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	508,432,291円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	89,905,980円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,167,422円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	28,553,334円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,495,497円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	18,072,260円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,578,075,158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)	347,751,996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)	1,476,239,284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)	1,396,254,902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)	1,302,673,164円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	58,423,949,987円
合計	410,918,215,351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	33,118,684,010円
3. 受益権の総数	410,918,215,351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9月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)  
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)  
取引の時価等に関する事項

株式関連

[2023年9月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	17,479,930,000	—	17,425,620,000	△54,310,000
合計		17,479,930,000	—	17,425,620,000	△54,310,000

(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ぬ。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありませぬ。

(1口当たり情報)

	[2023年9月27日現在]
1口当たり純資産額	2.8572円
(1万口当たり純資産額)	(28,572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9月27日現在]

資産の部

流動資産

預金

10,375,949,928

コール・ローン	31,307,456,233
株式	2,970,667,923,936
投資証券	58,927,905,368
派生商品評価勘定	9,370,847
未収入金	27,843,448
未収配当金	3,356,307,254
差入委託証拠金	46,617,758,161
流動資産合計	3,121,290,515,175
資産合計	3,121,290,515,175
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,473,167,764
未払金	500,687,209
未払解約金	22,561,696,903
未払利息	67,821
流動負債合計	25,535,619,697
負債合計	25,535,619,697
純資産の部	
元本等	
元本	560,136,172,226
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,535,618,723,252
元本等合計	3,095,754,895,478
純資産合計	3,095,754,895,478
負債純資産合計	3,121,290,515,175

## 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。 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9月27日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	470,141,826,649円
期中追加設定元本額	124,959,212,902円
期中一部解約元本額	34,964,867,325円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	195,845,232円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	939,283,121円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	870,013,549円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,966,522,855円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	4,342,244,952円



三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	1,494,820,213 円
三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	9,022,327,781 円
三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	10,185,038,052 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	47,848,619 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	132,888,436 円
ファンド・マネジャー (海外株式)	779,318 円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,909,918,387 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	1,073,104,040 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	73,398,945 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1,715,711,736 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	216,043,608 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	275,093,586 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	246,231,599 円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	95,320,322,534 円
海外株式セレクション (ラップ向け)	2,523,073,707 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	4,896,755,280 円
つみたて先進国株式	27,815,146,347 円
つみたて8資産均等バランス	2,373,490,758 円
つみたて4資産均等バランス	833,268,106 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,926,419 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,551,616 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	6,314,185 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	175,391,769 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	218,773,296 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	144,299,373 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	68,317,684 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	508,393,522 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,290,586,313 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	49,267,835,130 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	521,102,428 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	4,018,365,434 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	219,513,467,180 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	132,942,623 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	42,179,203 円
つみたて全世界株式	308,917,988 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	58,254,168 円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,535,259,999 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	29,801,136 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	4,175,927,611 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	65,832,192 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	419,692 円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	30,877,086,350 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	5,081,139,426 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	544,189,460 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,193,566,616 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	146,443,254 円

三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	611,312,129円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	193,890,900円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	340,808,900円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	83,487,729円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	115,049,329円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	472,100,084円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	378,028,617円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	735,143,201円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,392,067,958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)	2,750円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	4,874,001円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,480,162,821円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	37,938,437円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	690,559,150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)	9,490,248,525円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	68,408円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	545,386,428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)	5,404,481,516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)	1,618,501,880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)	500,570,542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)	50,965,855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)	1,840,991,314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)	2,237,058,477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)	189,762,741円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定)	8,845,266,944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)	43,646,594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)	2,708,218,037円
海外株式インデックスファンドS	4,386,251,207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)	25,098,136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)	7,076,875円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,812,474,106円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	715,772円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	1,889,261円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	441,687円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,968,727円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	23,232,100円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	793,631円

三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	7,199,539円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	753,001円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	9,196,313円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,742,389,780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)	87,760,146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)	374,597,679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)	406,210,794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)	413,420,889円
合計	560,136,172,226円
2. 受益権の総数	560,136,172,226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9月27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9月27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	73,188,768,196	—	70,723,812,185	△2,464,956,011
合計		73,188,768,196	—	70,723,812,185	△2,464,956,011

(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9月27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	10,327,553,055	—	10,334,231,816	6,678,761
	カナダドル	439,713,261	—	438,587,504	△1,125,757
	オーストラリアドル	265,871,139	—	265,154,586	△716,553
	イギリスポンド	586,893,322	—	585,229,960	△1,663,362
	スイスフラン	373,424,060	—	372,580,448	△843,612
	香港ドル	79,362,600	—	79,371,098	8,498
	シンガポールドル	51,522,083	—	51,462,917	△59,166
	スウェーデンクローネ	109,628,643	—	110,088,546	459,903
	ノルウェークローネ	21,272,151	—	21,242,815	△29,336
	デンマーククローネ	113,277,968	—	113,144,854	△133,114
	ユーロ	1,232,324,820	—	1,230,907,652	△1,417,168
合計		13,600,843,102	—	13,602,002,196	1,159,094

(注) 時価の算定方法

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

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

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

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報)

	[2023年9月27日現在]
1口当たり純資産額	5.5268円
(1万口当たり純資産額)	(55,268円)

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

[2023年9月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	18,453,525,771
コール・ローン	2,928,625,002
株式	489,595,257,661
投資証券	590,992,642
派生商品評価勘定	2,555,077
未収入金	16,430,630
未収配当金	1,046,130,411
差入委託証拠金	2,570,113,389
流動資産合計	515,203,630,583
資産合計	515,203,630,583
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	684,586,549
未払金	693,755
未払解約金	392,928,165
未払利息	6,344
流動負債合計	1,078,214,813
負債合計	1,078,214,813
純資産の部	
元本等	
元本	155,138,090,511
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	358,987,325,259
元本等合計	514,125,415,770
純資産合計	514,125,415,770
負債純資産合計	515,203,630,583

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2023年9月27日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	132,357,255,077円
期中追加設定元本額	32,430,447,784円
期中一部解約元本額	9,649,612,350円

元本の内訳※	
MAXIS 全世界株式 (オール・カントリー) 上場投信	931,644,024 円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,930,016,949 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	1,772,642,904 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	73,984,197 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	578,511,018 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	8,218,150,606 円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	36,461,898,931 円
つみたて新興国株式	7,843,944,609 円
つみたて8資産均等バランス	3,962,796,245 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	536,710 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,667,430 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,254,278 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	10,570,611,325 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	868,619,518 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	47,098,937,374 円
新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け)	2,493,000,916 円
つみたて全世界株式	66,281,553 円
ラップ向けインデックスf 新興国株式	890,085,974 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	47,918,887 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	1,029,884,330 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	780,574,577 円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	16,105,239,158 円
新興国株式インデックスオープン	500,667,941 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,090,184,122 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	103,931,217 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	34,093,892 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	197,867,375 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	204,048,076 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	838,947,860 円
MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	1,148,397,118 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	17,184,874 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)	1,519,965 円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	56,902,468 円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	57,042,266 円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	56,220,682 円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	49,764,870 円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	47,116,272 円
合計	155,138,090,511 円
2. 受益権の総数	155,138,090,511 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9月27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)

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9月27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	22,320,644,463	—	21,636,057,921	△684,586,542
合計		22,320,644,463	—	21,636,057,921	△684,586,542

(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9月27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	2,486,792,759	—	2,489,316,236	2,523,477
	売建 アメリカドル	2,354,748,260	—	2,354,716,660	31,600
	オフショア円	75,919	—	75,926	△7
合計		4,841,616,938	—	4,844,108,822	2,555,070

(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9月27日現在]	
1口当たり純資産額	3,3140円
(1万口当たり純資産額)	(33,140円)

(追加情報)

自 2023年 3月 28日 至 2023年 9月 27日
<p>当ファンドは、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、「当該株式」）を組み入れております。2022年2月24日に発生したロシアのウクライナ侵攻による当ファンドへの影響は以下の通りです。</p> <p>ロシアが、2022年2月24日に首都キーウを含むウクライナ国内の複数の都市への軍事侵攻に踏み切って以降、期末日時点においてロシア軍とウクライナ軍の戦闘が続いております。</p> <p>2022年2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やSWIFTからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。</p> <p>時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022年3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。2022年3月11日時点の当ファンドにおける当該株式の保有割合は0.55%です。</p> <p>なお、2022年3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。</p> <p>今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。</p>

国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2023年9月27日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,101,788,180
国債証券	138,057,373,780
地方債証券	9,057,654,100
特殊債券	9,093,930,026
社債券	11,021,346,300
未収入金	100,555,000
未収利息	179,798,335
前払金	1,380,000
前払費用	6,399,748
差入委託証拠金	3,240,000



流動資産合計	168,623,465,469
資産合計	168,623,465,469
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,421,870
未払金	11,860,626,000
未払解約金	82,877,713
未払利息	2,386
流動負債合計	11,944,927,969
負債合計	11,944,927,969
純資産の部	
元本等	
元本	169,206,885,568
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△12,528,348,068
元本等合計	156,678,537,500
純資産合計	156,678,537,500
負債純資産合計	168,623,465,469

#### 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9月27日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	162,384,089,172円
期中追加設定元本額	225,698,780,080円
期中一部解約元本額	218,875,983,684円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー(国内債券)	22,528,801,132円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	3,232,981,087円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	47,898,532円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	8,067,963円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	16,994,930円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	5,905,191,659円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	314,180,801円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	6,633,043,845円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	5,329,094,400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)	17,373,513,344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)	5,426,160,898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)	16,686,602,279円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	2,006,612,386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)	83,224,269,456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）	473,472,856 円
合計	169,206,885,568 円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	12,528,348,068 円
3. 受益権の総数	169,206,885,568 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9月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>（3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2023年9月27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	292,000,000	—	290,580,000	△1,420,000
合計		292,000,000	—	290,580,000	△1,420,000

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報）

	[2023年9月27日現在]
1口当たり純資産額	0.9260 円
(1万口当たり純資産額)	(9,260 円)

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[2023年9月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	5,968,874,593
コール・ローン	1,671,251,448
国債証券	307,595,929,931
派生商品評価勘定	1,772,893,197
未収入金	17,526,003
未収利息	2,166,493,956
前払費用	229,768,501
流動資産合計	319,422,737,629
資産合計	319,422,737,629
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,179,385,888
未払金	7,123,022,803
未払解約金	45,853,935
未払利息	3,620
流動負債合計	11,348,266,246
負債合計	11,348,266,246
純資産の部	
元本等	
元本	282,400,572,306
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	25,673,899,077
元本等合計	308,074,471,383
純資産合計	308,074,471,383
負債純資産合計	319,422,737,629

## 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9月27日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	194,810,700,487円
期中追加設定元本額	106,679,540,239円
期中一部解約元本額	19,089,668,420円

元本の内訳※

eMAXIS 先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)	799,079,700 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	8,138,185,234 円
ラップ向けインデックス f 先進国債券 (為替ヘッジあり)	4,238,764,076 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	127,316,657 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	4,135,680,137 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,557,882,003 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	214,666,458 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	4,604,517,057 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	2,204,066,320 円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	90,542,813 円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド (適格機関投資家転売制限付)	114,459,527,693 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	9,784,893,101 円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	12,285,863,429 円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	3,775,881,417 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	692,681,446 円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)	11,289,973,338 円
MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)	822,072,485 円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	18,124,522,545 円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン (適格機関投資家限定)	6,255,258,880 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)	475,223,683 円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定)	59,626,019,138 円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) 2 (適格機関投資家転売制限付)	329,562,431 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,556,895 円
MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	2,365,420,715 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	325,643,502 円
MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	2,343,030,209 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	322,196,277 円
MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定)	2,337,540,561 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	322,720,012 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	321,351,725 円
MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	2,068,605,531 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	315,633,120 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	316,748,113 円
MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定)	2,100,241,630 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	312,894,225 円

MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	315,490,691 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	315,059,067 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	329,350,862 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	336,722,167 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	352,830,037 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	359,565,752 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	371,026,379 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	388,518,761 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	376,017,480 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	388,520,282 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	381,708,272 円
合計	282,400,572,306 円
2. 受益権の総数	282,400,572,306 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9月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2023年9月27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	992,583,090	992,557,782	△25,308
イギリスポンド	85,044,620	85,043,680	△940
中国元	146,326,246	146,367,172	40,926
ユーロ	515,996,480	515,987,624	△8,856
売建			
アメリカドル	151,231,158,925	154,771,099,419	△3,539,940,494
カナダドル	6,212,688,864	6,364,242,400	△151,553,536
オーストラリアドル	4,616,703,755	4,650,795,870	△34,092,115
イギリスポンド	15,945,086,159	15,594,345,000	350,741,159
シンガポールドル	1,365,343,595	1,375,362,395	△10,018,800
マレーシアリング	1,707,574,976	1,725,943,984	△18,369,008
ニュージーランドドル	664,787,712	679,695,360	△14,907,648
スウェーデンクローネ	591,298,400	595,245,200	△3,946,800
ノルウェークローネ	498,820,976	498,788,324	32,652
デンマーククローネ	966,982,380	953,930,640	13,051,740
メキシコペソ	3,227,810,472	3,166,863,264	60,947,208
イスラエルシェケル	888,133,477	897,617,821	△9,484,344
ポーランドズロチ	1,639,685,640	1,577,016,252	62,669,388
中国元	20,713,421,450	21,109,637,640	△396,216,190
ユーロ	105,140,526,644	103,855,938,369	1,284,588,275
合計	317,149,973,861	319,556,478,196	△2,406,492,691

(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9月27日現在]
1口当たり純資産額	1.0909円
(1万口当たり純資産額)	(10,909円)

## ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

[2023年9月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	83,712,740
コール・ローン	34,163,039
国債証券	8,837,335,872
未収利息	119,023,633
前払費用	8,739,420
流動資産合計	9,082,974,704
資産合計	9,082,974,704
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	239,627,492
未払金	6,217,008
未払解約金	31
未払利息	74
流動負債合計	245,844,605
負債合計	245,844,605
純資産の部	
元本等	
元本	10,474,079,566
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△1,636,949,467
元本等合計	8,837,130,099
純資産合計	8,837,130,099
負債純資産合計	9,082,974,704

## 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9月27日現在]
1. 期首	2023年3月28日
期首元本額	10,761,426,460円
期中追加設定元本額	2,278,564,041円
期中一部解約元本額	2,565,910,935円
元本の内訳※	
eMAXIS 新興国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,706,095,675円

ラップ向けインデックス f 米ドル建て新興国債券（為替ヘッジあり）	853,997 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	258,102,674 円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	273,337,177 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）	378,279,281 円
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	271,839,024 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）	372,750,265 円
MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	270,032,187 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）	372,500,390 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）	370,234,599 円
MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	239,050,787 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）	382,245,543 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）	383,605,620 円
MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	236,692,582 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）	376,301,180 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）	366,441,416 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）	381,631,658 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）	398,551,706 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）	395,577,061 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）	418,262,983 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）	438,387,288 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）	436,051,392 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）	439,754,762 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）	426,594,147 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）	439,744,682 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）	441,161,490 円
合計	10,474,079,566 円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,636,949,467 円
3. 受益権の総数	10,474,079,566 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9月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差	時価で計上しているためその差額はありませぬ。



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

(有価証券に関する注記)  
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)  
取引の時価等に関する事項  
通貨関連

[2023年9月27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	146,055,770	—	146,052,046	△3,724
	売建 アメリカドル	8,903,714,252	—	9,143,338,020	△239,623,768
合計		9,049,770,022	—	9,289,390,066	△239,627,492

(注) 時価の算定方法

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

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

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

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報)

	[2023年9月27日現在]
1口当たり純資産額	0.8437円
(1万口当たり純資産額)	(8,437円)

## 2【ファンドの現況】

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

【純資産額計算書】

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	18,051,150,147
II 負債総額	15,505,041
III 純資産総額 (I - II)	18,035,645,106
IV 発行済口数	16,642,851,492口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.0837
(10,000口当たり)	(10,837)

【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

【純資産額計算書】

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	19,678,739,284
II 負債総額	35,396,053
III 純資産総額 (I - II)	19,643,343,231
IV 発行済口数	14,936,751,968口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.3151
(10,000口当たり)	(13,151)

【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

【純資産額計算書】

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	4,354,862,646
II 負債総額	356,691
III 純資産総額 (I - II)	4,354,505,955
IV 発行済口数	3,741,103,857口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.1640
(10,000口当たり)	(11,640)

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,196,728,859,419
II 負債総額	35,506,075,695
III 純資産総額 (I - II)	1,161,222,783,724
IV 発行済口数	412,578,708,183口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.8145
(10,000口当たり)	(28,145)

#### 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9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	3,137,957,106,534
II 負債総額	5,804,925,754
III 純資産総額 (I - II)	3,132,152,180,780
IV 発行済口数	561,380,798,153口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	5.5794
(10,000口当たり)	(55,794)

#### 新興国株式インデックスマザーファンド

##### 純資産額計算書

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	517,667,118,156
II 負債総額	3,532,696,673
III 純資産総額 (I - II)	514,134,421,483
IV 発行済口数	154,765,991,981口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.3220
(10,000口当たり)	(33,220)

#### 国内債券インデックスマザーファンド

##### 純資産額計算書

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	169,337,349,889
--------	-----------------

II 負債総額	1,267,504,817
III 純資産総額 (I - II)	168,069,845,072
IV 発行済口数	181,920,472,586口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9239
(10,000口当たり)	(9,239)

#### ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

##### 純資産額計算書

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	316,147,728,510
II 負債総額	7,195,228,918
III 純資産総額 (I - II)	308,952,499,592
IV 発行済口数	284,687,953,589口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.0852
(10,000口当たり)	(10,852)

#### ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

##### 純資産額計算書

2023年9月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	9,780,483,127
II 負債総額	665,164,395
III 純資産総額 (I - II)	9,115,318,732
IV 発行済口数	10,924,972,560口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.8344
(10,000口当たり)	(8,344)

#### 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たがって取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

2023年10月1日現在、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は是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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。

2023 年 9 月 29 日現在における三菱UFJ 国際投信株式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	862	26,640,348
追加型公社債投資信託	16	1,581,558
単位型株式投資信託	89	403,864
単位型公社債投資信託	49	98,372
合 計	1,016	28,724,142

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。

(ご参考) 2023年9月29日現在におけるエム・ユー投資顧問株式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	35	233,496
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	12	32,898
単位型公社債投資信託	1	6,688
合 計	48	273,081

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) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ国際投信株式会社（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。

なお、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。



# 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。

## (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

#### 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 バランス・イノベーション（株式抑制型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

## 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）

### 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、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

- ① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。
- ② 株式の実質組入比率は、株式組入れを比較的抑えつつ、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。
- ③ 債券の実質組入比率は、原則として、先進国債券を一定の比率とし、残りの部分は国内債券等を組入れます。
- ④ 国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。
- ⑤ マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ⑥ 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑦ 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

##### (3) 投資制限

- ① 株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
- ⑥ 有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦ スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑨ 外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

#### 3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

- ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ③収益の分配にあてなか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 バランス・イノベーション（株式抑制型）』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、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

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

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金500億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2028年3月24日まで、または第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については500億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受



益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」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30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受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付けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

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

（投資の対象とする資産の種類等）

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

- 1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - イ. 有価証券
    - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）
    - ハ. 約束手形
    - ニ. 金銭債権
  - 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
    - イ. 為替手形
- ② デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相

場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（以下これらを総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
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、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

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

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

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

（利害関係人等との取引等）

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

信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

#### （運用の基本方針）

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

#### （投資する株式等の範囲）

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

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式について、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・スタンレー株式については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替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25条に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

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

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

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

（スワップ取引の運用指図）

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

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

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

② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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25条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（こ

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

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

(有価証券の貸付の指図および範囲)

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

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

(有価証券の空売りの指図範囲)

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

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

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

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第30条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 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31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
  2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
  3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。



(有価証券売却等の指図)

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

(再投資の指図)

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

(資金の借入れ)

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- ③ 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第39条 この信託の計算期間は、毎年3月26日から翌年3月25日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は2013年10月25日から2014年3月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に

欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税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130の率を乗じて得た額とします。

② 前項の信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代

金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとし、当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(収益分配金および償還金の時効)

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとし、
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとし、

- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

(信託契約の解約)

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に

関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

(反対者の買取請求権)

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(信託期間の延長)

第55条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の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57条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

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

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金

額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

信託契約締結日 2013年10月25日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日



追加型証券投資信託

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

## 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）

### 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、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

- ① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。
- ② 株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。
- ③ 債券の実質組入比率は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りの部分は国内債券等を組入れます。
- ④ 国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。
- ⑤ マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ⑥ 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑦ 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

##### (3) 投資制限

- ① 株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
- ⑥ 有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦ スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑧ 金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑨ 外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

#### 3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分

配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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

追加型証券投資信託  
『三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）』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、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

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

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金500億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2028年3月24日まで、または第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については500億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受

益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」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30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受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付けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

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

（投資の対象とする資産の種類等）

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

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

- ② デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相

場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（以下これらを総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
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、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

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

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

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

（利害関係人等との取引等）

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



信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

#### （運用の基本方針）

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

#### （投資する株式等の範囲）

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

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式について、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・スタンレー株式については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替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25条に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

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

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

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

（スワップ取引の運用指図）

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

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

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

② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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25条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（こ

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

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

(有価証券の貸付の指図および範囲)

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

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

(有価証券の空売りの指図範囲)

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

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

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

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第30条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- 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31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
  2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
  3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

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

(再投資の指図)

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

(資金の借入れ)

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- ③ 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第39条 この信託の計算期間は、毎年3月26日から翌年3月25日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は2013年10月25日から2014年3月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に

欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税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130の率を乗じて得た額とします。

② 前項の信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代

金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとし、当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

(収益分配金および償還金の時効)

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(信託契約の一部解約)

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとし、
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとし、

- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

(信託契約の解約)

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に



関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

(反対者の買取請求権)

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(信託期間の延長)

第55条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の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57条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

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

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金

額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

信託契約締結日 2013年10月25日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

追加型証券投資信託

三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

# 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）

## 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、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

- ① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。
- ② 株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。
- ③ 債券の実質組入比率は、原則として、国内債券、先進国債券および新興国債券を均等とします。
- ④ 国内外の債券市場が下落した場合等に債券への実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。
- ⑤ マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ⑥ 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑦ 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

#### (3) 投資制限

- ① 株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ② 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
- ⑥ 有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦ スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑧ 金利先渡し取引および為替先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑨ 外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

### 3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

追加型証券投資信託  
『三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）』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、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

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

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金500億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2028年3月24日まで、または第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については500億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受



益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」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30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは

は流動性の極端な減少等)があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金(第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

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

(投資の対象とする資産の種類等)

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

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

- ② デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。
- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（投資の対象とする有価証券等）

第17条 この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（以下これらを総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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

ます。)

18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 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、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ④ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- ⑤ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下本項および次項において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(利害関係人等との取引等)

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

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

(投資する株式等の範囲)

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

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式会社について、委託者が議決権行使権限を委託する、または、議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使している場合に限り。）において投資するモルガン・スタンレー株式会社については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替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、

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25条に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）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の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

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

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

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

（スワップ取引の運用指図）

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

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

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

② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に規定する信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れ

が必要と認めるときは、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25条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債(この信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

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

(有価証券の貸付の指図および範囲)

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

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

(有価証券の空売りの指図範囲)

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

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

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

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第30条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

1. 信託財産の保存に係る業務

2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方



法により分別して管理することがあります。

- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（有価証券売却等の指図）

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

（再投資の指図）

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

（資金の借入れ）

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- ③ 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金立替え）

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第39条 この信託の計算期間は、毎年3月26日から翌年3月25日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は2013年10月25日から2014年3月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

（信託財産に関する報告等）

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税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130の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間

の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとして、当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとしてします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしてします。

（収益分配金および償還金の時効）

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商

品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。

- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

（信託契約の解約）

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止した

ときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合

には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(信託期間の延長)

第55条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条の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57条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

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

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満

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

信託契約締結日 2013年10月25日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日



 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント