

投資信託説明書 (請求目論見書)

使用開始日 2025.3.25

つみたて4資産均等バランス

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

ファンドは、NISAの成長投資枠およびつみたて投資枠の対象です。

※販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にご確認ください。

この目論見書により行う「つみたて4資産均等バランス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年9月24日に関東財務局長に提出しており、2024年9月25日に効力が生じております。

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

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

目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行（売出）価額の総額】	1
(4)【発行（売出）価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	1
(8)【申込取扱場所】	1
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	2
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	41
第3【ファンドの経理状況】	47
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	264
第三部【委託会社等の情報】	265
第1【委託会社等の概況】	265
約款	311

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

つみたて4資産均等バランス（「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

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

(7)【申込期間】

2024年9月25日から2025年9月24日まで

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

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

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

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

（9）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

（10）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（11）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（12）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（T O P I X）（配当込み）、M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、N O M U R A - B P I 総合およびF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の各対象インデックスを 25%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000 億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年 1 回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経 2 2 5	ブル・ベア型
一般	年 2 回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	T O P I X	条件付運用型
大型株	年 4 回	北米				
中小型株	年 6 回	欧州			その他 (合成ベンチ マーク)	ロング・ ショート型／ 絶対収益 追求型
債券	(隔月)	アジア				
一般	年 12 回	オセアニア				
公債	(毎月)	中南米				
社債	日々	アフリカ				
その他債券	その他	中近東 (中東)				その他 ()
クレジット	()	エマージング				
属性 ()						
不動産投信						
その他資産						
(投資信託証券						
(資産複合 (株						

式、債券)))					
資産複合 ()					

※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	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
------	----	----	------------------------------

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

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

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

ファンドの目的

日本を含む先進国の株式および公社債市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

特色1

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

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

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の各対象インデックス(以下「ベンチマーク」という場合があります。)を25%ずつ組み合わせた合成指数をいいます。

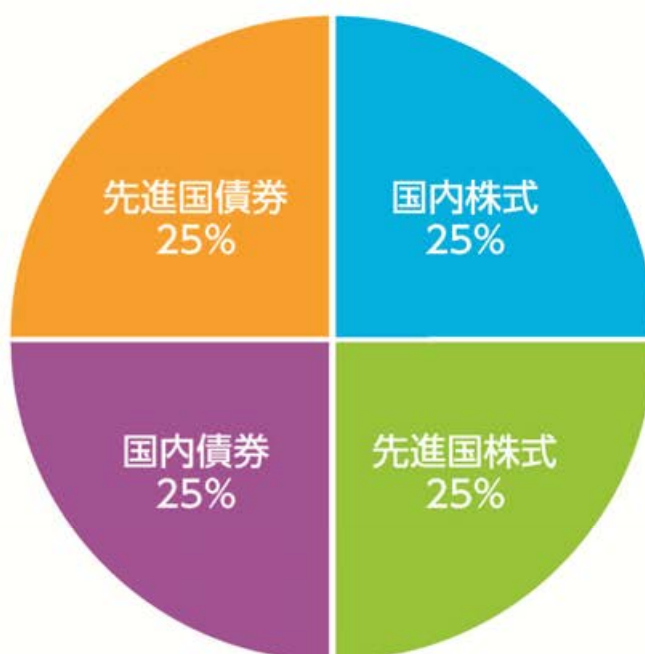
特色2

主として対象インデックスに採用されている日本を含む先進国の株式および公社債に投資を行います。

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

※実際の運用は各マザーファンドを通じて行います。

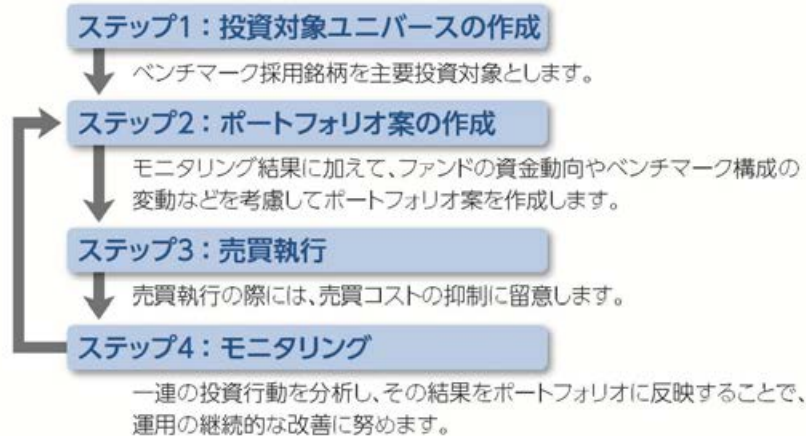
<基本投資割合>



<各マザーファンドの主要投資対象と運用目標および基本投資割合>

	主要投資対象	運用目標	基本投資割合
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。	25%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。	25%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。	25%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。	25%

<各マザーファンドの運用プロセス>



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

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

特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

特色4

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

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む先進国の株式および公社債へ投資するファミリーファンド方式により行います。



■ 主な投資制限

株式	株式への実質投資割合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	デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。



指数について

・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) (以下「TOPIX」といいます。)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

・MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

・NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

・FTSE世界国債インデックス (除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス (除く日本)・データに基づき委託会社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

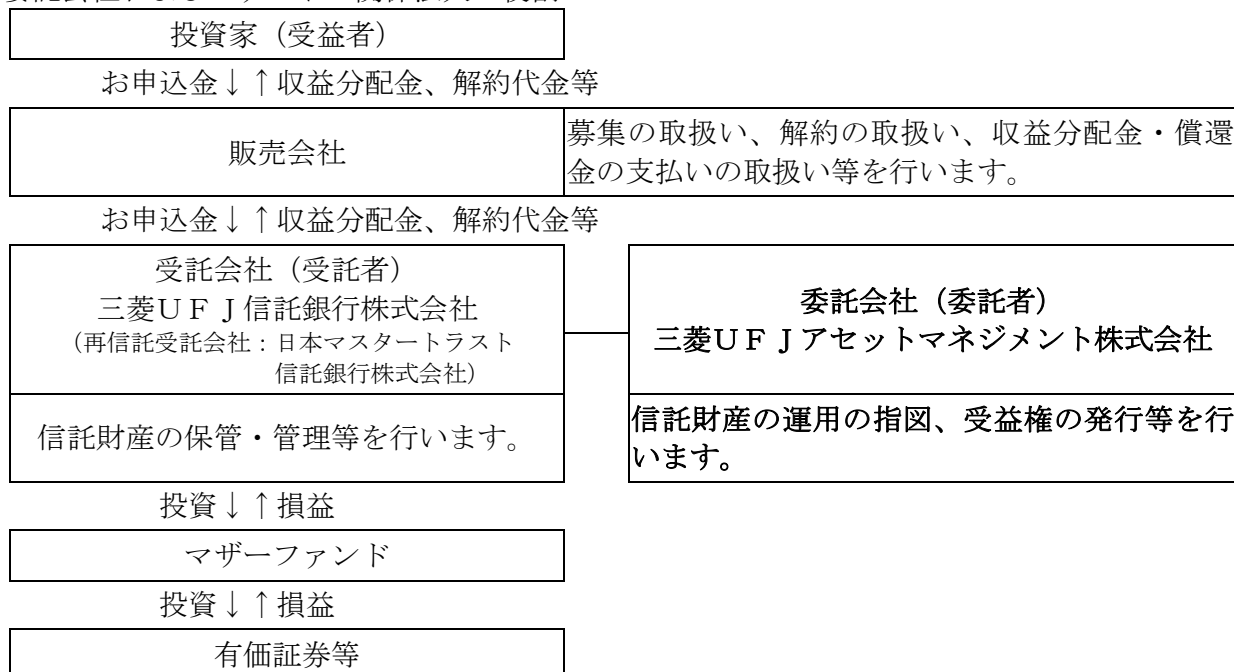
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017 年 8 月 16 日 設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況（2024 年 12 月末現在）

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

2015 年 7 月 三菱UFJ 投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ 国際投信株式会社に變更

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變更

・大株主の状況

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581 株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券および外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む先進国の株式および公社債に直接投資することがあります。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券および外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として対象インデックスに採用されている日本を含む先進国の株式および公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を合成ベンチマークの変動率に連動させることを目的とした運用を行います。

国内株式、先進国株式、国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ25%とします。

合成ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式および公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡し取引および為替先渡し取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

1. 株券または新株引受権証券
 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します。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
 22. 外国の者に対する権利で 21. の有価証券の性質を有するもの
 23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- なお、1. の証券または証書ならびに 13. および 19. の証券または証書のうち 1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から 6. までの証券ならびに 16. の証券ならびに 13. および 19. の証券または証書のうち 2. から 6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および 15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で 5. の権利の性質を有するもの
7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から 6. に該当するものを除きます。）
8. 外国の者に対する権利で 7. の権利の性質を有するもの
9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）

10. 外国法人の社員権で9. の権利の性質を有するもの
 11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
 12. 外国の法令に基づく権利であって、11. の権利に類するもの
- ④その他の投資対象
- 信託約款に定める次に掲げるもの。
- ・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

TOPIXマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

（投資制限）

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑤外貨建資産への投資は行いません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

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

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

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

②投資態度

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

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

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

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5 %以下とします。

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

⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

⑧外国為替予約取引を行うことができます。

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

⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

日本債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

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

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5 %以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5 %以下とします。

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

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

⑦外貨建資産への投資は行いません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

⑨スワップ取引を行うことができます。

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

外には利用しません。

外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

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

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

- ・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

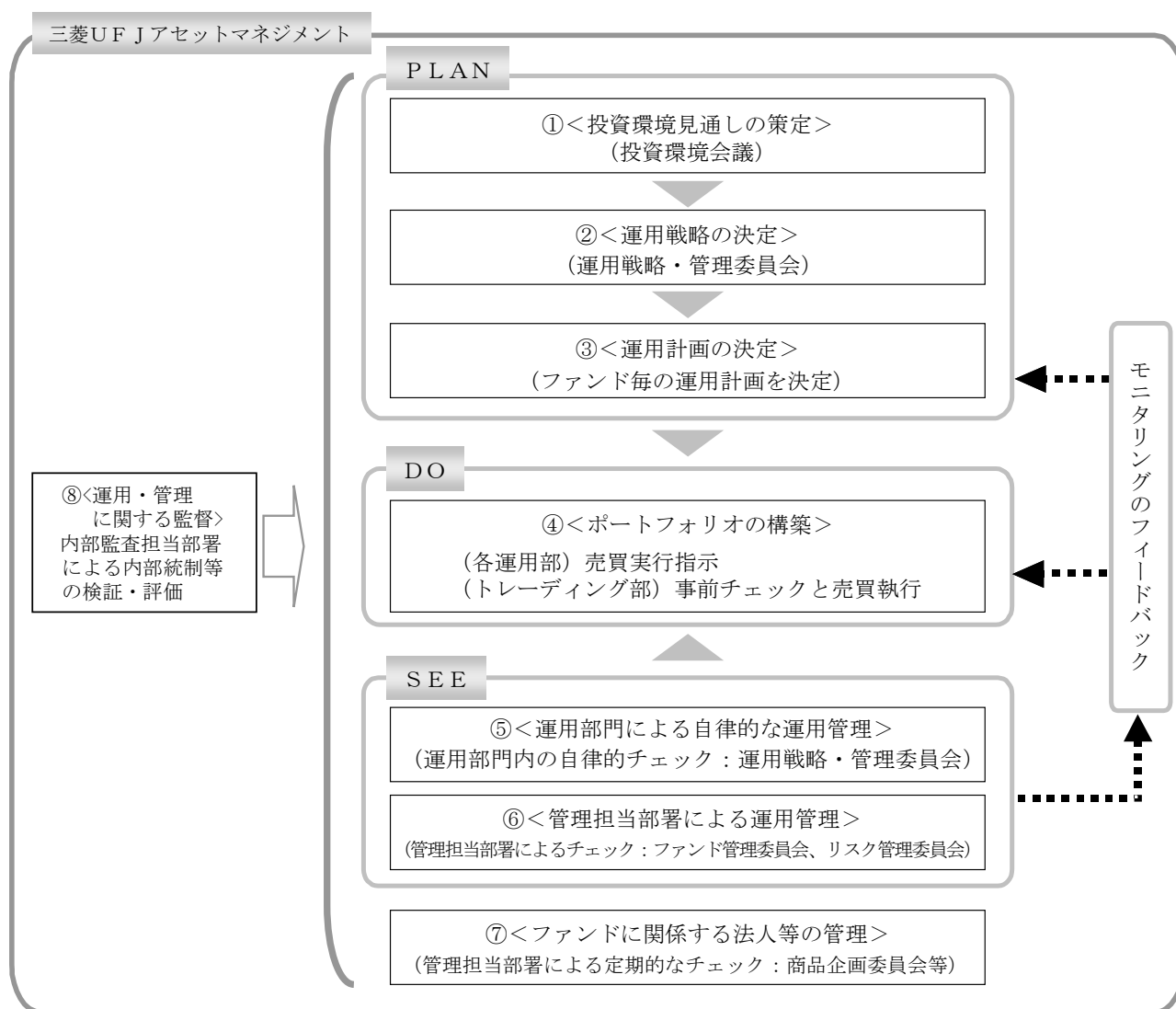
⑨スワップ取引を行うことができます。

⑩外国為替予約取引を行うことができます。

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

⑫外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(3) 【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60 名程度）は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。

この結果は、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

(4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

(5) 【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

①新株引受権証券および新株予約権証券

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

②投資信託証券

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

③同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第 341 条の 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社

債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

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

④スワップ取引

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

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ますものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（③に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）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、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

⑦公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

⑧資金の借入れ

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

産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

⑨投資する株式等の範囲

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑫特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑬デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

⑭信用リスクの分散規制

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託

につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に 100 分の 50 の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

価格変動 リスク	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、ファンドはその影響を受け組入株式や組入公社債の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動 リスク	組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。
信用リスク	組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。
流動性 リスク	有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

※留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、ファンドが損失を被る可能性があります。
- ・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが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。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とす

るマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。

- ・ファンドは、合成ベンチマークの動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比の違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

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

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①コンプライアンス担当部署

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

②リスク管理担当部署

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

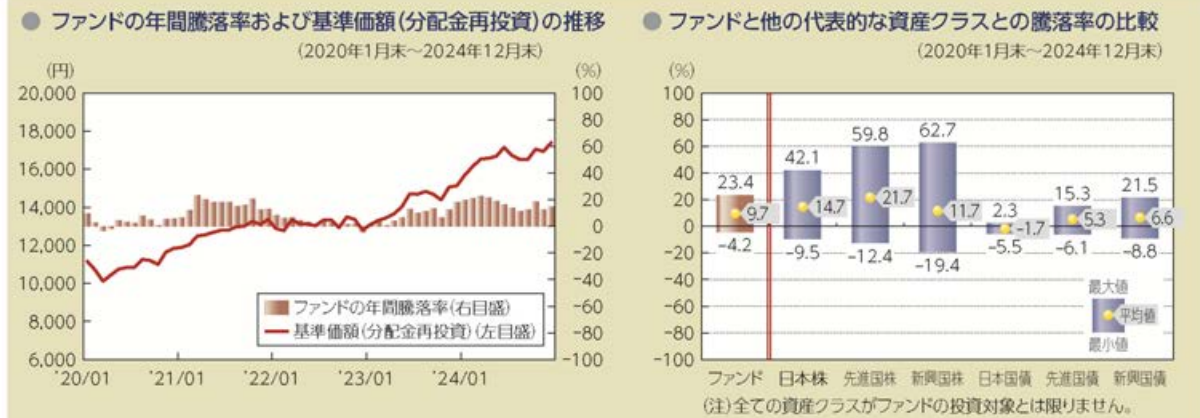
③内部監査担当部署

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

*組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

(2)【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

(3)【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年 0.2420%（税抜 0.2200%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.10%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.10%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

1. 収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

◇個別元本について

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

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

③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当

該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について

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

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

※上記は 2024 年 12 月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2023年6月27日～2024年6月25日）における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.25%	0.24%	0.01%

（比率は年率、表示桁数未満四捨五入）

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

詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5 【運用状況】

【つみたて 4 資産均等バランス】

（1）【投資状況】

2024 年 12 月 30 日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	32,860,186,944	99.00
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	330,372,894	1.00
純資産総額		33,190,559,838	100.00

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

（2）【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

2024 年 12 月 30 日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価	簿価金額	評価単価	評価金額	投資比率
------	----	-----	----	------	------	------	------	------

				(円)	(円)	(円)	(円)	(%)
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	2,428,003,457	3.3725	8,188,441,659	3.4602	8,401,377,561	25.31
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	1,043,734,814	7.4051	7,728,960,672	7.9772	8,326,081,358	25.09
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	2,984,183,273	2.7720	8,272,156,033	2.7767	8,286,181,694	24.97
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	6,301,940,673	1.2494	7,874,215,012	1.2451	7,846,546,331	23.64

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024 年 12 月 30 日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024 年 12 月末日、同日前 1 年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

		純資産総額		基準価額 (1 万口当たりの純資産価額)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 1 計算期間末日	(2018 年 6 月 25 日)	183,398,258	183,398,258	10,445	10,445
第 2 計算期間末日	(2019 年 6 月 25 日)	1,221,525,769	1,221,525,769	10,478	10,478
第 3 計算期間末日	(2020 年 6 月 25 日)	3,111,724,343	3,111,724,343	10,798	10,798
第 4 計算期間末日	(2021 年 6 月 25 日)	6,545,738,128	6,545,738,128	12,843	12,843
第 5 計算期間末日	(2022 年 6 月 27 日)	10,460,904,668	10,460,904,668	13,028	13,028
第 6 計算期間末日	(2023 年 6 月 26 日)	16,985,160,938	16,985,160,938	14,584	14,584
第 7 計算期間末日	(2024 年 6 月 25 日)	27,219,449,176	27,219,449,176	17,052	17,052
	2023 年 12 月末日	20,468,640,028	—	15,138	—
	2024 年 1 月末日	21,745,581,172	—	15,698	—
	2 月末日	22,953,667,037	—	16,141	—
	3 月末日	24,228,864,599	—	16,531	—

4 月末日	24, 970, 463, 731	—	16, 580	—
5 月末日	26, 089, 677, 654	—	16, 682	—
6 月末日	27, 615, 705, 448	—	17, 151	—
7 月末日	27, 886, 970, 870	—	16, 726	—
8 月末日	28, 442, 095, 550	—	16, 509	—
9 月末日	29, 287, 575, 987	—	16, 513	—
10 月末日	31, 170, 273, 251	—	17, 053	—
11 月末日	31, 765, 290, 184	—	16, 940	—
12 月末日	33, 190, 559, 838	—	17, 405	—

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

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 1 計算期間	4. 45
第 2 計算期間	0. 31
第 3 計算期間	3. 05
第 4 計算期間	18. 93
第 5 計算期間	1. 44
第 6 計算期間	11. 94
第 7 計算期間	16. 92
第 8 中間計算期間	1. 59

(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	186, 956, 331	11, 372, 280	175, 584, 051
第 2 計算期間	1, 035, 554, 021	45, 344, 014	1, 165, 794, 058
第 3 計算期間	1, 866, 499, 843	150, 504, 334	2, 881, 789, 567
第 4 計算期間	2, 571, 191, 875	356, 417, 774	5, 096, 563, 668

第 5 計算期間	3,337,951,531	405,018,931	8,029,496,268
第 6 計算期間	4,293,051,178	676,503,046	11,646,044,400
第 7 計算期間	5,661,382,614	1,344,772,971	15,962,654,043
第 8 中間計算期間	3,853,874,459	746,798,416	19,069,730,086

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

2024 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	1,619,743,206,710	99.49
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	8,323,150,926	0.51
純資産総額		1,628,066,357,636	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	6,018,840,000	0.37

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

2024 年 12 月 30 日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	21,628,600	3,551.93	76,823,388,913	3,146.00	68,043,575,600	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	14,248,100	2,631.45	37,493,171,805	3,369.00	48,001,848,900	2.95
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	25,705,100	1,585.47	40,754,664,897	1,846.00	47,451,614,600	2.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	10,581,700	2,950.12	31,217,318,762	3,937.00	41,660,152,900	2.56
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	3,263,300	7,031.89	22,947,167,806	11,145.00	36,369,478,500	2.23
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	8,359,500	3,037.54	25,392,379,680	3,764.00	31,465,158,000	1.93
日本	株式	キーエンス	電気機器	407,000	70,029.53	28,502,020,864	64,630.00	26,304,410,000	1.62
日本	株式	任天堂	その他製	2,568,700	8,277.22	21,261,714,389	9,264.00	23,796,436,800	1.46

			品						
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,893,700	6,712.20	19,423,096,370	7,832.00	22,663,458,400	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,912,300	4,822.15	18,865,714,957	5,728.00	22,409,654,400	1.38
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	5,408,800	3,067.28	16,590,345,376	3,873.00	20,948,282,400	1.29
日本	株式	三井物産	卸売業	6,324,800	3,539.84	22,388,818,451	3,311.00	20,941,412,800	1.29
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	861,100	37,247.45	32,073,784,464	24,185.00	20,825,703,500	1.28
日本	株式	三菱商事	卸売業	7,956,000	3,468.85	27,598,231,444	2,604.00	20,717,424,000	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	3,654,600	6,630.98	24,233,591,207	5,296.00	19,354,761,600	1.19
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	121,379,000	178.05	21,612,037,695	158.00	19,177,882,000	1.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,012,900	9,143.49	18,404,941,523	9,185.00	18,488,486,500	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	3,851,100	4,902.59	18,880,368,805	4,352.00	16,759,987,200	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	7,186,100	1,439.59	10,345,038,838	2,223.00	15,974,700,300	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	795,000	19,109.06	15,191,702,932	19,815.00	15,752,925,000	0.97
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,630,900	4,330.84	15,724,850,943	4,181.00	15,180,792,900	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	3,001,400	4,526.98	13,587,300,786	5,042.00	15,133,058,800	0.93
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,640,100	1,833.28	17,673,032,035	1,535.00	14,797,553,500	0.91
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	242,100	45,766.03	11,079,957,296	53,820.00	13,029,822,000	0.80
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	65,309,800	201.03	13,129,373,252	198.90	12,990,119,220	0.80
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	4,755,300	2,138.74	10,170,370,224	2,487.00	11,826,431,100	0.73
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	1,282,200	6,850.37	8,783,556,007	9,198.00	11,793,675,600	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	4,179,800	2,541.50	10,622,981,992	2,687.00	11,231,122,600	0.69
日本	株式	富士通	電気機器	3,781,400	2,534.16	9,582,685,578	2,799.50	10,586,029,300	0.65
日本	株式	キャノン	電気機器	2,029,300	4,503.35	9,138,653,427	5,161.00	10,473,217,300	0.64

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年12月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.25
	建設業	2.13
	食料品	3.04
	繊維製品	0.41
	パルプ・紙	0.14
	化学	5.12
	医薬品	4.31
	石油・石炭製品	0.54
	ゴム製品	0.57
	ガラス・土石製品	0.65
	鉄鋼	0.82

	非鉄金属	0.83
	金属製品	0.49
	機械	5.52
	電気機器	17.51
	輸送用機器	7.84
	精密機器	2.39
	その他製品	2.64
	電気・ガス業	1.25
	陸運業	2.23
	海運業	0.68
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.49
	卸売業	6.77
	小売業	4.58
	銀行業	8.51
	証券、商品先物取引業	0.88
	保険業	3.27
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.78
	サービス業	5.11
	小計	99.49
合計		99.49

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024 年 12 月 30 日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 25年03月限	買建	216	円	5,919,208,800	6,018,840,000	0.37

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

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024 年 12 月 30 日現在

（単位：円）

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

株式	アメリカ	5,752,372,610,947	75.89
	イギリス	265,528,675,240	3.50
	カナダ	233,034,455,321	3.07
	フランス	182,040,943,459	2.40
	スイス	174,319,548,303	2.30
	ドイツ	166,093,562,538	2.19
	オーストラリア	126,328,382,332	1.67
	オランダ	106,581,206,409	1.41
	スウェーデン	56,538,375,751	0.75
	デンマーク	52,878,046,419	0.70
	スペイン	47,371,820,960	0.62
	イタリア	40,135,242,874	0.53
	香港	32,636,037,352	0.43
	シンガポール	22,714,201,445	0.30
	フィンランド	17,647,712,081	0.23
	ベルギー	13,440,918,048	0.18
	ノルウェー	10,384,952,055	0.14
	イスラエル	7,595,785,103	0.10
	アイルランド	5,097,086,074	0.07
	ニュージーランド	3,828,347,142	0.05
	オーストリア	3,381,632,576	0.04
	ルクセンブルク	3,118,651,732	0.04
	ポルトガル	2,711,847,669	0.04
	バミューダ	967,819,114	0.01
	ジャージー	490,646,236	0.01
	小計	7,327,238,507,180	96.67
投資証券	アメリカ	115,939,830,276	1.53
	オーストラリア	8,070,107,042	0.11
	フランス	2,372,274,377	0.03
	イギリス	1,906,545,640	0.03
	シンガポール	1,890,795,786	0.02
	香港	1,252,564,786	0.02
	ベルギー	357,403,541	0.00
	カナダ	243,594,997	0.00
	小計	132,033,116,445	1.74
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	120,533,296,887	1.59
純資産総額		7,579,804,920,512	100.00

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

その他の資産の投資状況

2024年12月30日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	121, 123, 226, 763	1. 60
	買建	カナダ	5, 102, 645, 277	0. 07
	買建	ドイツ	15, 540, 632, 592	0. 21
	買建	オーストラリア	4, 412, 231, 162	0. 06
	買建	イギリス	5, 566, 917, 783	0. 07
	買建	スイス	3, 428, 671, 155	0. 05

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

2024 年 12 月 30 日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10, 709, 020	30, 469. 97	326, 303, 582, 901	40, 429. 22	432, 957, 391, 960	5. 71
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	17, 278, 523	15, 331. 68	264, 908, 842, 552	21, 672. 24	374, 464, 328, 403	4. 94
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4, 973, 465	66, 007. 71	328, 287, 083, 618	68, 101. 23	338, 699, 110, 719	4. 47
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	6, 654, 018	29, 807. 87	198, 342, 117, 441	35, 392. 77	235, 504, 161, 920	3. 11
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1, 539, 551	77, 254. 73	118, 937, 604, 801	94, 877. 94	146, 069, 436, 334	1. 93
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	2, 025, 556	29, 384. 53	59, 520, 022, 928	68, 279. 97	138, 304, 920, 738	1. 82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4, 126, 799	26, 721. 00	110, 272, 226, 284	30, 490. 77	125, 829, 307, 207	1. 66
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	3, 126, 400	22, 203. 60	69, 417, 357, 076	38, 240. 01	119, 553, 582, 896	1. 58
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	3, 540, 719	26, 406. 40	93, 497, 653, 284	30, 693. 24	108, 676, 163, 533	1. 43
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	2, 004, 843	31, 991. 53	64, 138, 011, 365	38, 148. 27	76, 481, 293, 275	1. 01
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	569, 303	123, 417. 47	70, 261, 940, 432	123, 881. 83	70, 526, 297, 806	0. 93
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	932, 954	66, 233. 68	61, 792, 978, 360	72, 210. 75	67, 369, 309, 735	0. 89
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー	1, 176, 582	44, 785. 28	52, 693, 556, 603	50, 405. 63	59, 306, 367, 311	0. 78

			ビス						
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	3,129,368	18,589.46	58,173,264,005	16,843.00	52,707,965,252	0.70
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	650,654	82,484.65	53,668,970,650	80,670.21	52,488,400,153	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	580,731	73,082.61	42,441,342,597	84,183.39	48,887,907,742	0.64
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	312,190	127,565.45	39,824,658,714	148,641.74	46,404,466,684	0.61
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	3,114,741	10,061.59	31,339,259,981	14,498.77	45,159,940,778	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,654,266	26,444.90	43,746,901,736	26,816.25	44,361,219,556	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	700,805	55,757.35	39,075,036,622	62,142.59	43,549,841,149	0.57
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	302,526	100,053.82	30,268,884,019	143,556.25	43,429,500,810	0.57
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,695,451	23,851.29	40,438,695,448	22,944.00	38,900,443,003	0.51
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	674,434	43,726.46	29,490,615,024	53,536.02	36,106,512,787	0.48
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	1,245,128	26,024.16	32,403,413,111	28,157.62	35,059,843,317	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	4,924,672	6,174.37	30,406,758,025	7,013.70	34,540,177,916	0.46
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	2,274,870	19,393.50	44,117,709,256	14,059.74	31,984,101,208	0.42
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	281,929	140,077.83	39,492,004,981	112,953.70	31,844,925,943	0.42
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	1,171,884	19,664.27	23,044,253,731	26,726.09	31,319,880,535	0.41
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	737,559	29,787.03	21,969,693,897	39,498.33	29,132,356,152	0.38
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,880,170	10,097.49	29,082,505,195	9,878.34	28,451,301,398	0.38

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年12月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
----	----	----------

株式	エネルギー	3.74
	素材	3.10
	資本財	6.79
	商業・専門サービス	1.50
	運輸	1.42
	自動車・自動車部品	2.35
	耐久消費財・アパレル	1.16
	消費者サービス	1.96
	メディア・娯楽	6.96
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.17
	生活必需品流通・小売り	1.82
	食品・飲料・タバコ	2.72
	家庭用品・パーソナル用品	1.44
	ヘルスケア機器・サービス	3.69
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.61
	銀行	5.59
	金融サービス	7.18
	保険	2.95
	ソフトウェア・サービス	10.13
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.25
	電気通信サービス	1.10
	公益事業	2.49
	半導体・半導体製造装置	9.27
	不動産管理・開発	0.27
小計		96.67
投資証券	—	1.74
合計		98.41

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024 年 12 月 30 日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2503	買建	2,541	アメリカドル	779,602,186.1	123,317,473,797	765,730,350	121,123,226,763	1.60
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602503	買建	156	カナダドル	47,001,436.8	5,159,347,717	46,484,880	5,102,645,277	0.07
	ドイツ	ユーレック	EURO ST 2503	買建	1,918	ユーロ	95,342,925.2	15,723,955,223	94,231,340	15,540,632,592	0.21

		ス・ドイツ 金融先物取引所									
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2503	買建	217	オーストラリアドル	45, 123, 377. 4	4, 444, 652, 673	44, 794, 225	4, 412, 231, 162	0. 06
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2503	買建	343	イギリスポンド	28, 288, 478. 75	5, 629, 973, 041	27, 971, 650	5, 566, 917, 783	0. 07
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2503	買建	169	スイスフラン	19, 672, 213. 5	3, 449, 522, 637	19, 553, 300	3, 428, 671, 155	0. 05

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

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024 年 12 月 30 日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	839, 136, 698, 260	84. 72
地方債証券	日本	52, 563, 439, 240	5. 31
特殊債券	日本	42, 049, 958, 453	4. 25
社債券	日本	61, 432, 841, 000	6. 20
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	△4, 753, 103, 090	△0. 48
純資産総額		990, 429, 833, 863	100. 00

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

その他の資産の投資状況

2024 年 12 月 30 日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	3, 405, 600, 000	0. 34

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 3 0 銘柄

2024 年 12 月 30 日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限 （年／月／日）	投資 比率 （％）
日本	国債証券	第 1 4 9 回利付国債（5 年）	12, 670, 000, 000	99. 22	12, 571, 334, 900	99. 05	12, 550, 141, 800	0. 005000	2026/9/20	1. 27
日本	国債証券	第 3 5 9 回利付国債（1 0 年）	11, 490, 000, 000	97. 00	11, 145, 550, 000	96. 57	11, 095, 893, 000	0. 100000	2030/6/20	1. 12

日本	国債証券	第3 6 5 回利付国債（10年）	11,520,000,000	95.36	10,986,601,200	95.07	10,952,640,000	0.100000	2031/12/20	1.11
日本	国債証券	第3 7 2 回利付国債（10年）	10,820,000,000	99.14	10,727,764,500	98.55	10,663,759,200	0.800000	2033/9/20	1.08
日本	国債証券	第3 7 3 回利付国債（10年）	10,980,000,000	97.12	10,663,990,800	96.59	10,605,911,400	0.600000	2033/12/20	1.07
日本	国債証券	第3 5 8 回利付国債（10年）	10,790,000,000	97.28	10,496,783,500	96.74	10,438,893,400	0.100000	2030/3/20	1.05
日本	国債証券	第1 5 4 回利付国債（5年）	10,530,000,000	98.91	10,415,852,000	98.69	10,392,583,500	0.100000	2027/9/20	1.05
日本	国債証券	第3 7 4 回利付国債（10年）	10,450,000,000	98.33	10,275,550,500	98.02	10,243,612,500	0.800000	2034/3/20	1.03
日本	国債証券	第3 6 9 回利付国債（10年）	10,480,000,000	97.43	10,210,962,000	96.85	10,149,984,800	0.500000	2032/12/20	1.02
日本	国債証券	第1 6 3 回利付国債（5年）	10,230,000,000	99.60	10,189,724,000	99.05	10,133,735,700	0.400000	2028/9/20	1.02
日本	国債証券	第3 6 8 回利付国債（10年）	10,680,000,000	95.27	10,175,502,000	94.85	10,130,407,200	0.200000	2032/9/20	1.02
日本	国債証券	第3 7 0 回利付国債（10年）	9,860,000,000	97.09	9,573,841,800	96.61	9,526,041,800	0.500000	2033/3/20	0.96
日本	国債証券	第3 6 3 回利付国債（10年）	9,820,000,000	95.97	9,424,754,000	95.61	9,389,589,400	0.100000	2031/6/20	0.95
日本	国債証券	第3 6 1 回利付国債（10年）	9,760,000,000	96.52	9,420,888,000	96.15	9,385,020,800	0.100000	2030/12/20	0.95
日本	国債証券	第3 5 6 回利付国債（10年）	9,580,000,000	97.53	9,343,716,000	97.15	9,307,544,800	0.100000	2029/9/20	0.94
日本	国債証券	第3 7 1 回利付国債（10年）	9,560,000,000	96.09	9,186,980,500	95.54	9,134,293,200	0.400000	2033/6/20	0.92
日本	国債証券	第1 5 3 回利付国債（5年）	9,070,000,000	98.93	8,973,347,000	98.60	8,943,836,300	0.005000	2027/6/20	0.90
日本	国債証券	第3 6 7 回利付国債（10年）	8,750,000,000	95.60	8,365,161,600	95.14	8,325,100,000	0.200000	2032/6/20	0.84
日本	国債証券	第3 6 4 回利付国債（10年）	8,600,000,000	96.09	8,264,451,500	95.36	8,201,218,000	0.100000	2031/9/20	0.83
日本	国債証券	第4 5 8 回利付国債（2年）	7,900,000,000	99.82	7,885,994,000	99.70	7,876,537,000	0.200000	2026/3/1	0.80
日本	国債証券	第1 5 2 回利付国債（5年）	7,480,000,000	99.20	7,420,194,000	98.97	7,403,554,400	0.100000	2027/3/20	0.75
日本	国債証券	第3 7 6 回利付国債（10年）	7,450,000,000	98.83	7,362,915,000	98.33	7,325,734,000	0.900000	2034/9/20	0.74
日本	国債証券	第1 5 8 回利付国債（5年）	7,440,000,000	98.73	7,345,512,000	98.36	7,318,579,200	0.100000	2028/3/20	0.74
日本	国債証券	第1 4 8 回利付国債（5年）	7,200,000,000	99.30	7,149,976,000	99.23	7,144,992,000	0.005000	2026/6/20	0.72
日本	国債証券	第3 5 7 回利付国債（10年）	7,350,000,000	97.29	7,150,867,500	96.94	7,125,163,500	0.100000	2029/12/20	0.72
日本	国債証券	第3 6 0 回利付国債（10年）	6,940,000,000	96.89	6,724,166,000	96.36	6,687,731,000	0.100000	2030/9/20	0.68
日本	国債証券	第1 7 4 回利付国債（5年）	6,600,000,000	99.85	6,590,556,000	99.84	6,589,440,000	0.700000	2029/9/20	0.67
日本	国債証券	第3 5 0 回利付国債（10年）	6,530,000,000	98.73	6,447,134,300	98.36	6,423,430,400	0.100000	2028/3/20	0.65
日本	国債証券	第4 6 0 回利付国債（2年）	6,300,000,000	99.90	6,293,897,000	99.72	6,282,675,000	0.300000	2026/5/1	0.63
日本	国債証券	第3 4 5 回利付国債（10年）	6,340,000,000	99.35	6,299,107,000	99.09	6,282,432,800	0.100000	2026/12/20	0.63

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024 年 12 月 30 日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.72
地方債証券	5.31
特殊債券	4.25
社債券	6.20
合計	100.48

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024 年 12 月 30 日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物 2 5 年 0 3 月限	買建	24	円	3,415,222,440	3,405,600,000	0.34

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

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	317,015,415,226	45.74
	中国	76,958,195,082	11.10
	フランス	50,238,107,770	7.25
	イタリア	47,041,861,572	6.79
	ドイツ	37,953,312,049	5.48
	イギリス	35,078,024,246	5.06
	スペイン	31,838,981,658	4.59
	カナダ	12,979,322,610	1.87
	ベルギー	10,686,861,311	1.54
	オランダ	9,101,133,971	1.31
	オーストラリア	8,276,520,812	1.19
	オーストリア	7,442,310,580	1.07
	メキシコ	4,902,725,950	0.71
	ポーランド	3,557,313,823	0.51
	マレーシア	3,488,578,103	0.50
	ポルトガル	3,483,516,524	0.50
	フィンランド	3,355,392,827	0.48

	アイルランド	3,274,235,401	0.47
	シンガポール	2,616,392,973	0.38
	イスラエル	2,237,060,255	0.32
	ニュージーランド	1,766,793,417	0.25
	デンマーク	1,468,593,586	0.21
	スウェーデン	1,086,003,975	0.16
	ノルウェー	974,464,432	0.14
小計		676,821,118,153	97.65
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	16,287,101,122	2.35
純資産総額		693,108,219,275	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年12月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 290815	26,650,000	14,139.11	3,768,074,859	13,992.44	3,728,985,816	1.625000	2029/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 340215	23,850,000	15,191.60	3,623,198,317	15,095.99	3,600,394,764	4.000000	2034/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	27,790,000	12,827.57	3,564,784,318	12,865.10	3,575,211,474	1.250000	2031/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	27,420,000	12,826.72	3,517,087,595	12,881.47	3,532,100,395	1.375000	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 340815	23,300,000	15,550.21	3,623,200,544	14,907.22	3,473,384,418	3.875000	2034/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 340515	22,180,000	16,160.08	3,584,305,932	15,525.11	3,443,471,598	4.375000	2034/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 331115	19,430,000	15,801.93	3,070,315,949	15,694.42	3,049,426,170	4.500000	2033/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	3.75 T-NOTE 270815	18,600,000	15,866.11	2,951,098,275	15,580.42	2,897,958,318	3.750000	2027/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 270615	18,100,000	16,040.78	2,903,382,431	15,921.49	2,881,790,901	4.625000	2027/6/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	21,540,000	13,228.97	2,849,522,202	13,296.69	2,864,108,603	1.625000	2031/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 270515	18,570,000	14,819.29	2,751,942,366	15,119.47	2,807,686,430	2.375000	2027/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	18,320,000	15,060.15	2,759,020,778	15,003.62	2,748,663,197	3.875000	2033/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	21,210,000	12,629.09	2,678,630,243	12,898.46	2,735,764,815	0.875000	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	17,110,000	14,931.75	2,554,822,512	15,004.54	2,567,277,992	2.875000	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	16,370,000	15,405.32	2,521,851,403	15,377.75	2,517,338,157	4.125000	2032/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	16,990,000	14,669.62	2,492,368,646	14,664.39	2,491,481,247	3.500000	2033/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	16,800,000	14,496.74	2,435,452,964	14,487.06	2,433,826,696	3.375000	2033/5/15	0.35

アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	17,340,000	13,915.20	2,412,896,685	13,982.55	2,424,575,182	2.750000	2032/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	17,030,000	14,092.84	2,400,012,247	14,160.50	2,411,534,569	2.875000	2032/5/15	0.35
中国	国債証券	2.39 CHINA GOVT 261115	108,000,000	2,193.48	2,368,963,876	2,218.73	2,396,228,530	2.390000	2026/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 271115	16,000,000	14,817.22	2,370,755,563	14,918.35	2,386,936,200	2.250000	2027/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 270515	14,800,000	15,835.52	2,343,657,266	15,871.44	2,348,974,243	4.500000	2027/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	17,920,000	12,836.29	2,300,263,294	13,009.37	2,331,280,577	1.125000	2031/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 290430	14,050,000	16,010.32	2,249,450,519	15,925.82	2,237,577,987	4.625000	2029/4/30	0.32
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	17,350,000	12,499.30	2,168,630,181	12,804.54	2,221,588,984	0.625000	2030/8/15	0.32
中国	国債証券	2.62 CHINA GOVT 290925	97,000,000	2,242.78	2,175,500,882	2,284.87	2,216,327,704	2.620000	2029/9/25	0.32
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	14,380,000	14,911.19	2,144,230,363	15,093.21	2,170,404,221	3.125000	2028/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 270715	13,700,000	16,116.86	2,208,010,226	15,826.03	2,168,166,456	4.375000	2027/7/15	0.31
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 290331	13,800,000	15,580.94	2,150,170,453	15,621.81	2,155,811,130	4.125000	2029/3/31	0.31
アメリカ	国債証券	4.25 T-NOTE 251231	13,580,000	15,638.81	2,123,750,639	15,818.45	2,148,146,264	4.250000	2025/12/31	0.31

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024 年 12 月 30 日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.65
合計	97.65

（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》

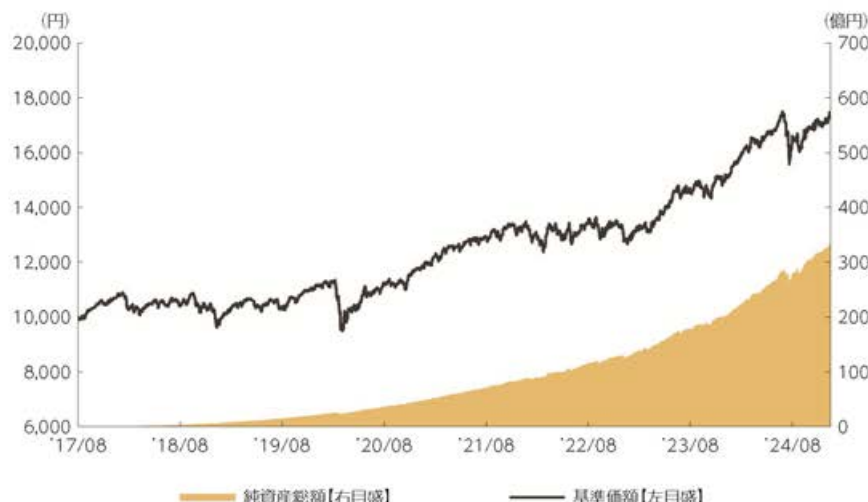


運用実績



2024年12月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年8月16日(設定日)～2024年12月30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	17,405円
純資産総額	331.9億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 6月	0円
2023年 6月	0円
2022年 6月	0円
2021年 6月	0円
2020年 6月	0円
2019年 6月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

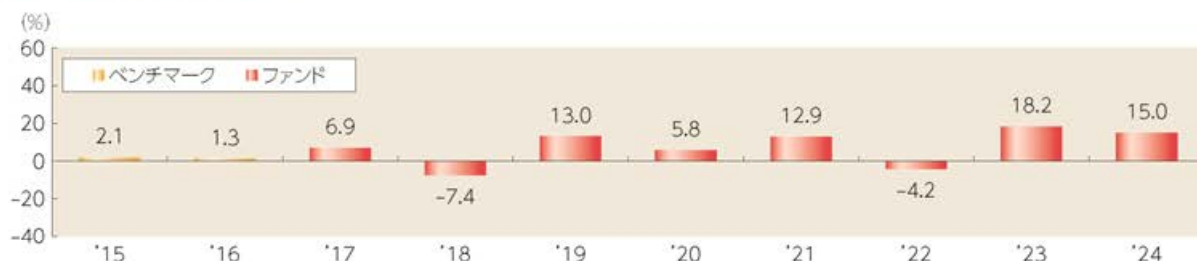
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種／種別	国・地域	比率
国内株式	25.2%	1 円	49.8%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.4%
国内債券	23.8%	2 アメリカドル	31.6%	NVIDIA CORP	株式	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.2%
外国株式	24.7%	3 ユーロ	9.5%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.1%
外国債券	24.4%	4 中国元	2.9%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	1.1%
		5 イギリスポンド	2.2%	AMAZON.COM INC	株式	一般消費財・サービス流通・小売り	アメリカ	0.8%
		6 カナダドル	1.3%	第149回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.3%
		7 オーストラリアドル	0.8%	第359回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
		8 スイスフラン	0.6%	第365回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
コールローン他		9 デンマーククローネ	0.2%	第372回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
(負債控除後)	1.9%	10 スウェーデンクローネ	0.2%	第373回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
合計	100.0%							

その他資産の状況	比率
株指指数先物取引 (買建)	0.6%
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。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は8月16日(設定日)から年末までの収益率を表示
- 2016年以前はベンチマークの年間収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

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

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufig.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、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。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

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

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得申込みの受付を中止することがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

②解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

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

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、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。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

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

⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

(受付時間：営業日の9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限(2017年8月16日設定)

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年6月26日から翌年6月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

②信託約款の変更等

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還(信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。)、信託約款の変更または併合(変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併

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

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

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤関係法人との契約の更改

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

⑥運用報告書

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

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨信託事務の再信託

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

⑩公告

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

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

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、当期（2023 年 6 月 27 日から 2024 年 6 月 25 日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年8月28日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたて4資産均等バランスの2023年6月27日から2024年6月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、つみたて4資産均等バランスの2024年6月25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アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【つみたて4資産均等バランス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 [2023年 6月 26日現在]	第7期 [2024年 6月 25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	197,939,727	319,060,216
親投資信託受益証券	16,815,702,013	26,949,800,912
未収利息	-	553
流動資産合計	17,013,641,740	27,268,861,681
資産合計	17,013,641,740	27,268,861,681
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,680,058	20,452,027
未払受託者報酬	1,592,164	2,590,394
未払委託者報酬	15,921,563	25,903,874
未払利息	497	-
その他未払費用	286,520	466,210
流動負債合計	28,480,802	49,412,505
負債合計	28,480,802	49,412,505
純資産の部		
元本等		
元本	11,646,044,400	15,962,654,043
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,339,116,538	11,256,795,133
（分配準備積立金）	2,495,326,854	5,633,576,409
元本等合計	16,985,160,938	27,219,449,176
純資産合計	16,985,160,938	27,219,449,176
負債純資産合計	17,013,641,740	27,268,861,681

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 自 2022年 6月 28日 至 2023年 6月 26日	第7期 自 2023年 6月 27日 至 2024年 6月 25日
営業収益		
受取利息	766	52,979
有価証券売買等損益	1,736,764,366	3,538,278,243
営業収益合計	1,736,765,132	3,538,331,222
営業費用		
支払利息	62,934	47,799
受託者報酬	2,900,558	4,630,124

委託者報酬	29,005,411	46,301,061
その他費用	521,964	833,294
営業費用合計	32,490,867	51,812,278
営業利益又は営業損失（△）	1,704,274,265	3,486,518,944
経常利益又は経常損失（△）	1,704,274,265	3,486,518,944
当期純利益又は当期純損失（△）	1,704,274,265	3,486,518,944
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（△）	29,816,354	112,594,320
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,431,408,400	5,339,116,538
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,441,446,641	3,171,940,109
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,441,446,641	3,171,940,109
剰余金減少額又は欠損金増加額	208,196,414	628,186,138
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	208,196,414	628,186,138
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,339,116,538	11,256,795,133

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年 6 月 25 日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は 2023 年 6 月 27 日から 2024 年 6 月 25 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 6 期 [2023 年 6 月 26 日現在]	第 7 期 [2024 年 6 月 25 日現在]
1. 期首元本額	8,029,496,268 円	11,646,044,400 円
期中追加設定元本額	4,293,051,178 円	5,661,382,614 円
期中一部解約元本額	676,503,046 円	1,344,772,971 円
2. 受益権の総数	11,646,044,400 口	15,962,654,043 口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 6 期 自 2022 年 6 月 28 日 至 2023 年 6 月 26 日			第 7 期 自 2023 年 6 月 27 日 至 2024 年 6 月 25 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	245,494,067 円	費用控除後の配当等収益額	A	386,212,982 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,394,292,591 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	2,987,711,642 円
収益調整金額	C	2,843,789,684 円	収益調整金額	C	5,623,218,724 円
分配準備積立金額	D	855,540,196 円	分配準備積立金額	D	2,259,651,785 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,339,116,538 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,256,795,133 円
当ファンドの期末残存口数	F	11,646,044,400 口	当ファンドの期末残存口数	F	15,962,654,043 口

1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	4,584 円	1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	7,051 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 6 期 自 2022 年 6 月 28 日 至 2023 年 6 月 26 日	第 7 期 自 2023 年 6 月 27 日 至 2024 年 6 月 25 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、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 6 期 [2023 年 6 月 26 日現在]	第 7 期 [2024 年 6 月 25 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 6 期 [2023 年 6 月 26 日現在]	第 7 期 [2024 年 6 月 25 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	1, 689, 721, 663	3, 504, 657, 766
合計	1, 689, 721, 663	3, 504, 657, 766

(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 6 期 [2023 年 6 月 26 日現在]	第 7 期 [2024 年 6 月 25 日現在]
1 口当たり純資産額	1. 4584 円	1. 7052 円
(1 万口当たり純資産額)	(14, 584 円)	(17, 052 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	T O P I Xマザーファンド	2, 003, 331, 999	6, 849, 592, 437	
	外国株式インデックスマザーファンド	921, 748, 862	6, 873, 942, 138	
	日本債券インデックスマザーファンド	5, 147, 596, 689	6, 426, 259, 706	
	外国債券インデックスマザーファンド	2, 435, 532, 461	6, 800, 006, 631	
合計		10, 508, 210, 011	26, 949, 800, 912	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,355,142,028
株式	1,525,268,823,520
派生商品評価勘定	157,617,850
未収配当金	5,812,891,067
未収利息	31,862
前払金	96,495,000
その他未収収益	17,539,563
差入委託証拠金	676,169,473
流動資産合計	1,550,384,710,363
資産合計	1,550,384,710,363
負債の部	
流動負債	
未払金	498,213,409
未払解約金	1,453,153,726
未払利息	666,302
受入担保金	8,870,701,979
流動負債合計	10,822,735,416
負債合計	10,822,735,416
純資産の部	
元本等	
元本	450,277,870,938
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,089,284,104,009
元本等合計	1,539,561,974,947
純資産合計	1,539,561,974,947
負債純資産合計	1,550,384,710,363

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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別し

ていないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024 年 6 月 25 日現在]
1. 期首	2023 年 6 月 27 日
期首元本額	402,039,788,052 円
期中追加設定元本額	186,034,125,175 円
期中一部解約元本額	137,796,042,289 円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,557,010,231 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)	740,117,866 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)	3,604,560,997 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (成長型)	3,735,037,750 円
三菱UFJ トピックスオープン (確定拠出年金)	3,717,634,846 円
三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	5,491,866,256 円
三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	32,542,134,437 円
三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	41,479,791,911 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	83,015,677 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	233,367,960 円
ファンド・マネジャー (国内株式)	367,585,050 円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,278,627,026 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	1,922,737,444 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	76,516,959 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	2,711,159,887 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	811,636,159 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	1,105,966,907 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	1,112,060,243 円
eMAXIS Slim 国内株式 (TOPIX)	55,986,411,827 円
国内株式セレクション (ラップ向け)	5,947,152,067 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	10,473,487,079 円
つみたて日本株式 (TOPIX)	10,724,816,898 円
つみたて8資産均等バランス	5,270,085,751 円
つみたて4資産均等バランス	2,003,331,999 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,092,678 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	5,254,739 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	9,752,093 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	698,699,355 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	944,212,360 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	692,772,516 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	500,692,745 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,729,718,993 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	4,362,611,013 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,606,848,367 円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	5,076,000,148 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	646,696,118 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	150,130,908 円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	20,559,538,941 円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	317,190,158 円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,974,504,391 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	150,798,956 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	3,897,533,875 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	2,512,638,259 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	62,839,870 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3,933,347,202 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	109,937,691 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	17,221,155 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	30,230,052 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	4,099,096 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) コンサバティブコース	3,188,427 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) スタンダードコース	59,229,858 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	1,052,002,391 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2,520,574,502 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	172,751,012 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1,544,861,098 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	267,537,328 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	18,178,836 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	129,340,605 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	830,438,907 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	148,789,753 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	190,743,227 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	807,928,788 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	670,616,258 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	1,241,998,166 円
三菱UFJ トピックスオープン	932,458,164 円
三菱UFJ DCトピックスオープン	8,087,744,608 円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	40,685,848 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)	3,805,769,706 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,126,130 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,417,658,721 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	56,530,817 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,157,558,090 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)	57,008,040,431 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	174,861,412 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	200,364 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	119,197 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	173,094,647 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	311,014,211 円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	3,980,868,428 円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	3,279,597,155 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)	1,023,840,101 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家)	489,975,713 円

家転売制限付)	
世界8資産バランスファンドV L (適格機関投資家限定)	88,443,632 円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)	2,655,446,409 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)	147,660,310 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)	3,756,458,341 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	246,971,365 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)	6,172,404,822 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)	31,326,214 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)	269,377 円
日米コアバランス (F O F s 用) (適格機関投資家限定)	78,414,341 円
日本株式インデックスファンドS	3,834,981,695 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	3,301,579 円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	9,798,010,251 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)	35,419,113 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)	81,351,225 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)	34,940,101 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)	34,951,319 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)	34,742,713 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)	34,935,203 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)	35,058,940 円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	210,747,257 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)	34,450,377 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)	34,305,177 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)	34,874,281 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)	35,762,664 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)	395,970,408 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)	37,565,083 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)	38,774,804 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)	39,792,135 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)	39,241,585 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)	39,102,095 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	39,096,327 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)	39,100,255 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)	39,088,327 円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,652,449,235 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,528,269 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	6,150,244 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,437,676 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	5,578,293 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	444,960,195 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	62,040,407 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	2,795,906 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	24,614,162 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,347,059 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	14,361,459 円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,583,689,495 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)	299,743,876 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)	1,303,611,955 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)	1,263,628,261 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)	1,235,194,805 円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	60,632,984,111 円
合計	450,277,870,938 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	8,604,019,100 円
3. 受益権の総数	450,277,870,938 口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 6 月 27 日 至 2024 年 6 月 25 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、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 6 月 25 日現在]
----	---------------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 6 月 25 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	6,958,986,237
合計	6,958,986,237

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024 年 6 月 25 日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	14,131,715,000	—	14,289,615,000	157,900,000
合計		14,131,715,000	—	14,289,615,000	157,900,000

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024 年 6 月 25 日現在]
1口当たり純資産額	3.4191 円
(1万口当たり純資産額)	(34,191 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	22,500	4,115.00	92,587,500	
1332	ニッスイ	544,300	866.50	471,635,950	
1333	マルハニチロ	80,800	3,228.00	260,822,400	貸付有価証券 2,800 株
1375	雪国まいたけ	46,400	1,016.00	47,142,400	
1376	カネコ種苗	15,400	1,430.00	22,022,000	
1377	サカタのタネ	62,000	3,460.00	214,520,000	
1379	ホクト	43,600	1,891.00	82,447,600	
1384	ホクリョウ	2,500	992.00	2,480,000	貸付有価証券 200 株
1514	住石ホールディングス	69,300	1,390.00	96,327,000	貸付有価証券 18,200 株
1515	日鉄鉱業	21,800	5,110.00	111,398,000	
1518	三井松島ホールディングス	32,200	4,960.00	159,712,000	貸付有価証券 2,400 株
1605	I N P E X	1,828,100	2,388.00	4,365,502,800	
1662	石油資源開発	63,100	6,400.00	403,840,000	
1663	K&Oエナジーグループ	24,700	3,640.00	89,908,000	
1414	ショーボンドホールディングス	74,100	5,832.00	432,151,200	
1417	ミライト・ワン	164,300	2,099.00	344,865,700	
1419	タマホーム	34,200	3,940.00	134,748,000	
1420	サンヨーホームズ	2,100	735.00	1,543,500	貸付有価証券 200 株
1429	日本アクア	7,000	927.00	6,489,000	貸付有価証券 900 株
1430	ファーストコーポレーション	4,300	770.00	3,311,000	貸付有価証券 400 株
1433	ベステラ	3,800	1,014.00	3,853,200	貸付有価証券 600 株
1446	キャンディル	2,800	634.00	1,775,200	貸付有価証券 400 株
1712	ダイセキ環境ソリューション	3,400	1,005.00	3,417,000	貸付有価証券 1,200 株
1716	第一カッター興業	15,700	1,629.00	25,575,300	
1719	安藤・間	315,400	1,144.00	360,817,600	貸付有価証券 5,900 株
1720	東急建設	170,500	764.00	130,262,000	

1721	コムシスホールディングス	173,800	3,112.00	540,865,600	
1726	ビーアールホールディングス	79,800	362.00	28,887,600	
1762	高松コンストラクショングループ	40,400	3,025.00	122,210,000	
1766	東建コーポレーション	13,700	12,330.00	168,921,000	貸付有価証券 600株
1768	ソネック	1,800	954.00	1,717,200	
1780	ヤマウラ	27,600	1,369.00	37,784,400	
1786	オリエンタル白石	201,500	365.00	73,547,500	
1801	大成建設	348,800	5,820.00	2,030,016,000	貸付有価証券 100株
1802	大林組	1,361,800	1,830.50	2,492,774,900	貸付有価証券 1,900株
1803	清水建設	1,079,700	884.50	954,994,650	
1805	飛島建設	39,300	1,498.00	58,871,400	
1808	長谷工コーポレーション	349,400	1,779.00	621,582,600	
1810	松井建設	35,500	856.00	30,388,000	
1811	銭高組	1,500	4,300.00	6,450,000	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	844,300	2,731.00	2,305,783,300	貸付有価証券 9,700株
1813	不動テトラ	26,300	2,521.00	66,302,300	貸付有価証券 200株
1814	大末建設	4,600	1,705.00	7,843,000	
1815	鉄建建設	27,300	2,645.00	72,208,500	
1820	西松建設	72,600	4,537.00	329,386,200	
1821	三井住友建設	283,400	399.00	113,076,600	
1822	大豊建設	13,100	3,375.00	44,212,500	貸付有価証券 500株
1826	佐田建設	7,500	740.00	5,550,000	貸付有価証券 200株
1827	ナカノフドー建設	8,400	518.00	4,351,200	
1833	奥村組	61,800	4,980.00	307,764,000	貸付有価証券 500株
1835	東鉄工業	47,200	3,190.00	150,568,000	
1847	イチケン	2,900	2,666.00	7,731,400	
1848	富士ピー・エス	5,400	460.00	2,484,000	
1852	浅沼組	28,200	3,735.00	105,327,000	
1860	戸田建設	515,300	1,057.00	544,672,100	
1861	熊谷組	62,800	3,655.00	229,534,000	
1866	北野建設	2,200	3,620.00	7,964,000	
1867	植木組	3,400	1,709.00	5,810,600	

1870	矢作建設工業	51,800	1,632.00	84,537,600	
1871	ピーエス三菱	48,300	989.00	47,768,700	
1873	日本ハウスホールディングス	81,300	342.00	27,804,600	貸付有価証券 800株
1879	新日本建設	53,500	1,633.00	87,365,500	
1882	東亜道路工業	74,600	1,307.00	97,502,200	
1884	日本道路	44,700	1,800.00	80,460,000	貸付有価証券 1,200株
1885	東亜建設工業	115,000	1,027.00	118,105,000	
1887	日本国土開発	108,300	470.00	50,901,000	
1888	若築建設	13,200	3,495.00	46,134,000	
1890	東洋建設	95,900	1,421.00	136,273,900	貸付有価証券 600株
1893	五洋建設	539,800	664.10	358,481,180	
1898	世紀東急工業	48,900	1,723.00	84,254,700	
1899	福田組	14,400	5,660.00	81,504,000	
1911	住友林業	329,100	5,266.00	1,733,040,600	
1914	日本基礎技術	7,200	635.00	4,572,000	貸付有価証券 200株
1921	巴コーポレーション	15,000	853.00	12,795,000	
1925	大和ハウス工業	1,053,000	4,065.00	4,280,445,000	貸付有価証券 500株
1926	ライト工業	75,700	2,106.00	159,424,200	
1928	積水ハウス	1,154,900	3,526.00	4,072,177,400	貸付有価証券 3,800株
1929	日特建設	36,400	1,113.00	40,513,200	貸付有価証券 1,300株
1930	北陸電気工事	26,100	1,188.00	31,006,800	
1934	ユアテック	83,900	1,510.00	126,689,000	
1938	日本リーテック	29,800	1,262.00	37,607,600	
1939	四電工	15,900	3,670.00	58,353,000	
1941	中電工	59,100	3,155.00	186,460,500	
1942	関電工	238,400	1,703.00	405,995,200	貸付有価証券 200株
1944	きんでん	264,800	3,268.00	865,366,400	
1945	東京エネシス	35,500	1,394.00	49,487,000	
1946	トーエネック	12,600	6,020.00	75,852,000	
1949	住友電設	36,200	3,820.00	138,284,000	
1950	日本電設工業	71,500	1,980.00	141,570,000	
1951	エクシオグループ	372,200	1,586.50	590,495,300	貸付有価証券 500株

1952	新日本空調	24,700	3,955.00	97,688,500	
1959	九電工	82,300	5,852.00	481,619,600	貸付有価証券 400株
1961	三機工業	82,300	2,120.00	174,476,000	
1963	日揮ホールディングス	376,700	1,285.50	484,247,850	
1964	中外炉工業	12,500	3,445.00	43,062,500	
1967	ヤマト	9,900	985.00	9,751,500	
1968	太平電業	23,700	5,440.00	128,928,000	
1969	高砂熱学工業	102,000	5,800.00	591,600,000	貸付有価証券 200株
1972	三晃金属工業	1,500	4,540.00	6,810,000	
1975	朝日工業社	35,500	1,378.00	48,919,000	
1976	明星工業	73,700	1,291.00	95,146,700	
1979	大気社	43,900	5,140.00	225,646,000	
1980	ダイダン	50,100	3,045.00	152,554,500	
1982	日比谷総合設備	27,600	3,560.00	98,256,000	
3267	フィル・カンパニー	5,900	719.00	4,242,100	貸付有価証券 800株
5074	テスホールディングス	82,000	429.00	35,178,000	
5076	インフロニア・ホールディングス	439,000	1,299.50	570,480,500	貸付有価証券 14,100株
6330	東洋エンジニアリング	56,000	887.00	49,672,000	
6379	レイズネクスト	55,100	1,832.00	100,943,200	
2001	ニッポン	114,400	2,340.00	267,696,000	
2002	日清製粉グループ本社	353,500	1,851.50	654,505,250	
2003	日東富士製粉	6,800	7,450.00	50,660,000	
2004	昭和産業	37,000	3,110.00	115,070,000	
2009	鳥越製粉	9,900	698.00	6,910,200	貸付有価証券 2,100株
2053	中部飼料	52,900	1,622.00	85,803,800	
2060	フィード・ワン	55,900	976.00	54,558,400	貸付有価証券 2,000株
2107	東洋精糖	2,200	1,652.00	3,634,400	
2108	日本甜菜製糖	22,300	2,167.00	48,324,100	
2109	DM三井製糖ホールディングス	37,900	3,395.00	128,670,500	
2112	塩水港精糖	15,700	268.00	4,207,600	
2117	ウェルネオシュガー	19,100	2,356.00	44,999,600	
2201	森永製菓	161,500	2,522.50	407,383,750	
2204	中村屋	9,500	3,270.00	31,065,000	

2206	江崎グリコ	109,400	4,237.00	463,527,800	
2207	名糖産業	15,100	2,000.00	30,200,000	
2209	井村屋グループ	22,800	2,448.00	55,814,400	
2211	不二家	26,200	2,659.00	69,665,800	貸付有価証券 1,000株
2212	山崎製パン	255,900	3,409.00	872,363,100	貸付有価証券 1,400株
2215	第一屋製パン	2,200	684.00	1,504,800	貸付有価証券 200株
2217	モロゾフ	12,400	4,770.00	59,148,000	
2220	亀田製菓	21,900	4,250.00	93,075,000	貸付有価証券 100株
2222	寿スピリッツ	180,700	1,822.50	329,325,750	
2229	カルビー	175,000	3,138.00	549,150,000	
2264	森永乳業	133,500	3,309.00	441,751,500	
2266	六甲バター	28,000	1,561.00	43,708,000	
2267	ヤクルト本社	546,300	2,924.00	1,597,381,200	貸付有価証券 13,300株
2269	明治ホールディングス	468,700	3,467.00	1,624,982,900	
2270	雪印メグミルク	92,500	2,614.00	241,795,000	
2281	プリマハム	51,300	2,396.00	122,914,800	
2282	日本ハム	164,400	4,908.00	806,875,200	
2286	林兼産業	4,000	528.00	2,112,000	
2288	丸大食品	38,500	1,735.00	66,797,500	
2292	S F o o d s	42,200	2,957.00	124,785,400	貸付有価証券 200株
2294	柿安本店	14,900	2,634.00	39,246,600	
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	58,400	4,280.00	249,952,000	
2501	サッポロホールディングス	125,800	5,587.00	702,844,600	
2502	アサヒグループホールディングス	883,300	5,794.00	5,117,840,200	
2503	キリンホールディングス	1,592,400	2,132.50	3,395,793,000	
2531	宝ホールディングス	257,800	1,086.50	280,099,700	
2533	オエノンホールディングス	114,300	382.00	43,662,600	
2540	養命酒製造	12,600	2,229.00	28,085,400	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	299,500	2,015.00	603,492,500	
2585	ライフドリンク カンパニー	7,600	6,580.00	50,008,000	
2587	サントリー食品インターナショナル	269,200	5,842.00	1,572,666,400	
2590	ダイドーグループホールディングス	43,300	2,715.00	117,559,500	貸付有価証券 2,400株

2593	伊藤園	129,500	3,557.00	460,631,500	
2594	キーコーヒー	42,800	2,080.00	89,024,000	
2597	ユニカフェ	4,000	921.00	3,684,000	
2599	ジャパンフーズ	1,800	2,444.00	4,399,200	
2602	日清オイリオグループ	53,800	4,960.00	266,848,000	
2607	不二製油グループ本社	89,000	2,908.00	258,812,000	
2612	かどや製油	1,200	3,645.00	4,374,000	
2613	J-オイルミルズ	43,800	2,001.00	87,643,800	貸付有価証券 1,000株
2801	キッコーマン	1,266,700	1,899.50	2,406,096,650	
2802	味の素	908,500	5,846.00	5,311,091,000	
2804	ブルドックソース	20,300	1,998.00	40,559,400	貸付有価証券 900株
2809	キューピー	205,400	3,220.00	661,388,000	貸付有価証券 7,300株
2810	ハウス食品グループ本社	131,700	2,911.50	383,444,550	
2811	カゴメ	164,400	3,320.00	545,808,000	貸付有価証券 5,800株
2815	アリアケジャパン	38,100	5,070.00	193,167,000	
2818	ピエトロ	1,600	1,801.00	2,881,600	
2819	エバラ食品工業	9,100	2,944.00	26,790,400	
2820	やまみ	1,000	3,260.00	3,260,000	貸付有価証券 200株
2871	ニチレイ	175,200	3,570.00	625,464,000	貸付有価証券 1,300株
2875	東洋水産	193,200	9,705.00	1,875,006,000	貸付有価証券 5,200株
2882	イートアンドホールディングス	18,100	2,134.00	38,625,400	
2883	大冷	1,600	1,930.00	3,088,000	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	17,400	1,643.00	28,588,200	貸付有価証券 3,200株
2897	日清食品ホールディングス	403,200	4,095.00	1,651,104,000	
2899	永谷園ホールディングス	18,800	3,095.00	58,186,000	
2904	一正蒲鉾	5,100	772.00	3,937,200	貸付有価証券 1,700株
2908	フジッコ	39,300	1,866.00	73,333,800	
2910	ロック・フィールド	46,700	1,488.00	69,489,600	貸付有価証券 6,400株
2914	日本たばこ産業	2,323,000	4,491.00	10,432,593,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	26,300	2,043.00	53,730,900	
2918	わらべや日洋ホールディングス	25,600	2,321.00	59,417,600	貸付有価証券 1,800株

2922	なとり	24,000	2,103.00	50,472,000	
2924	イフジ産業	2,200	1,393.00	3,064,600	貸付有価証券 200株
2929	ファーマフーズ	50,700	1,014.00	51,409,800	
2931	ユーグレナ	238,000	551.00	131,138,000	貸付有価証券 19,000株
2933	紀文食品	33,100	1,283.00	42,467,300	
2935	ビックルスホールディングス	22,400	1,181.00	26,454,400	
4404	ミヨシ油脂	4,400	1,507.00	6,630,800	貸付有価証券 600株
4526	理研ビタミン	33,000	2,769.00	91,377,000	
3001	片倉工業	35,800	2,216.00	79,332,800	
3002	グンゼ	27,600	5,680.00	156,768,000	
3101	東洋紡	168,100	1,064.00	178,858,400	
3103	ユニチカ	125,800	343.00	43,149,400	
3104	富士紡ホールディングス	17,000	4,970.00	84,490,000	
3106	倉敷紡績	27,600	4,995.00	137,862,000	
3109	シキボウ	25,100	1,120.00	28,112,000	
3201	日本毛織	99,700	1,348.00	134,395,600	
3202	ダイトウボウ	19,700	104.00	2,048,800	貸付有価証券 7,000株
3204	トーア紡コーポレーション	4,800	423.00	2,030,400	貸付有価証券 2,000株
3205	ダイドーリミテッド	15,500	817.00	12,663,500	貸付有価証券 7,100株
3302	帝国繊維	43,900	2,501.00	109,793,900	
3401	帝人	373,600	1,379.50	515,381,200	
3402	東レ	2,605,600	759.10	1,977,910,960	
3501	住江織物	2,200	2,518.00	5,539,600	貸付有価証券 200株
3512	日本フエルト	7,000	499.00	3,493,000	貸付有価証券 500株
3513	イチカワ	1,500	1,783.00	2,674,500	
3524	日東製網	1,300	1,505.00	1,956,500	貸付有価証券 100株
3529	アツギ	8,200	630.00	5,166,000	貸付有価証券 3,600株
3551	ダイニック	3,600	830.00	2,988,000	貸付有価証券 400株
3569	セーレン	75,100	2,418.00	181,591,800	
3571	ソトー	3,800	712.00	2,705,600	
3577	東海染工	1,100	833.00	916,300	

3580	小松マテーレ	56,400	757.00	42,694,800	
3591	ワコールホールディングス	79,700	4,408.00	351,317,600	貸付有価証券 2,500株
3593	ホギメディカル	51,300	3,990.00	204,687,000	
3607	クラウドディアホールディングス	2,800	426.00	1,192,800	貸付有価証券 1,100株
3608	T S I ホールディングス	116,600	946.00	110,303,600	
3611	マツオカコーポレーション	3,600	1,775.00	6,390,000	貸付有価証券 100株
3612	ワールド	54,900	2,120.00	116,388,000	貸付有価証券 1,800株
8011	三陽商会	16,500	2,471.00	40,771,500	
8013	ナイガイ	4,100	261.00	1,070,100	貸付有価証券 1,600株
8016	オンワードホールディングス	229,300	633.00	145,146,900	貸付有価証券 8,800株
8029	ルックホールディングス	12,200	2,814.00	34,330,800	
8107	キムラタン	77,000	17.00	1,309,000	貸付有価証券 23,300株
8111	ゴールドウイン	68,900	8,820.00	607,698,000	貸付有価証券 700株
8114	デサント	67,000	3,445.00	230,815,000	
8118	キング	4,600	732.00	3,367,200	貸付有価証券 1,200株
8127	ヤマトインターナショナル	9,500	354.00	3,363,000	
3708	特種東海製紙	21,200	3,725.00	78,970,000	
3861	王子ホールディングス	1,620,100	626.70	1,015,316,670	
3863	日本製紙	219,400	964.00	211,501,600	
3864	三菱製紙	16,200	800.00	12,960,000	貸付有価証券 5,100株
3865	北越コーポレーション	191,100	1,115.00	213,076,500	貸付有価証券 28,800株
3877	中越パルプ工業	4,800	1,533.00	7,358,400	貸付有価証券 1,900株
3880	大王製紙	171,800	879.10	151,029,380	
3896	阿波製紙	3,000	554.00	1,662,000	貸付有価証券 1,500株
3941	レンゴー	354,200	1,025.50	363,232,100	
3946	トーモク	22,500	2,869.00	64,552,500	貸付有価証券 800株
3950	ザ・バック	28,900	3,675.00	106,207,500	
2930	北の達人コーポレーション	163,900	181.00	29,665,900	貸付有価証券 21,300株
3405	クラレ	566,700	1,901.50	1,077,580,050	

3407	旭化成	2,631,000	1,033.00	2,717,823,000	
3553	共和レザー	7,000	806.00	5,642,000	
3878	巴川コーポレーション	3,400	1,091.00	3,709,400	貸付有価証券 1,300株
4004	レゾナック・ホールディングス	375,800	3,411.00	1,281,853,800	
4005	住友化学	2,886,000	334.10	964,212,600	
4008	住友精化	18,300	5,270.00	96,441,000	
4021	日産化学	181,400	4,940.00	896,116,000	
4022	ラサ工業	15,000	2,931.00	43,965,000	
4023	クレハ	85,000	2,787.00	236,895,000	
4025	多木化学	15,100	4,455.00	67,270,500	貸付有価証券 200株
4027	テイカ	31,900	1,674.00	53,400,600	
4028	石原産業	64,500	1,585.00	102,232,500	
4031	片倉コープアグリ	2,800	1,199.00	3,357,200	貸付有価証券 1,300株
4041	日本曹達	45,900	5,160.00	236,844,000	
4042	東ソー	519,200	2,099.00	1,089,800,800	貸付有価証券 3,100株
4043	トクヤマ	125,600	2,924.00	367,254,400	
4044	セントラル硝子	41,500	3,725.00	154,587,500	
4045	東亜合成	187,000	1,544.00	288,728,000	貸付有価証券 600株
4046	大阪ソーダ	27,200	10,400.00	282,880,000	
4047	関東電化工業	75,200	964.00	72,492,800	貸付有価証券 2,700株
4061	デンカ	141,400	2,164.50	306,060,300	
4063	信越化学工業	3,487,500	6,125.00	21,360,937,500	
4064	日本カーバイド工業	18,500	1,998.00	36,963,000	
4078	堺化学工業	29,600	2,942.00	87,083,200	
4082	第一稀元素化学工業	42,500	841.00	35,742,500	
4088	エア・ウォーター	366,900	2,197.00	806,079,300	
4091	日本酸素ホールディングス	377,300	4,735.00	1,786,515,500	貸付有価証券 400株
4092	日本化学工業	14,300	2,629.00	37,594,700	
4093	東邦アセチレン	13,300	374.00	4,974,200	貸付有価証券 3,000株
4095	日本パーカライジング	173,300	1,275.00	220,957,500	貸付有価証券 6,800株
4097	高圧ガス工業	56,500	978.00	55,257,000	
4098	チタン工業	1,600	1,025.00	1,640,000	貸付有価証券

					500 株
4099	四国化成ホールディングス	44,000	2,081.00	91,564,000	
4100	戸田工業	8,900	2,149.00	19,126,100	
4109	ステラ ケミファ	21,100	4,285.00	90,413,500	
4112	保土谷化学工業	12,200	5,710.00	69,662,000	
4114	日本触媒	226,500	1,594.50	361,154,250	
4116	大日精化工業	27,000	3,430.00	92,610,000	
4118	カネカ	95,800	4,274.00	409,449,200	
4182	三菱瓦斯化学	283,900	3,057.00	867,882,300	
4183	三井化学	320,800	4,375.00	1,403,500,000	
4186	東京応化工業	185,600	4,280.00	794,368,000	
4187	大阪有機化学工業	32,500	3,495.00	113,587,500	
4188	三菱ケミカルグループ	2,843,100	889.00	2,527,515,900	貸付有価証券 89,900 株
4189	KHネオケム	59,300	2,327.00	137,991,100	
4202	ダイセル	499,900	1,588.50	794,091,150	
4203	住友ベークライト	108,900	4,643.00	505,622,700	
4204	積水化学工業	781,400	2,241.50	1,751,508,100	貸付有価証券 600 株
4205	日本ゼオン	266,600	1,373.50	366,175,100	
4206	アイカ工業	98,100	3,529.00	346,194,900	
4208	UBE	185,000	2,842.50	525,862,500	
4212	積水樹脂	58,000	2,330.00	135,140,000	
4215	タキロンシーアイ	99,200	744.00	73,804,800	
4216	旭有機材	25,900	4,955.00	128,334,500	
4218	ニチバン	21,100	1,948.00	41,102,800	貸付有価証券 900 株
4220	リケンテクノス	72,900	1,030.00	75,087,000	貸付有価証券 100 株
4221	大倉工業	18,000	2,878.00	51,804,000	
4228	積水化成成品工業	54,600	468.00	25,552,800	
4229	群栄化学工業	9,100	3,300.00	30,030,000	
4231	タイガースポリマー	5,400	847.00	4,573,800	
4238	ミライアル	4,200	1,548.00	6,501,600	
4245	ダイキアクシス	4,700	733.00	3,445,100	
4246	ダイキョーニシカワ	85,800	700.00	60,060,000	
4248	竹本容器	4,200	869.00	3,649,800	
4249	森六ホールディングス	20,200	2,834.00	57,246,800	

4251	恵和	28,000	1,664.00	46,592,000	貸付有価証券 2,400株
4272	日本化薬	297,100	1,236.00	367,215,600	
4275	カーリットホールディングス	41,900	1,297.00	54,344,300	
4362	日本精化	25,800	2,709.00	69,892,200	
4368	扶桑化学工業	41,200	4,100.00	168,920,000	
4369	トリケミカル研究所	47,200	4,225.00	199,420,000	
4401	A D E K A	135,600	3,183.00	431,614,800	
4403	日油	352,100	2,136.00	752,085,600	
4406	新日本理化	16,600	186.00	3,087,600	貸付有価証券 2,400株
4410	ハリマ化成グループ	27,300	924.00	25,225,200	
4452	花王	879,400	6,792.00	5,972,884,800	
4461	第一工業製薬	15,500	3,765.00	58,357,500	貸付有価証券 500株
4462	石原ケミカル	17,400	2,283.00	39,724,200	
4463	日華化学	4,800	1,085.00	5,208,000	
4465	ニイタカ	2,200	1,887.00	4,151,400	貸付有価証券 600株
4471	三洋化成工業	23,900	3,960.00	94,644,000	貸付有価証券 100株
4531	有機合成薬品工業	9,400	305.00	2,867,000	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	43,100	1,325.00	57,107,500	
4612	日本ペイントホールディングス	2,065,000	1,065.00	2,199,225,000	
4613	関西ペイント	336,100	2,535.50	852,181,550	貸付有価証券 13,900株
4615	神東塗料	10,000	130.00	1,300,000	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	79,900	2,002.00	159,959,800	
4619	日本特殊塗料	8,600	1,231.00	10,586,600	
4620	藤倉化成	44,800	537.00	24,057,600	
4626	太陽ホールディングス	67,700	3,290.00	222,733,000	
4631	D I C	152,000	3,156.00	479,712,000	貸付有価証券 600株
4633	サカタインクス	86,500	1,832.00	158,468,000	
4634	a r t i e n c e	84,600	3,285.00	277,911,000	
4901	富士フイルムホールディングス	2,167,200	3,702.00	8,022,974,400	
4911	資生堂	813,100	4,740.00	3,854,094,000	
4912	ライオン	495,600	1,291.50	640,067,400	
4914	高砂香料工業	29,300	3,920.00	114,856,000	

4917	マンドラム	84,100	1,233.00	103,695,300	
4919	ミルボン	52,900	3,395.00	179,595,500	
4921	ファンケル	170,300	2,772.00	472,071,600	貸付有価証券 13,600株
4922	コーセー	79,200	10,700.00	847,440,000	貸付有価証券 100株
4923	コタ	39,400	1,578.00	62,173,200	貸付有価証券 1,300株
4926	シーボン	1,600	1,394.00	2,230,400	貸付有価証券 600株
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	199,600	1,369.50	273,352,200	
4928	ノエビアホールディングス	34,700	5,570.00	193,279,000	
4929	アジュバンホールディングス	2,900	883.00	2,560,700	貸付有価証券 1,500株
4931	新日本製薬	22,200	1,738.00	38,583,600	
4933	I - n e	10,300	1,800.00	18,540,000	貸付有価証券 100株
4936	アクシージア	25,600	1,039.00	26,598,400	貸付有価証券 600株
4951	エステー	30,100	1,570.00	47,257,000	
4955	アグロ カネショウ	15,600	1,218.00	19,000,800	貸付有価証券 1,900株
4956	コニシ	112,500	1,308.00	147,150,000	
4958	長谷川香料	74,400	3,345.00	248,868,000	
4967	小林製薬	113,300	5,621.00	636,859,300	貸付有価証券 4,000株
4968	荒川化学工業	33,000	1,196.00	39,468,000	
4971	メック	32,100	4,590.00	147,339,000	
4973	日本高純度化学	8,800	3,375.00	29,700,000	
4974	タカラバイオ	104,900	1,053.00	110,459,700	
4975	J C U	43,000	3,980.00	171,140,000	
4977	新田ゼラチン	7,900	780.00	6,162,000	
4979	O A Tアグリオ	14,500	1,687.00	24,461,500	
4980	デクセリアルズ	96,200	7,190.00	691,678,000	
4985	アース製薬	35,400	4,765.00	168,681,000	貸付有価証券 1,300株
4992	北興化学工業	39,200	1,481.00	58,055,200	貸付有価証券 1,400株
4994	大成ラミック	11,300	2,829.00	31,967,700	
4996	クミアイ化学工業	154,700	797.00	123,295,900	
4997	日本農薬	71,400	781.00	55,763,400	貸付有価証券 2,600株

5142	アキレス	24,500	1,629.00	39,910,500	
5208	有沢製作所	68,200	1,597.00	108,915,400	
6988	日東電工	250,100	12,890.00	3,223,789,000	
7874	レック	49,900	1,356.00	67,664,400	貸付有価証券 2,000株
7888	三光合成	49,000	712.00	34,888,000	
7908	きもと	20,100	222.00	4,462,200	
7917	藤森工業	30,800	4,195.00	129,206,000	
7925	前澤化成工業	25,100	1,814.00	45,531,400	
7931	未来工業	13,900	3,985.00	55,391,500	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	4,200	655.00	2,751,000	
7942	J S P	27,400	2,294.00	62,855,600	
7947	エフピコ	73,700	2,412.00	177,764,400	
7958	天馬	28,200	2,696.00	76,027,200	
7970	信越ポリマー	84,000	1,500.00	126,000,000	
7971	東リ	27,900	393.00	10,964,700	
7988	ニフコ	116,500	3,821.00	445,146,500	
7995	バルカー	32,600	3,630.00	118,338,000	
8113	ユニ・チャーム	811,200	5,271.00	4,275,835,200	
9385	ショーエイコーポレーション	3,600	600.00	2,160,000	貸付有価証券 700株
4151	協和キリン	470,400	2,747.50	1,292,424,000	貸付有価証券 500株
4502	武田薬品工業	3,446,300	4,176.00	14,391,748,800	
4503	アステラス製薬	3,415,700	1,578.50	5,391,682,450	
4506	住友ファーマ	288,900	357.00	103,137,300	
4507	塩野義製薬	473,600	6,224.00	2,947,686,400	
4512	わかもと製薬	12,700	258.00	3,276,600	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	102,000	3,207.00	327,114,000	貸付有価証券 3,300株
4519	中外製薬	1,218,900	5,637.00	6,870,939,300	
4521	科研製薬	66,700	3,800.00	253,460,000	貸付有価証券 800株
4523	エーザイ	473,600	6,632.00	3,140,915,200	
4527	ロート製薬	377,200	3,336.00	1,258,339,200	貸付有価証券 400株
4528	小野薬品工業	796,500	2,230.50	1,776,593,250	貸付有価証券 21,600株
4530	久光製薬	86,600	3,768.00	326,308,800	貸付有価証券

					600 株
4534	持田製薬	43,500	3,100.00	134,850,000	
4536	参天製薬	687,000	1,627.00	1,117,749,000	
4538	扶桑薬品工業	13,700	2,399.00	32,866,300	
4539	日本ケミファ	1,400	1,598.00	2,237,200	貸付有価証券 600 株
4540	ツムラ	122,600	4,259.00	522,153,400	貸付有価証券 1,200 株
4547	キッセイ薬品工業	64,400	3,225.00	207,690,000	
4548	生化学工業	66,000	889.00	58,674,000	
4549	栄研化学	67,100	2,205.00	147,955,500	
4551	鳥居薬品	20,900	3,720.00	77,748,000	
4552	J C R ファーマ	131,800	606.00	79,870,800	
4553	東和薬品	59,800	2,908.00	173,898,400	
4554	富士製薬工業	28,800	1,437.00	41,385,600	貸付有価証券 1,400 株
4559	ゼリア新薬工業	54,000	2,079.00	112,266,000	
4565	ネクセラファーマ	170,400	1,588.00	270,595,200	貸付有価証券 1,400 株
4568	第一三共	3,392,300	5,558.00	18,854,403,400	
4569	杏林製薬	84,400	1,706.00	143,986,400	
4574	大幸薬品	80,900	408.00	33,007,200	
4577	ダイト	29,600	2,309.00	68,346,400	貸付有価証券 100 株
4578	大塚ホールディングス	809,900	6,588.00	5,335,621,200	
4587	ペプチドリーム	188,800	2,365.50	446,606,400	貸付有価証券 3,400 株
4880	セルソース	14,400	1,272.00	18,316,800	貸付有価証券 100 株
4886	あすか製薬ホールディングス	39,900	2,656.00	105,974,400	
4887	サワイグループホールディングス	89,000	5,865.00	521,985,000	
3315	日本コークス工業	395,100	124.00	48,992,400	貸付有価証券 8,500 株
5011	ニチレキ	50,600	2,483.00	125,639,800	貸付有価証券 200 株
5013	ユシロ化学工業	20,200	1,850.00	37,370,000	
5015	ビーピー・カストロール	4,700	991.00	4,657,700	貸付有価証券 400 株
5017	富士石油	113,500	518.00	58,793,000	貸付有価証券 11,800 株
5018	MORESCO	4,300	1,340.00	5,762,000	貸付有価証券 1,600 株

5019	出光興産	2,022,000	1,052.00	2,127,144,000	
5020	E N E O S ホールディングス	6,164,700	832.40	5,131,496,280	
5021	コスモエネルギーホールディングス	115,500	8,116.00	937,398,000	
5101	横浜ゴム	196,900	3,627.00	714,156,300	
5105	TOYO TIRE	223,800	2,658.50	594,972,300	貸付有価証券 600株
5108	ブリヂストン	1,139,800	6,490.00	7,397,302,000	
5110	住友ゴム工業	381,900	1,630.50	622,687,950	
5121	藤倉コンポジット	33,700	1,392.00	46,910,400	
5122	オカモト	18,400	5,030.00	92,552,000	
5185	フコク	20,500	2,331.00	47,785,500	
5186	ニッタ	39,600	4,105.00	162,558,000	
5191	住友理工	60,400	1,453.00	87,761,200	
5192	三ツ星ベルト	45,200	4,435.00	200,462,000	
5195	バンドー化学	57,800	1,994.00	115,253,200	
3110	日東紡績	49,300	6,300.00	310,590,000	
5201	A G C	347,300	5,331.00	1,851,456,300	
5202	日本板硝子	185,800	430.00	79,894,000	貸付有価証券 7,000株
5204	石塚硝子	2,100	2,921.00	6,134,100	貸付有価証券 800株
5210	日本山村硝子	4,600	1,699.00	7,815,400	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	158,900	3,686.00	585,705,400	
5218	オハラ	18,500	1,349.00	24,956,500	
5232	住友大阪セメント	64,800	3,907.00	253,173,600	
5233	太平洋セメント	230,200	3,999.00	920,569,800	
5262	日本ヒューム	34,100	1,180.00	40,238,000	
5269	日本コンクリート工業	75,500	379.00	28,614,500	貸付有価証券 2,700株
5273	三谷セキサン	16,300	5,940.00	96,822,000	
5288	アジアパイルホールディングス	55,300	980.00	54,194,000	
5301	東海カーボン	359,300	943.30	338,927,690	
5302	日本カーボン	20,600	5,390.00	111,034,000	
5310	東洋炭素	27,400	6,680.00	183,032,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	43,100	3,945.00	170,029,500	貸付有価証券 1,400株
5332	T O T O	257,000	3,903.00	1,003,071,000	貸付有価証券 9,100株
5333	日本碍子	452,900	2,041.00	924,368,900	

5334	日本特殊陶業	326,100	4,660.00	1,519,626,000	貸付有価証券 10,500株
5337	ダントーホールディングス	8,000	763.00	6,104,000	貸付有価証券 4,800株
5344	MARUWA	14,400	38,350.00	552,240,000	貸付有価証券 600株
5351	品川リフラクトリーズ	47,900	1,985.00	95,081,500	
5352	黒崎播磨	31,800	2,835.00	90,153,000	
5357	ヨータイ	22,800	1,840.00	41,952,000	
5363	東京窯業	13,000	438.00	5,694,000	
5367	ニッカトー	5,400	569.00	3,072,600	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	104,700	2,948.00	308,655,600	貸付有価証券 3,300株
5388	クニミネ工業	3,400	1,148.00	3,903,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,200	1,364.00	3,000,800	
5393	ニチアス	98,500	4,570.00	450,145,000	
7943	ニチハ	48,800	3,380.00	164,944,000	
5401	日本製鉄	1,795,900	3,395.00	6,097,080,500	貸付有価証券 63,100株
5406	神戸製鋼所	805,600	1,980.00	1,595,088,000	貸付有価証券 28,400株
5408	中山製鋼所	91,600	951.00	87,111,600	
5410	合同製鐵	22,400	5,200.00	116,480,000	貸付有価証券 200株
5411	J F Eホールディングス	1,114,100	2,321.00	2,585,826,100	
5423	東京製鐵	112,600	1,663.00	187,253,800	貸付有価証券 4,000株
5440	共英製鋼	45,600	2,095.00	95,532,000	貸付有価証券 800株
5444	大和工業	75,500	7,894.00	595,997,000	貸付有価証券 500株
5445	東京鐵鋼	17,700	5,090.00	90,093,000	貸付有価証券 200株
5449	大阪製鐵	18,400	2,362.00	43,460,800	
5451	淀川製鋼所	45,500	5,490.00	249,795,000	貸付有価証券 500株
5461	中部鋼鈑	26,300	2,973.00	78,189,900	
5463	丸一鋼管	122,000	3,736.00	455,792,000	
5464	モリ工業	9,100	5,200.00	47,320,000	
5471	大同特殊鋼	252,300	1,487.50	375,296,250	貸付有価証券 500株
5476	日本高周波鋼業	4,700	473.00	2,223,100	貸付有価証券 2,000株

5480	日本冶金工業	29,300	4,550.00	133,315,000	
5481	山陽特殊製鋼	39,600	2,134.00	84,506,400	
5482	愛知製鋼	23,100	3,630.00	83,853,000	
5491	日本金属	3,200	780.00	2,496,000	貸付有価証券 1,000株
5541	大平洋金属	34,100	1,287.00	43,886,700	
5563	新日本電工	199,200	298.00	59,361,600	
5602	栗本鐵工所	18,600	4,780.00	88,908,000	
5603	虹技	1,500	1,164.00	1,746,000	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	1,400	1,648.00	2,307,200	
5632	三菱製鋼	29,700	1,514.00	44,965,800	
5658	日亜鋼業	12,600	325.00	4,095,000	
5659	日本精線	31,800	1,237.00	39,336,600	
5698	エンビプロ・ホールディングス	35,500	481.00	17,075,500	
6319	シンニッタン	15,700	233.00	3,658,100	貸付有価証券 6,100株
7305	新家工業	2,700	5,300.00	14,310,000	貸付有価証券 1,000株
5702	大紀アルミニウム工業所	50,700	1,313.00	66,569,100	
5703	日本軽金属ホールディングス	117,000	1,832.00	214,344,000	
5706	三井金属鉱業	116,600	5,084.00	592,794,400	
5707	東邦亜鉛	25,600	858.00	21,964,800	貸付有価証券 900株
5711	三菱マテリアル	286,400	2,992.50	857,052,000	
5713	住友金属鉱山	464,500	4,948.00	2,298,346,000	
5714	DOWAホールディングス	99,000	5,782.00	572,418,000	
5715	古河機械金属	52,900	1,861.00	98,446,900	
5721	エス・サイエンス	60,400	22.00	1,328,800	貸付有価証券 19,300株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	69,500	2,807.00	195,086,500	貸付有価証券 4,600株
5727	東邦チタニウム	82,800	1,430.00	118,404,000	貸付有価証券 7,800株
5741	U A C J	56,100	3,970.00	222,717,000	
5757	C Kサンエツ	9,700	3,845.00	37,296,500	
5801	古河電気工業	133,400	4,055.00	540,937,000	
5802	住友電気工業	1,498,500	2,512.50	3,764,981,250	貸付有価証券 12,700株
5803	フジクラ	472,500	3,111.00	1,469,947,500	
5805	SWCC	44,800	4,835.00	216,608,000	

5809	タツタ電線	71,300	728.00	51,906,400	貸付有価証券 8,600株
5819	カナレ電気	2,000	1,600.00	3,200,000	
5821	平河ヒューテック	25,600	1,508.00	38,604,800	
5851	リョービ	42,700	2,344.00	100,088,800	
5852	アーレスティ	13,700	737.00	10,096,900	貸付有価証券 5,700株
5857	A R Eホールディングス	150,400	2,079.00	312,681,600	
3421	稲葉製作所	22,200	1,931.00	42,868,200	
3431	宮地エンジニアリンググループ	20,100	4,765.00	95,776,500	
3433	トーカロ	115,500	2,013.00	232,501,500	
3434	アルファC o	4,600	1,420.00	6,532,000	
3436	S U M C O	711,800	2,338.00	1,664,188,400	
3443	川田テクノロジーズ	28,400	2,755.00	78,242,000	
3445	R S T e c h n o l o g i e s	26,800	3,440.00	92,192,000	
3446	ジェイテックコーポレーション	1,600	1,618.00	2,588,800	貸付有価証券 500株
3447	信和	7,900	764.00	6,035,600	
5901	東洋製罐グループホールディングス	229,800	2,542.00	584,151,600	貸付有価証券 500株
5902	ホッカンホールディングス	19,600	1,788.00	35,044,800	貸付有価証券 700株
5909	コロナ	22,400	997.00	22,332,800	
5911	横河ブリッジホールディングス	62,700	2,686.00	168,412,200	
5915	駒井ハルテック	2,200	1,856.00	4,083,200	貸付有価証券 800株
5923	高田機工	900	3,735.00	3,361,500	貸付有価証券 100株
5929	三和ホールディングス	399,000	2,923.50	1,166,476,500	貸付有価証券 9,800株
5930	文化シャッター	104,800	1,712.00	179,417,600	
5932	三協立山	50,400	815.00	41,076,000	貸付有価証券 1,700株
5933	アルインコ	30,500	1,103.00	33,641,500	
5936	東洋シャッター	2,800	930.00	2,604,000	
5938	L I X I L	625,500	1,718.50	1,074,921,750	
5942	日本ファイルコン	8,100	528.00	4,276,800	
5943	ノーリツ	63,400	1,794.00	113,739,600	
5946	長府製作所	39,800	2,216.00	88,196,800	
5947	リンナイ	191,700	3,745.00	717,916,500	
5951	ダイニチ工業	6,200	694.00	4,302,800	

5957	日東精工	58,100	589.00	34,220,900	
5958	三洋工業	1,400	3,240.00	4,536,000	
5959	岡部	71,600	782.00	55,991,200	貸付有価証券 2,600株
5970	ジーテクト	51,000	1,959.00	99,909,000	
5975	東プレ	70,600	2,144.00	151,366,400	
5976	高周波熱錬	59,300	1,092.00	64,755,600	貸付有価証券 4,400株
5981	東京製綱	26,000	1,376.00	35,776,000	貸付有価証券 500株
5985	サンコール	40,100	470.00	18,847,000	
5986	モリテック スチール	10,500	231.00	2,425,500	貸付有価証券 3,400株
5988	パイオラックス	49,700	2,325.00	115,552,500	貸付有価証券 300株
5989	エイチワン	41,200	1,012.00	41,694,400	
5991	日本発條	354,400	1,603.00	568,103,200	
5992	中央発條	29,700	1,251.00	37,154,700	
5998	アドバネクス	1,600	1,111.00	1,777,600	貸付有価証券 600株
7989	立川ブラインド工業	18,100	1,365.00	24,706,500	
8155	三益半導体工業	36,100	3,695.00	133,389,500	
1909	日本ドライケミカル	2,800	2,682.00	7,509,600	
5631	日本製鋼所	108,000	4,227.00	456,516,000	貸付有価証券 200株
6005	三浦工業	163,700	3,099.00	507,306,300	
6013	タクマ	132,600	1,670.00	221,442,000	
6101	ツガミ	87,100	1,552.00	135,179,200	
6103	オークマ	34,300	6,933.00	237,801,900	貸付有価証券 1,400株
6104	芝浦機械	39,200	3,755.00	147,196,000	
6113	アマダ	594,300	1,755.00	1,042,996,500	
6118	アイダエンジニアリング	90,700	904.00	81,992,800	
6134	F U J I	184,600	2,518.00	464,822,800	貸付有価証券 2,400株
6135	牧野フライス製作所	43,400	6,660.00	289,044,000	
6136	オーエスジー	172,800	1,973.50	341,020,800	貸付有価証券 6,100株
6138	ダイジェット工業	1,200	862.00	1,034,400	
6140	旭ダイヤモンド工業	90,400	973.00	87,959,200	
6141	DMG森精機	267,900	4,306.00	1,153,577,400	貸付有価証券 700株

6143	ソディック	95,500	731.00	69,810,500	
6146	ディスコ	188,800	59,700.00	11,271,360,000	
6151	日東工器	19,000	2,404.00	45,676,000	
6157	日進工具	36,300	1,002.00	36,372,600	
6165	パンチ工業	11,700	480.00	5,616,000	
6167	富士ダイス	26,100	841.00	21,950,100	貸付有価証券 200株
6203	豊和工業	6,600	834.00	5,504,400	貸付有価証券 1,000株
6208	石川製作所	3,100	1,667.00	5,167,700	貸付有価証券 1,000株
6209	リケンN P R	42,500	2,827.00	120,147,500	
6210	東洋機械金属	8,800	730.00	6,424,000	
6217	津田駒工業	2,200	405.00	891,000	貸付有価証券 800株
6218	エンシュウ	2,900	706.00	2,047,400	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	62,400	1,675.00	104,520,000	貸付有価証券 100株
6235	オプトラン	64,400	2,013.00	129,637,200	
6236	N C ホールディングス	2,900	2,206.00	6,397,400	貸付有価証券 1,300株
6237	イワキポンプ	26,100	2,832.00	73,915,200	
6238	フリー	37,000	1,067.00	39,479,000	
6240	ヤマシンフィルタ	93,200	406.00	37,839,200	
6247	日阪製作所	42,800	1,067.00	45,667,600	
6250	やまびこ	64,000	2,237.00	143,168,000	
6254	野村マイクロ・サイエンス	53,100	4,245.00	225,409,500	貸付有価証券 4,000株
6258	平田機工	18,700	6,630.00	123,981,000	
6262	P E G A S U S	43,300	590.00	25,547,000	
6264	マルマエ	17,100	2,045.00	34,969,500	貸付有価証券 1,800株
6266	タツモ	23,700	3,490.00	82,713,000	貸付有価証券 2,000株
6268	ナプテスコ	246,100	2,778.00	683,665,800	
6269	三井海洋開発	49,600	2,959.00	146,766,400	
6272	レオン自動機	45,300	1,703.00	77,145,900	
6273	SMC	117,400	76,260.00	8,952,924,000	
6277	ホソカワミクロン	27,400	4,205.00	115,217,000	
6278	ユニオンツール	17,200	6,000.00	103,200,000	

6279	瑞光	28,200	1,083.00	30,540,600	貸付有価証券 1,200株
6282	オイレス工業	53,200	2,366.00	125,871,200	貸付有価証券 400株
6284	日精エー・エス・ビー機械	13,400	5,480.00	73,432,000	
6287	サトーホールディングス	55,800	2,139.00	119,356,200	
6289	技研製作所	36,800	1,953.00	71,870,400	貸付有価証券 100株
6291	日本エアータック	18,300	1,209.00	22,124,700	貸付有価証券 600株
6292	カワタ	3,800	897.00	3,408,600	貸付有価証券 1,300株
6293	日精樹脂工業	29,100	1,080.00	31,428,000	貸付有価証券 400株
6294	オカダアイヨン	4,100	2,525.00	10,352,500	
6298	ワイエイシイホールディングス	16,600	2,454.00	40,736,400	
6301	小松製作所	1,838,000	4,644.00	8,535,672,000	
6302	住友重機械工業	232,000	4,261.00	988,552,000	貸付有価証券 1,900株
6305	日立建機	156,200	4,270.00	666,974,000	
6306	日工	58,100	783.00	45,492,300	
6309	巴工業	15,300	4,720.00	72,216,000	
6310	井関農機	36,700	1,068.00	39,195,600	貸付有価証券 1,300株
6315	TOWA	43,600	10,810.00	471,316,000	
6316	丸山製作所	2,100	2,439.00	5,121,900	
6317	北川鉄工所	15,400	1,526.00	23,500,400	
6323	ローツェ	20,500	30,150.00	618,075,000	貸付有価証券 800株
6325	タカキタ	4,000	460.00	1,840,000	貸付有価証券 1,600株
6326	クボタ	2,050,100	2,295.00	4,704,979,500	
6328	荏原実業	20,700	4,055.00	83,938,500	
6331	三菱化工機	13,800	4,340.00	59,892,000	
6332	月島ホールディングス	53,000	1,459.00	77,327,000	
6333	帝国電機製作所	26,800	2,506.00	67,160,800	
6335	東京機械製作所	3,200	407.00	1,302,400	貸付有価証券 1,000株
6339	新東工業	79,200	1,141.00	90,367,200	
6340	澁谷工業	36,800	3,740.00	137,632,000	
6345	アイチ コーポレーション	54,100	1,244.00	67,300,400	
6349	小森コーポレーション	96,600	1,366.00	131,955,600	

6351	鶴見製作所	29,900	4,745.00	141,875,500	貸付有価証券 1,000株
6356	日本ギア工業	4,600	588.00	2,704,800	貸付有価証券 1,300株
6358	酒井重工業	6,900	5,900.00	40,710,000	
6361	荏原製作所	160,900	11,975.00	1,926,777,500	
6362	石井鐵工所	1,400	2,860.00	4,004,000	
6363	西島製作所	33,700	3,175.00	106,997,500	
6364	北越工業	39,400	2,445.00	96,333,000	
6367	ダイキン工業	468,100	23,020.00	10,775,662,000	
6368	オルガノ	47,100	8,300.00	390,930,000	
6369	トーヨーカネツ	13,300	3,950.00	52,535,000	
6370	栗田工業	219,300	6,776.00	1,485,976,800	貸付有価証券 400株
6371	椿本チエイン	53,800	6,050.00	325,490,000	
6373	大同工業	5,400	968.00	5,227,200	貸付有価証券 1,300株
6378	木村化工機	29,900	723.00	21,617,700	
6381	アネスト岩田	60,600	1,695.00	102,717,000	
6383	ダイフク	661,800	2,936.50	1,943,375,700	貸付有価証券 21,400株
6387	サムコ	9,300	3,975.00	36,967,500	貸付有価証券 1,200株
6390	加藤製作所	6,200	1,258.00	7,799,600	
6393	油研工業	2,000	2,397.00	4,794,000	貸付有価証券 300株
6395	タダノ	225,600	1,134.50	255,943,200	
6406	フジテック	91,600	4,431.00	405,879,600	
6407	C K D	108,500	3,120.00	338,520,000	
6412	平和	115,900	2,059.00	238,638,100	
6413	理想科学工業	31,400	3,295.00	103,463,000	貸付有価証券 300株
6417	S A N K Y O	377,500	1,704.50	643,448,750	
6418	日本金銭機械	47,400	1,325.00	62,805,000	貸付有価証券 4,900株
6419	マースグループホールディングス	19,800	3,705.00	73,359,000	
6420	フクシマガリレイ	25,600	6,540.00	167,424,000	
6428	オーイズミ	4,600	364.00	1,674,400	貸付有価証券 1,900株
6430	ダイコク電機	19,300	3,980.00	76,814,000	貸付有価証券 2,100株
6432	竹内製作所	71,100	5,680.00	403,848,000	

6436	アマノ	111,300	4,089.00	455,105,700	貸付有価証券 4,000株
6440	J U K I	60,700	521.00	31,624,700	
6444	サンデン	18,200	167.00	3,039,400	貸付有価証券 7,600株
6445	ジャノメ	39,700	696.00	27,631,200	
6454	マックス	55,200	3,795.00	209,484,000	
6457	グローリー	94,100	2,807.00	264,138,700	
6458	新晃工業	39,500	4,005.00	158,197,500	
6459	大和冷機工業	60,100	1,568.00	94,236,800	
6460	セガサミーホールディングス	350,200	2,373.50	831,199,700	貸付有価証券 1,200株
6463	T P R	49,800	2,584.00	128,683,200	
6464	ツバキ・ナカシマ	78,500	803.00	63,035,500	貸付有価証券 6,500株
6465	ホシザキ	231,400	5,109.00	1,182,222,600	
6470	大豊工業	33,900	820.00	27,798,000	
6471	日本精工	725,900	784.90	569,758,910	
6472	N T N	850,400	314.70	267,620,880	貸付有価証券 27,200株
6473	ジェイテクト	348,900	1,130.50	394,431,450	
6474	不二越	28,900	3,510.00	101,439,000	貸付有価証券 1,100株
6480	日本トムソン	106,700	613.00	65,407,100	
6481	T H K	226,200	2,895.00	654,849,000	貸付有価証券 300株
6482	ユーシン精機	31,000	765.00	23,715,000	
6485	前澤給装工業	28,100	1,335.00	37,513,500	貸付有価証券 100株
6486	イーグル工業	43,300	1,903.00	82,399,900	
6489	前澤工業	7,000	1,464.00	10,248,000	
6490	日本ビラー工業	36,400	5,300.00	192,920,000	
6498	キッツ	131,200	1,137.00	149,174,400	
6586	マキタ	447,200	4,386.00	1,961,419,200	
7003	三井E & S	194,600	1,449.00	281,975,400	貸付有価証券 22,600株
7004	日立造船	346,000	1,046.00	361,916,000	
7011	三菱重工業	6,857,500	1,650.00	11,314,875,000	
7013	I H I	292,000	4,477.00	1,307,284,000	
7022	サノヤスホールディングス	15,600	208.00	3,244,800	貸付有価証券 5,400株

7718	スター精密	72,100	2,110.00	152,131,000	
3105	日清紡ホールディングス	294,800	1,117.00	329,291,600	
4062	イビデン	204,500	6,565.00	1,342,542,500	貸付有価証券 1,700株
4902	コニカミノルタ	875,800	444.50	389,293,100	
6448	ブラザー工業	523,900	2,827.50	1,481,327,250	貸付有価証券 200株
6479	ミネベアミツミ	682,100	3,300.00	2,250,930,000	貸付有価証券 14,000株
6501	日立製作所	1,884,600	17,525.00	33,027,615,000	
6503	三菱電機	4,364,500	2,539.00	11,081,465,500	
6504	富士電機	238,400	9,098.00	2,168,963,200	
6505	東洋電機製造	4,000	1,095.00	4,380,000	
6506	安川電機	425,900	5,755.00	2,451,054,500	貸付有価証券 9,500株
6507	シンフォニアテクノロジー	43,300	3,275.00	141,807,500	
6508	明電舎	72,700	3,765.00	273,715,500	
6513	オリジン	2,700	1,330.00	3,591,000	
6516	山洋電気	17,000	7,090.00	120,530,000	
6517	デンヨー	29,900	2,911.00	87,038,900	貸付有価証券 700株
6523	PHCホールディングス	73,300	1,164.00	85,321,200	貸付有価証券 8,000株
6525	KOKUSAI ELECTRIC	203,500	4,560.00	927,960,000	
6526	ソシオネクスト	285,600	3,871.00	1,105,557,600	貸付有価証券 9,500株
6588	東芝テック	50,200	3,475.00	174,445,000	
6590	芝浦メカトロニクス	22,300	7,930.00	176,839,000	貸付有価証券 2,400株
6592	マブチモーター	192,800	2,462.00	474,673,600	
6594	ニデック	865,700	7,291.00	6,311,818,700	
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	24,600	378.00	9,298,800	
6616	トレックス・セミコンダクター	20,100	1,908.00	38,350,800	貸付有価証券 900株
6617	東光高岳	23,600	2,057.00	48,545,200	
6619	ダブル・スコープ	112,300	528.00	59,294,400	貸付有価証券 6,900株
6622	ダイヘン	37,200	8,270.00	307,644,000	
6630	ヤーマン	76,200	833.00	63,474,600	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	309,500	926.00	286,597,000	
6638	ミマキエンジニアリング	37,200	1,879.00	69,898,800	

6640	I P E X	27,200	2,004.00	54,508,800	貸付有価証券 1,000株
6644	大崎電気工業	85,800	690.00	59,202,000	
6645	オムロン	299,400	5,621.00	1,682,927,400	
6651	日東工業	52,900	3,440.00	181,976,000	
6652	I D E C	57,900	2,928.00	169,531,200	
6653	正興電機製作所	4,200	1,465.00	6,153,000	
6654	不二電機工業	2,400	1,142.00	2,740,800	貸付有価証券 700株
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	153,000	3,303.00	505,359,000	
6675	サクサホールディングス	2,800	2,720.00	7,616,000	
6676	メルコホールディングス	12,300	3,515.00	43,234,500	
6678	テクノメディア	9,500	1,810.00	17,195,000	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	14,600	714.00	10,424,400	貸付有価証券 1,300株
6701	日本電気	515,000	13,005.00	6,697,575,000	
6702	富士通	3,608,400	2,426.50	8,755,782,600	
6703	沖電気工業	177,300	1,034.00	183,328,200	
6704	岩崎通信機	5,500	1,480.00	8,140,000	貸付有価証券 400株
6706	電気興業	15,800	2,120.00	33,496,000	貸付有価証券 300株
6707	サンケン電気	36,400	7,026.00	255,746,400	
6715	ナカヨ	1,900	1,185.00	2,251,500	
6718	アイホン	21,200	3,050.00	64,660,000	貸付有価証券 500株
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,444,300	2,978.00	7,279,125,400	貸付有価証券 89,900株
6724	セイコーエプソン	503,100	2,490.50	1,252,970,550	
6727	ワコム	286,900	727.00	208,576,300	貸付有価証券 2,300株
6728	アルバック	86,000	10,495.00	902,570,000	
6730	アクセル	17,600	1,488.00	26,188,800	
6737	E I Z O	28,700	4,925.00	141,347,500	
6740	ジャパンディスプレイ	1,690,200	16.00	27,043,200	貸付有価証券 126,800株
6741	日本信号	89,300	1,034.00	92,336,200	
6742	京三製作所	82,100	692.00	56,813,200	
6744	能美防災	53,000	2,370.00	125,610,000	
6745	ホーチキ	29,300	2,310.00	67,683,000	
6748	星和電機	5,000	568.00	2,840,000	

6750	エレコム	93,700	1,653.00	154,886,100	
6752	パナソニック ホールディングス	4,632,300	1,323.00	6,128,532,900	貸付有価証券 162,800 株
6753	シャープ	661,000	979.10	647,185,100	貸付有価証券 50,900 株
6754	アンリツ	276,200	1,198.50	331,025,700	
6755	富士通ゼネラル	111,200	2,158.00	239,969,600	
6758	ソニーグループ	2,718,900	13,170.00	35,807,913,000	
6762	T D K	620,900	9,560.00	5,935,804,000	
6763	帝国通信工業	17,200	2,080.00	35,776,000	貸付有価証券 600 株
6768	タムラ製作所	156,200	712.00	111,214,400	貸付有価証券 14,900 株
6770	アルプスアルパイン	350,200	1,545.50	541,234,100	
6771	池上通信機	3,800	819.00	3,112,200	
6779	日本電波工業	47,000	1,348.00	63,356,000	
6785	鈴木	20,900	1,471.00	30,743,900	
6787	メイコー	38,900	7,010.00	272,689,000	
6788	日本トリム	8,800	3,480.00	30,624,000	
6789	ローランド ディー. ジー.	8,900	5,340.00	47,526,000	
6794	フォスター電機	29,000	1,782.00	51,678,000	
6798	S M K	10,500	2,607.00	27,373,500	貸付有価証券 400 株
6800	ヨコオ	34,600	2,119.00	73,317,400	
6803	ティアック	20,000	97.00	1,940,000	貸付有価証券 3,200 株
6804	ホシデン	89,200	2,140.00	190,888,000	貸付有価証券 3,900 株
6806	ヒロセ電機	57,900	17,770.00	1,028,883,000	
6807	日本航空電子工業	93,800	2,555.00	239,659,000	
6809	T O A	44,600	1,110.00	49,506,000	
6810	マクセル	86,600	1,823.00	157,871,800	
6814	古野電気	50,900	2,076.00	105,668,400	貸付有価証券 1,300 株
6817	スミダコーポレーション	52,500	1,170.00	61,425,000	
6820	アイコム	15,100	3,145.00	47,489,500	
6823	リオン	16,100	2,727.00	43,904,700	
6841	横河電機	429,000	3,839.00	1,646,931,000	
6844	新電元工業	15,000	2,974.00	44,610,000	
6845	アズビル	267,100	4,398.00	1,174,705,800	

6848	東亜ディーケーケー	5,600	852.00	4,771,200	貸付有価証券 2,200株
6849	日本光電工業	166,500	4,708.00	783,882,000	
6850	チノー	16,100	2,598.00	41,827,800	
6853	共和電業	11,200	453.00	5,073,600	貸付有価証券 1,200株
6855	日本電子材料	23,900	3,455.00	82,574,500	
6856	堀場製作所	74,100	12,035.00	891,793,500	
6857	アドバンテスト	1,112,400	5,814.00	6,467,493,600	
6858	小野測器	4,700	701.00	3,294,700	貸付有価証券 300株
6859	エスベック	31,100	3,200.00	99,520,000	
6861	キーエンス	388,400	70,570.00	27,409,388,000	
6866	日置電機	18,300	6,760.00	123,708,000	貸付有価証券 100株
6869	シスメックス	1,005,200	2,556.50	2,569,793,800	貸付有価証券 31,300株
6871	日本マイクロニクス	69,700	6,550.00	456,535,000	
6875	メガチップス	30,700	4,175.00	128,172,500	
6877	OBARA GROUP	24,200	4,170.00	100,914,000	
6901	澤藤電機	1,400	1,249.00	1,748,600	貸付有価証券 100株
6904	原田工業	5,400	580.00	3,132,000	貸付有価証券 2,100株
6905	コーセル	41,500	1,271.00	52,746,500	貸付有価証券 700株
6908	イリソ電子工業	35,700	3,090.00	110,313,000	
6914	オプテックスグループ	71,200	1,676.00	119,331,200	
6915	千代田インテグレ	15,200	3,150.00	47,880,000	
6920	レーザーテック	178,000	35,260.00	6,276,280,000	
6923	スタンレー電気	248,600	2,889.00	718,205,400	貸付有価証券 3,000株
6925	ウシオ電機	171,700	2,079.00	356,964,300	貸付有価証券 1,800株
6926	岡谷電機産業	9,200	249.00	2,290,800	貸付有価証券 3,500株
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	860.00	10,148,000	貸付有価証券 6,500株
6928	エノモト	3,400	1,544.00	5,249,600	
6929	日本セラミック	31,600	2,589.00	81,812,400	
6932	遠藤照明	5,400	1,546.00	8,348,400	
6937	古河電池	28,600	1,335.00	38,181,000	

6941	山一電機	34,900	3,200.00	111,680,000	
6947	図研	32,300	4,135.00	133,560,500	
6951	日本電子	97,300	6,760.00	657,748,000	
6952	カシオ計算機	280,500	1,211.50	339,825,750	貸付有価証券 2,300株
6954	ファナック	1,893,300	4,323.00	8,184,735,900	
6958	日本シイエムケイ	91,000	609.00	55,419,000	
6961	エンプラス	11,300	7,950.00	89,835,000	貸付有価証券 1,100株
6962	大真空	57,800	733.00	42,367,400	貸付有価証券 1,700株
6963	ローム	717,800	2,176.00	1,561,932,800	
6965	浜松ホトニクス	311,600	4,495.00	1,400,642,000	貸付有価証券 1,000株
6966	三井ハイテック	34,400	6,324.00	217,545,600	
6967	新光電気工業	137,400	5,645.00	775,623,000	
6971	京セラ	2,412,400	1,877.50	4,529,281,000	
6976	太陽誘電	189,100	3,966.00	749,970,600	
6981	村田製作所	3,532,400	3,300.00	11,656,920,000	
6986	双葉電子工業	73,900	653.00	48,256,700	
6989	北陸電気工業	4,500	1,433.00	6,448,500	
6996	ニチコン	101,900	1,205.00	122,789,500	
6997	日本ケミコン	41,300	1,680.00	69,384,000	貸付有価証券 200株
6999	K O A	58,800	1,514.00	89,023,200	貸付有価証券 1,200株
7244	市光工業	69,900	556.00	38,864,400	
7276	小糸製作所	402,200	2,187.50	879,812,500	貸付有価証券 14,000株
7280	ミツバ	72,800	1,125.00	81,900,000	
7735	S C R E E Nホールディングス	132,700	14,960.00	1,985,192,000	
7739	キヤノン電子	42,900	2,286.00	98,069,400	
7751	キヤノン	1,936,500	4,435.00	8,588,377,500	
7752	リコー	973,500	1,350.00	1,314,225,000	
7965	象印マホービン	105,400	1,535.00	161,789,000	
7999	M U T O Hホールディングス	1,500	2,432.00	3,648,000	
8035	東京エレクトロン	821,700	34,400.00	28,266,480,000	
9880	イノテック	25,900	1,753.00	45,402,700	
3116	トヨタ紡織	163,500	2,153.50	352,097,250	
3526	芦森工業	2,400	2,417.00	5,800,800	貸付有価証券

					200 株
5949	ユニプレス	69,700	1,362.00	94,931,400	貸付有価証券 5,500 株
6201	豊田自動織機	331,200	13,630.00	4,514,256,000	
6455	モリタホールディングス	68,100	1,817.00	123,737,700	
6584	三櫻工業	59,300	1,016.00	60,248,800	貸付有価証券 2,100 株
6902	デンソー	3,203,200	2,482.50	7,951,944,000	
6995	東海理化電機製作所	109,500	2,172.00	237,834,000	
7012	川崎重工業	316,900	6,032.00	1,911,540,800	貸付有価証券 1,600 株
7014	名村造船所	108,700	2,297.00	249,683,900	貸付有価証券 14,200 株
7102	日本車輛製造	12,800	2,474.00	31,667,200	
7105	三菱ロジスネクスト	62,000	1,476.00	91,512,000	
7122	近畿車輛	1,600	1,979.00	3,166,400	
7201	日産自動車	5,108,500	547.50	2,796,903,750	
7202	いすゞ自動車	1,090,200	2,096.00	2,285,059,200	
7203	トヨタ自動車	21,318,900	3,296.00	70,267,094,400	
7205	日野自動車	584,000	441.70	257,952,800	
7211	三菱自動車工業	1,514,600	459.60	696,110,160	貸付有価証券 53,200 株
7212	エフテック	8,400	629.00	5,283,600	
7213	レシップホールディングス	5,200	662.00	3,442,400	貸付有価証券 1,600 株
7214	GMB	2,300	1,604.00	3,689,200	貸付有価証券 1,000 株
7215	ファルテック	2,200	548.00	1,205,600	貸付有価証券 300 株
7220	武蔵精密工業	94,900	1,929.00	183,062,100	
7222	日産車体	39,300	982.00	38,592,600	貸付有価証券 3,800 株
7224	新明和工業	111,800	1,419.00	158,644,200	
7226	極東開発工業	64,100	2,497.00	160,057,700	
7231	トピー工業	31,500	2,499.00	78,718,500	
7236	ティラド	8,600	3,655.00	31,433,000	
7238	曙ブレーキ工業	236,900	164.00	38,851,600	貸付有価証券 8,400 株
7239	タチエス	71,600	1,950.00	139,620,000	貸付有価証券 4,100 株
7240	NOK	150,800	2,145.50	323,541,400	
7241	フタバ産業	104,000	886.00	92,144,000	

7242	カヤバ	36,600	5,370.00	196,542,000	
7245	大同メタル工業	75,900	642.00	48,727,800	
7246	プレス工業	155,100	646.00	100,194,600	
7247	ミクニ	15,200	407.00	6,186,400	貸付有価証券 1,100株
7250	太平洋工業	89,000	1,522.00	135,458,000	
7256	河西工業	16,900	196.00	3,312,400	貸付有価証券 6,000株
7259	アイシン	299,500	5,273.00	1,579,263,500	
7261	マツダ	1,284,200	1,578.50	2,027,109,700	貸付有価証券 500株
7266	今仙電機製作所	7,600	616.00	4,681,600	
7267	本田技研工業	9,199,200	1,730.00	15,914,616,000	
7269	スズキ	2,852,400	1,823.00	5,199,925,200	貸付有価証券 100,400株
7270	S U B A R U	1,204,000	3,448.00	4,151,392,000	
7271	安永	5,300	588.00	3,116,400	
7272	ヤマハ発動機	1,678,000	1,512.50	2,537,975,000	
7277	T B K	13,000	304.00	3,952,000	
7278	エクセディ	63,500	3,050.00	193,675,000	
7282	豊田合成	111,200	2,859.00	317,920,800	貸付有価証券 300株
7283	愛三工業	64,400	1,383.00	89,065,200	
7284	盟和産業	1,700	1,025.00	1,742,500	
7291	日本プラス	9,800	436.00	4,272,800	
7294	ヨロズ	36,400	1,168.00	42,515,200	
7296	エフ・シー・シー	68,800	2,353.00	161,886,400	
7309	シマノ	156,500	24,990.00	3,910,935,000	
7313	テイ・エス テック	138,200	1,923.00	265,758,600	
7408	ジャムコ	21,100	1,493.00	31,502,300	貸付有価証券 2,200株
4543	テルモ	2,164,300	2,599.50	5,626,097,850	
5187	クリエートメディック	3,900	990.00	3,861,000	
6376	日機装	90,400	1,161.00	104,954,400	
7600	日本エム・ディ・エム	30,800	677.00	20,851,600	
7701	島津製作所	515,800	4,020.00	2,073,516,000	貸付有価証券 15,900株
7702	J M S	35,900	540.00	19,386,000	
7709	クボテック	2,900	216.00	626,400	貸付有価証券 1,100株

7715	長野計器	28,200	2,976.00	83,923,200	貸付有価証券 900株
7717	ブイ・テクノロジー	20,400	3,095.00	63,138,000	貸付有価証券 600株
7721	東京計器	29,800	3,290.00	98,042,000	
7723	愛知時計電機	16,800	2,320.00	38,976,000	
7725	インターアクション	23,400	1,657.00	38,773,800	
7727	オーバル	10,600	465.00	4,929,000	
7729	東京精密	79,500	12,425.00	987,787,500	貸付有価証券 500株
7730	マニー	155,300	1,912.50	297,011,250	
7731	ニコン	561,300	1,615.00	906,499,500	貸付有価証券 900株
7732	トプコン	188,700	1,772.00	334,376,400	
7733	オリンパス	2,222,900	2,579.00	5,732,859,100	
7734	理研計器	55,000	3,920.00	215,600,000	
7740	タムロン	23,800	8,400.00	199,920,000	
7741	HOYA	764,300	18,805.00	14,372,661,500	
7743	シード	6,000	560.00	3,360,000	貸付有価証券 300株
7744	ノーリツ鋼機	36,800	4,355.00	160,264,000	
7745	A&Dホロンホールディングス	56,600	2,787.00	157,744,200	
7747	朝日インテック	473,300	2,217.00	1,049,306,100	
7762	シチズン時計	357,200	1,034.00	369,344,800	
7769	リズム	2,700	3,900.00	10,530,000	
7775	大研医器	10,400	549.00	5,709,600	貸付有価証券 3,100株
7780	メニコン	133,500	1,327.50	177,221,250	
7782	シンシア	1,100	455.00	500,500	
7979	松風	17,500	4,635.00	81,112,500	貸付有価証券 700株
8050	セイコーグループ	54,100	4,820.00	260,762,000	
8086	ニプロ	323,600	1,264.00	409,030,400	
7795	KYORITSU	18,000	169.00	3,042,000	
7811	中本パックス	3,800	1,649.00	6,266,200	貸付有価証券 1,100株
7817	パラマウントベッドホールディングス	80,700	2,770.00	223,539,000	
7818	トランザクション	25,600	1,974.00	50,534,400	貸付有価証券 800株
7819	粧美堂	3,300	555.00	1,831,500	
7820	ニホンフラッシュ	36,400	918.00	33,415,200	

7821	前田工織	34,600	3,310.00	114,526,000	
7822	永大産業	14,300	248.00	3,546,400	
7823	アートネイチャー	35,000	847.00	29,645,000	
7826	フルヤ金属	12,300	12,890.00	158,547,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	1,063,700	3,084.00	3,280,450,800	
7833	アイフィスジャパン	3,400	617.00	2,097,800	
7839	SHOEI	109,200	2,029.00	221,566,800	
7840	フランスベッドホールディングス	50,200	1,223.00	61,394,600	
7846	パイロットコーポレーション	54,600	4,253.00	232,213,800	
7856	萩原工業	26,000	1,558.00	40,508,000	貸付有価証券 1,700株
7864	フジシールインターナショナル	78,600	2,490.00	195,714,000	
7867	タカラトミー	176,700	3,106.00	548,830,200	貸付有価証券 400株
7868	広済堂ホールディングス	112,900	595.00	67,175,500	
7872	エステールホールディングス	2,900	655.00	1,899,500	
7885	タカノ	4,500	913.00	4,108,500	
7893	プロネクサス	40,200	1,312.00	52,742,400	
7897	ホクシン	9,300	120.00	1,116,000	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	4,100	947.00	3,882,700	貸付有価証券 1,700株
7911	TOPPANホールディングス	477,200	4,360.00	2,080,592,000	
7912	大日本印刷	402,500	5,273.00	2,122,382,500	貸付有価証券 13,100株
7914	共同印刷	10,900	3,930.00	42,837,000	
7915	NISSHA	66,500	2,045.00	135,992,500	
7916	光村印刷	900	1,609.00	1,448,100	貸付有価証券 400株
7921	TAKARA & COMPANY	22,900	3,135.00	71,791,500	
7936	アシックス	330,800	9,747.00	3,224,307,600	
7937	ツツミ	9,100	2,187.00	19,901,700	
7944	ローランド	28,600	4,175.00	119,405,000	
7949	小松ウオール工業	15,800	3,295.00	52,061,000	
7951	ヤマハ	244,700	3,735.00	913,954,500	
7952	河合楽器製作所	11,800	3,245.00	38,291,000	
7955	クリナップ	38,100	729.00	27,774,900	
7956	ビジョン	247,300	1,546.00	382,325,800	
7962	キングジム	34,300	878.00	30,115,400	貸付有価証券 1,500株

7966	リンテック	77,900	3,325.00	259,017,500	
7972	イトーキ	74,000	1,665.00	123,210,000	
7974	任天堂	2,451,200	8,632.00	21,158,758,400	
7976	三菱鉛筆	55,100	2,468.00	135,986,800	
7981	タカラスタンダード	79,400	1,715.00	136,171,000	
7984	コクヨ	158,800	2,706.50	429,792,200	
7987	ナカバヤシ	41,800	548.00	22,906,400	
7990	グローブライド	34,800	2,182.00	75,933,600	貸付有価証券 1,200株
7994	オカムラ	116,900	2,187.00	255,660,300	
8022	美津濃	38,600	8,070.00	311,502,000	
9501	東京電力ホールディングス	3,499,800	863.80	3,023,127,240	
9502	中部電力	1,430,700	1,913.00	2,736,929,100	
9503	関西電力	1,499,200	2,700.00	4,047,840,000	
9504	中国電力	674,500	1,084.00	731,158,000	
9505	北陸電力	397,000	1,029.00	408,513,000	貸付有価証券 100株
9506	東北電力	1,022,200	1,441.00	1,472,990,200	貸付有価証券 1,100株
9507	四国電力	361,600	1,384.00	500,454,400	貸付有価証券 800株
9508	九州電力	895,000	1,660.00	1,485,700,000	貸付有価証券 6,400株
9509	北海道電力	375,100	1,267.00	475,251,700	貸付有価証券 6,500株
9511	沖縄電力	99,200	1,115.00	110,608,000	
9513	電源開発	318,900	2,516.50	802,511,850	
9514	エフオン	28,300	419.00	11,857,700	
9517	イーレックス	69,100	713.00	49,268,300	
9519	レノバ	103,600	1,021.00	105,775,600	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	755,800	3,516.00	2,657,392,800	貸付有価証券 21,400株
9532	大阪瓦斯	773,700	3,500.00	2,707,950,000	貸付有価証券 18,100株
9533	東邦瓦斯	168,100	3,948.00	663,658,800	
9534	北海道瓦斯	23,200	3,515.00	81,548,000	
9535	広島ガス	82,000	393.00	32,226,000	
9536	西部ガスホールディングス	40,500	2,015.00	81,607,500	
9543	静岡ガス	77,400	960.00	74,304,000	
9551	メタウォーター	46,500	1,950.00	90,675,000	

2384	S B S ホールディングス	34,600	2,689.00	93,039,400	
9001	東武鉄道	426,500	2,711.00	1,156,241,500	貸付有価証券 400 株
9003	相鉄ホールディングス	138,900	2,444.00	339,471,600	
9005	東急	1,088,700	1,795.50	1,954,760,850	貸付有価証券 10,900 株
9006	京浜急行電鉄	480,500	1,170.00	562,185,000	貸付有価証券 2,600 株
9007	小田急電鉄	642,000	1,558.00	1,000,236,000	貸付有価証券 900 株
9008	京王電鉄	186,600	3,690.00	688,554,000	
9009	京成電鉄	250,300	5,248.00	1,313,574,400	
9010	富士急行	47,800	3,100.00	148,180,000	
9020	東日本旅客鉄道	2,139,800	2,652.00	5,674,749,600	貸付有価証券 69,600 株
9021	西日本旅客鉄道	921,100	2,954.50	2,721,389,950	貸付有価証券 34,800 株
9022	東海旅客鉄道	1,495,500	3,431.00	5,131,060,500	貸付有価証券 53,000 株
9024	西武ホールディングス	469,600	2,209.00	1,037,346,400	
9025	鴻池運輸	66,200	2,413.00	159,740,600	貸付有価証券 300 株
9031	西日本鉄道	103,700	2,537.00	263,086,900	貸付有価証券 3,700 株
9037	ハマキョウレックス	33,100	4,355.00	144,150,500	
9039	サカイ引越センター	43,000	2,592.00	111,456,000	
9041	近鉄グループホールディングス	387,600	3,455.00	1,339,158,000	貸付有価証券 12,600 株
9042	阪急阪神ホールディングス	516,900	4,209.00	2,175,632,100	
9044	南海電気鉄道	172,900	2,665.00	460,778,500	
9045	京阪ホールディングス	213,600	2,882.50	615,702,000	
9046	神戸電鉄	10,500	2,746.00	28,833,000	
9048	名古屋鉄道	399,800	1,745.50	697,850,900	
9052	山陽電気鉄道	29,200	2,099.00	61,290,800	貸付有価証券 1,100 株
9055	アルプス物流	30,900	5,720.00	176,748,000	
9064	ヤマトホールディングス	471,100	1,788.50	842,562,350	
9065	山九	93,500	5,468.00	511,258,000	
9067	丸運	6,200	372.00	2,306,400	貸付有価証券 2,400 株
9068	丸全昭和運輸	23,900	5,330.00	127,387,000	
9069	センコーグループホールディングス	205,200	1,137.00	233,312,400	貸付有価証券 7,300 株

9070	トナミホールディングス	8,500	6,290.00	53,465,000	
9072	ニッコンホールディングス	119,400	3,538.00	422,437,200	貸付有価証券 4,400 株
9074	日本石油輸送	1,200	3,020.00	3,624,000	
9075	福山通運	44,200	3,845.00	169,949,000	
9076	セイノーホールディングス	218,000	2,137.50	465,975,000	貸付有価証券 7,700 株
9078	エスライングループ本社	3,400	1,656.00	5,630,400	
9081	神奈川中央交通	11,000	3,095.00	34,045,000	
9090	A Z - C O M 丸和ホールディングス	99,100	1,220.00	120,902,000	
9099	C & F ロジホールディングス	37,300	5,730.00	213,729,000	
9142	九州旅客鉄道	274,100	3,468.00	950,578,800	
9143	S G ホールディングス	650,900	1,493.00	971,793,700	
9147	N I P P O N E X P R E S S ホール ディン	131,500	7,579.00	996,638,500	
9101	日本郵船	1,004,000	4,649.00	4,667,596,000	貸付有価証券 36,500 株
9104	商船三井	841,800	4,868.00	4,097,882,400	貸付有価証券 24,100 株
9107	川崎汽船	933,900	2,289.00	2,137,697,100	貸付有価証券 23,700 株
9110	N S ユナイテッド海運	20,900	4,965.00	103,768,500	
9115	明海グループ	13,000	713.00	9,269,000	
9119	飯野海運	142,300	1,278.00	181,859,400	
9130	共栄タンカー	2,200	1,309.00	2,879,800	貸付有価証券 1,600 株
9308	乾汽船	45,400	1,181.00	53,617,400	貸付有価証券 2,500 株
9201	日本航空	952,000	2,575.00	2,451,400,000	
9202	A N A ホールディングス	1,054,700	2,975.50	3,138,259,850	貸付有価証券 37,100 株
9232	パスコ	2,200	1,786.00	3,929,200	
9058	トランコム	11,200	6,500.00	72,800,000	
9066	日新	29,400	4,700.00	138,180,000	
9301	三菱倉庫	92,400	5,375.00	496,650,000	貸付有価証券 300 株
9302	三井倉庫ホールディングス	36,200	4,760.00	172,312,000	
9303	住友倉庫	103,600	2,590.00	268,324,000	
9304	澁澤倉庫	17,700	3,150.00	55,755,000	
9306	東陽倉庫	3,200	1,531.00	4,899,200	貸付有価証券 100 株
9310	日本トランスシティ	78,000	1,067.00	83,226,000	

9312	ケイヒン	2,200	2,303.00	5,066,600	
9319	中央倉庫	20,800	1,285.00	26,728,000	
9322	川西倉庫	2,200	1,193.00	2,624,600	
9324	安田倉庫	26,400	1,618.00	42,715,200	
9325	ファイズホールディングス	1,700	1,135.00	1,929,500	
9351	東洋埠頭	3,500	1,380.00	4,830,000	
9364	上組	179,000	3,272.00	585,688,000	
9366	サンリツ	2,900	897.00	2,601,300	
9368	キムラユニティー	5,700	1,714.00	9,769,800	
9369	キューソー流通システム	19,900	1,666.00	33,153,400	
9380	東海運	7,000	296.00	2,072,000	貸付有価証券 4,400株
9381	エーアイティー	24,300	1,876.00	45,586,800	貸付有価証券 900株
9384	内外トランスライン	15,500	2,879.00	44,624,500	
9386	日本コンセプト	14,100	1,834.00	25,859,400	
1973	N E C ネットスエスアイ	151,800	2,370.00	359,766,000	貸付有価証券 1,400株
2307	クロスキャット	24,700	1,429.00	35,296,300	
2317	システナ	589,200	309.00	182,062,800	
2326	デジタルアーツ	24,600	4,255.00	104,673,000	
2327	日鉄ソリューションズ	66,400	5,360.00	355,904,000	
2335	キューブシステム	20,600	1,195.00	24,617,000	
2359	コア	17,200	1,973.00	33,935,600	
2477	手間いらず	6,600	3,170.00	20,922,000	貸付有価証券 100株
3031	ラクーンホールディングス	29,100	563.00	16,383,300	
3040	ソリトンシステムズ	20,100	1,238.00	24,883,800	
3371	ソフトクリエイイトホールディングス	32,000	1,990.00	63,680,000	
3626	T I S	411,600	3,088.00	1,271,020,800	
3627	テクミラホールディングス	5,500	396.00	2,178,000	貸付有価証券 2,400株
3632	グリー	130,500	538.00	70,209,000	貸付有価証券 2,400株
3633	GMOペパボ	4,800	1,510.00	7,248,000	貸付有価証券 500株
3635	コーエーテクモホールディングス	244,000	1,405.00	342,820,000	
3636	三菱総合研究所	19,100	4,920.00	93,972,000	
3639	ボルテージ	3,500	267.00	934,500	貸付有価証券 1,300株

3640	電算	1,400	1,495.00	2,093,000	貸付有価証券 500株
3648	A G S	5,000	1,080.00	5,400,000	貸付有価証券 2,400株
3649	ファインデックス	30,900	1,009.00	31,178,100	
3655	ブレインパッド	32,400	1,073.00	34,765,200	貸付有価証券 1,000株
3656	K L a b	71,600	233.00	16,682,800	貸付有価証券 8,400株
3657	ポールトゥウィンホールディングス	66,500	503.00	33,449,500	貸付有価証券 2,300株
3659	ネクソン	854,300	2,951.00	2,521,039,300	
3660	アイスタイル	130,100	492.00	64,009,200	貸付有価証券 11,100株
3661	エムアップホールディングス	47,700	1,425.00	67,972,500	貸付有価証券 100株
3662	エイチーム	25,900	743.00	19,243,700	
3665	エニグモ	49,500	332.00	16,434,000	貸付有価証券 5,500株
3666	テクノスジャパン	10,500	698.00	7,329,000	貸付有価証券 700株
3667	e n i s h	9,500	301.00	2,859,500	貸付有価証券 1,900株
3668	コロブラ	132,300	635.00	84,010,500	貸付有価証券 3,900株
3672	オルトプラス	9,700	131.00	1,270,700	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	184,800	567.00	104,781,600	
3675	クロス・マーケティンググループ	5,100	600.00	3,060,000	貸付有価証券 900株
3676	デジタルハーツホールディングス	24,300	1,055.00	25,636,500	貸付有価証券 100株
3678	メディアドゥ	17,600	1,504.00	26,470,400	
3679	じげん	113,500	599.00	67,986,500	
3681	ブイキューブ	46,700	252.00	11,768,400	貸付有価証券 2,700株
3682	エンカレッジ・テクノロジー	2,900	656.00	1,902,400	
3683	サイバーリンクス	4,100	817.00	3,349,700	
3686	ディー・エル・イー	8,600	166.00	1,427,600	貸付有価証券 3,000株
3687	フィックスターズ	39,100	1,936.00	75,697,600	
3688	C A R T A H O L D I N G S	18,400	1,636.00	30,102,400	貸付有価証券 2,100株
3694	オプティム	40,100	681.00	27,308,100	貸付有価証券 1,100株
3696	セレス	15,800	1,650.00	26,070,000	

3697	S H I F T	25,900	14,260.00	369,334,000	
3738	ティーガイア	40,700	2,865.00	116,605,500	
3741	セック	5,400	4,395.00	23,733,000	
3762	テクマトリックス	71,100	1,948.00	138,502,800	
3763	プロシップ	18,700	1,363.00	25,488,100	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	101,300	2,732.00	276,751,600	貸付有価証券 200株
3769	GMOペイメントゲートウェイ	88,900	8,645.00	768,540,500	
3770	ザッパラス	2,900	444.00	1,287,600	貸付有価証券 1,800株
3771	システムリサーチ	26,700	1,660.00	44,322,000	
3774	インターネットイニシアティブ	186,200	2,331.50	434,125,300	
3778	さくらインターネット	48,700	4,200.00	204,540,000	貸付有価証券 6,700株
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	11,900	3,060.00	36,414,000	貸付有価証券 400株
3817	S R Aホールディングス	19,900	4,265.00	84,873,500	
3826	システムインテグレータ	3,500	370.00	1,295,000	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	41,800	672.00	28,089,600	貸付有価証券 200株
3835	e B A S E	54,800	715.00	39,182,000	貸付有価証券 5,200株
3836	アバントグループ	49,200	1,367.00	67,256,400	
3837	アドソル日進	16,400	1,900.00	31,160,000	
3839	ODKソリューションズ	2,200	578.00	1,271,600	
3843	フリービット	17,000	1,281.00	21,777,000	貸付有価証券 2,600株
3844	コムチュア	56,200	1,783.00	100,204,600	
3853	アステリア	30,500	566.00	17,263,000	貸付有価証券 2,600株
3854	アイル	21,800	2,441.00	53,213,800	貸付有価証券 1,100株
3901	マークライnz	21,100	3,055.00	64,460,500	貸付有価証券 100株
3902	メディカル・データ・ビジョン	46,500	581.00	27,016,500	貸付有価証券 900株
3903	g u m i	63,200	334.00	21,108,800	貸付有価証券 9,600株
3909	ショーケース	2,800	311.00	870,800	貸付有価証券 1,000株
3912	モバイルファクトリー	2,600	650.00	1,690,000	貸付有価証券 1,100株
3915	テラスカイ	16,900	2,011.00	33,985,900	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	20,300	1,900.00	38,570,000	
3918	P C I ホールディングス	4,600	972.00	4,471,200	
3920	アイビーシー	1,800	467.00	840,600	
3921	ネオジャパン	13,000	1,689.00	21,957,000	
3922	P R T I M E S	7,800	1,878.00	14,648,400	
3923	ラクス	184,200	2,057.50	378,991,500	
3924	ランドコンピュータ	5,800	822.00	4,767,600	
3925	ダブルスタンダード	11,800	1,718.00	20,272,400	
3926	オープンドア	22,700	647.00	14,686,900	貸付有価証券 3,100 株
3928	マイネット	3,900	344.00	1,341,600	貸付有価証券 1,400 株
3932	アカツキ	19,000	2,441.00	46,379,000	
3934	ベネフィットジャパン	700	1,280.00	896,000	貸付有価証券 300 株
3937	U b i c o mホールディングス	12,200	1,286.00	15,689,200	
3939	カナミックネットワーク	48,900	559.00	27,335,100	
3940	ノムラシステムコーポレーション	11,800	132.00	1,557,600	貸付有価証券 4,000 株
3962	チェンジホールディングス	84,800	1,228.00	104,134,400	貸付有価証券 5,400 株
3963	シンクロ・フード	6,800	524.00	3,563,200	貸付有価証券 300 株
3964	オークネット	14,400	2,740.00	39,456,000	
3965	キャピタル・アセット・プランニング	2,200	864.00	1,900,800	貸付有価証券 1,200 株
3968	セグエグループ	10,300	597.00	6,149,100	貸付有価証券 1,800 株
3969	エイトレッド	1,800	1,628.00	2,930,400	貸付有価証券 100 株
3978	マクロミル	76,400	866.00	66,162,400	
3981	ビーグリー	2,200	1,096.00	2,411,200	貸付有価証券 300 株
3983	オロ	14,100	2,609.00	36,786,900	
3984	ユーザーローカル	16,400	2,018.00	33,095,200	
3985	テモナ	2,400	213.00	511,200	貸付有価証券 600 株
3992	ニーズウェル	13,200	391.00	5,161,200	貸付有価証券 2,000 株
3994	マネーフォワード	87,100	5,254.00	457,623,400	
3996	サインポスト	4,300	691.00	2,971,300	貸付有価証券 700 株
4053	S u n A s t e r i s k	27,600	865.00	23,874,000	貸付有価証券

					1,200株
4071	プラスアルファ・コンサルティング	49,100	1,913.00	93,928,300	貸付有価証券 600株
4072	電算システムホールディングス	17,200	2,714.00	46,680,800	貸付有価証券 600株
4180	A p p i e r G r o u p	133,300	1,211.00	161,426,300	貸付有価証券 1,500株
4194	ビジョナル	45,600	7,100.00	323,760,000	
4284	ソルクシーズ	9,800	322.00	3,155,600	貸付有価証券 3,800株
4295	フェイス	3,400	454.00	1,543,600	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	42,600	1,483.00	63,175,800	
4299	ハイマックス	12,200	1,400.00	17,080,000	
4307	野村総合研究所	843,300	4,524.00	3,815,089,200	
4320	C E ホールディングス	5,900	585.00	3,451,500	
4323	日本システム技術	32,500	1,696.00	55,120,000	
4326	インテージホールディングス	44,000	1,510.00	66,440,000	
4333	東邦システムサイエンス	16,300	1,594.00	25,982,200	貸付有価証券 400株
4344	ソースネクスト	178,200	209.00	37,243,800	貸付有価証券 27,300株
4348	インフォコム	50,200	6,050.00	303,710,000	
4373	シンプレクス・ホールディングス	59,200	2,830.00	167,536,000	
4382	H E R O Z	15,300	1,223.00	18,711,900	貸付有価証券 1,100株
4384	ラクスル	94,000	958.00	90,052,000	貸付有価証券 9,600株
4385	メルカリ	189,900	1,967.00	373,533,300	貸付有価証券 8,300株
4390	I P S	11,200	2,101.00	23,531,200	貸付有価証券 200株
4392	F I G	14,000	356.00	4,984,000	貸付有価証券 900株
4396	システムサポート	15,100	1,853.00	27,980,300	
4420	イーソル	28,000	962.00	26,936,000	
4430	東海ソフト	1,800	1,298.00	2,336,400	
4432	ウイングアーク 1 s t	40,500	2,719.00	110,119,500	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホール ディン	13,000	951.00	12,363,000	貸付有価証券 800株
4434	サーバーワークス	8,000	3,190.00	25,520,000	貸付有価証券 500株
4439	東名	1,000	2,493.00	2,493,000	貸付有価証券 500株

4440	ヴィッツ	1,100	815.00	896,500	貸付有価証券 400株
4441	トビラシシステムズ	3,100	803.00	2,489,300	貸付有価証券 1,300株
4443	S a n s a n	127,900	1,741.00	222,673,900	貸付有価証券 4,500株
4446	L i n k－Uグループ	2,400	590.00	1,416,000	貸付有価証券 1,100株
4449	ギフティ	34,100	1,105.00	37,680,500	貸付有価証券 4,000株
4480	メドレー	52,300	3,590.00	187,757,000	貸付有価証券 1,800株
4481	ベース	13,600	2,861.00	38,909,600	
4483	J M D C	66,400	3,357.00	222,904,800	
4662	フォーカスシステムズ	26,000	1,245.00	32,370,000	
4674	クレスコ	31,900	2,574.00	82,110,600	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	374,000	1,846.00	690,404,000	
4684	オービック	130,100	20,625.00	2,683,312,500	貸付有価証券 2,100株
4686	ジャストシステム	55,900	2,948.00	164,793,200	
4687	T D C ソフト	72,900	1,218.00	88,792,200	
4689	L I N E ヤフー	5,544,200	391.30	2,169,445,460	
4704	トレンドマイクロ	184,100	6,440.00	1,185,604,000	
4709	I D ホールディングス	26,200	1,474.00	38,618,800	
4716	日本オラクル	74,500	11,755.00	875,747,500	
4719	アルファシステムズ	10,200	3,145.00	32,079,000	
4722	フューチャー	83,000	1,524.00	126,492,000	
4725	C A C H o l d i n g s	20,900	1,960.00	40,964,000	
4726	S B テクノロジー	16,500	2,946.00	48,609,000	
4728	トーセ	3,400	693.00	2,356,200	貸付有価証券 700株
4733	オービックビジネスコンサルタント	54,700	6,590.00	360,473,000	
4743	アイティフォー	49,800	1,413.00	70,367,400	
4746	東計電算	10,900	3,885.00	42,346,500	
4762	エックスネット	1,600	1,483.00	2,372,800	貸付有価証券 100株
4768	大塚商会	386,200	3,039.00	1,173,661,800	
4776	サイボウズ	53,600	2,040.00	109,344,000	貸付有価証券 1,900株
4812	電通総研	47,300	5,220.00	246,906,000	貸付有価証券 100株
4813	A C C E S S	40,500	1,297.00	52,528,500	貸付有価証券

					4,100 株
4819	デジタルガレージ	62,200	2,453.00	152,576,600	
4820	EMシステムズ	64,900	621.00	40,302,900	
4825	ウェザーニューズ	12,000	4,665.00	55,980,000	貸付有価証券 500 株
4826	C I J	97,000	476.00	46,172,000	
4828	ビジネスエンジニアリング	8,200	3,655.00	29,971,000	
4829	日本エンタープライズ	12,500	139.00	1,737,500	
4839	WOWOW	29,300	1,118.00	32,757,400	
4845	スカラ	36,100	715.00	25,811,500	
4847	インテリジェント ウェイブ	6,400	1,096.00	7,014,400	
5032	ANYCOLOR	55,100	2,766.00	152,406,600	貸付有価証券 100 株
6879	I M A G I C A G R O U P	39,000	556.00	21,684,000	
7518	ネットワンシステムズ	151,600	2,911.00	441,307,600	貸付有価証券 300 株
7527	システムソフト	135,500	66.00	8,943,000	貸付有価証券 10,300 株
7595	アルゴグラフィックス	35,700	4,850.00	173,145,000	
7844	マーベラス	63,200	650.00	41,080,000	貸付有価証券 3,100 株
7860	エイベックス	66,300	1,324.00	87,781,200	
8056	B I P R O G Y	127,400	4,354.00	554,699,600	
8157	都築電気	20,500	2,396.00	49,118,000	
9401	T B S ホールディングス	195,800	4,060.00	794,948,000	
9404	日本テレビホールディングス	344,700	2,328.50	802,633,950	
9405	朝日放送グループホールディングス	36,400	681.00	24,788,400	
9409	テレビ朝日ホールディングス	94,500	2,164.00	204,498,000	貸付有価証券 1,400 株
9412	スカパー J S A T ホールディングス	302,400	859.00	259,761,600	
9413	テレビ東京ホールディングス	28,000	3,790.00	106,120,000	貸付有価証券 900 株
9414	日本BS放送	4,300	929.00	3,994,700	
9416	ビジョン	58,200	1,217.00	70,829,400	
9417	スマートバリュー	2,900	390.00	1,131,000	貸付有価証券 1,500 株
9418	U-NEXT HOLDINGS	43,600	4,475.00	195,110,000	
9419	ワイヤレスゲート	5,300	234.00	1,240,200	貸付有価証券 2,400 株
9424	日本通信	383,300	191.00	73,210,300	
9428	クロップス	1,600	1,146.00	1,833,600	

9432	日本電信電話	115,827,900	150.90	17,478,430,110	
9433	K D D I	3,009,000	4,260.00	12,818,340,000	
9434	ソフトバンク	6,217,300	1,980.00	12,310,254,000	貸付有価証券 173,000 株
9435	光通信	39,200	29,680.00	1,163,456,000	
9438	エムティーアイ	26,700	936.00	24,991,200	貸付有価証券 1,000 株
9449	GMOインターネットグループ	142,700	2,468.00	352,183,600	
9450	ファイバーゲート	20,900	1,136.00	23,742,400	
9466	アイドママーケティングコミュニケー ション	2,800	231.00	646,800	
9468	K A D O K A W A	205,900	2,846.50	586,094,350	
9470	学研ホールディングス	71,300	1,030.00	73,439,000	
9474	ゼンリン	66,600	956.00	63,669,600	
9475	昭文社ホールディングス	5,200	371.00	1,929,200	貸付有価証券 2,000 株
9479	インプレスホールディングス	11,100	164.00	1,820,400	
9600	アイネット	23,600	2,140.00	50,504,000	
9601	松竹	20,200	9,451.00	190,910,200	貸付有価証券 2,900 株
9602	東宝	216,600	4,647.00	1,006,540,200	
9605	東映	64,300	3,805.00	244,661,500	
9613	N T T データグループ	1,018,100	2,382.50	2,425,623,250	貸付有価証券 30,500 株
9629	ピー・シー・エー	22,400	2,468.00	55,283,200	
9658	ビジネスブレイン太田昭和	15,200	2,233.00	33,941,600	
9682	D T S	81,600	4,240.00	345,984,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディ ングス	177,900	4,803.00	854,453,700	
9692	シーイーシー	49,100	2,147.00	105,417,700	
9697	カプコン	696,500	3,029.00	2,109,698,500	貸付有価証券 17,300 株
9702	アイ・エス・ビー	19,900	1,426.00	28,377,400	
9717	ジャステック	23,900	1,934.00	46,222,600	
9719	S C S K	272,500	3,160.00	861,100,000	
9739	N S W	17,300	3,315.00	57,349,500	
9742	アイネス	30,300	1,835.00	55,600,500	
9746	T K C	69,500	3,385.00	235,257,500	
9749	富士ソフト	78,300	6,890.00	539,487,000	
9759	N S D	137,300	3,085.00	423,570,500	貸付有価証券 1,100 株

9766	コナミグループ	145,800	11,235.00	1,638,063,000	貸付有価証券 5,900株
9790	福井コンピュータホールディングス	24,000	2,567.00	61,608,000	
9889	J B C Cホールディングス	25,800	3,570.00	92,106,000	
9928	ミロク情報サービス	35,400	1,958.00	69,313,200	
9984	ソフトバンクグループ	1,920,900	9,938.00	19,089,904,200	
167A	リョーサン菱洋ホールディングス	77,200	2,999.00	231,522,800	
2676	高千穂交易	14,600	3,930.00	57,378,000	貸付有価証券 900株
2689	オルバヘルスケアホールディングス	1,900	2,147.00	4,079,300	貸付有価証券 500株
2692	伊藤忠食品	9,200	7,190.00	66,148,000	
2715	エレマテック	36,900	1,982.00	73,135,800	
2733	あらた	62,800	3,550.00	222,940,000	
2737	トーメンデバイス	5,900	7,670.00	45,253,000	
2760	東京エレクトロン デバイス	40,900	4,305.00	176,074,500	
2767	円谷フィールズホールディングス	70,500	1,641.00	115,690,500	貸付有価証券 6,800株
2768	双日	457,300	3,908.00	1,787,128,400	
2784	アルフレッサ ホールディングス	412,300	2,210.00	911,183,000	貸付有価証券 500株
2874	横浜冷凍	103,300	1,044.00	107,845,200	
3004	神栄	1,800	1,872.00	3,369,600	貸付有価証券 600株
3023	ラサ商事	18,800	1,785.00	33,558,000	
3036	アルコニックス	54,100	1,557.00	84,233,700	
3038	神戸物産	317,800	3,560.00	1,131,368,000	貸付有価証券 8,100株
3054	ハイパー	2,500	329.00	822,500	
3076	あい ホールディングス	65,700	2,432.00	159,782,400	
3079	ディーブイエックス	3,400	1,004.00	3,413,600	貸付有価証券 400株
3107	ダイワボウホールディングス	181,900	2,819.50	512,867,050	
3132	マクニカホールディングス	97,200	6,705.00	651,726,000	
3139	ラクト・ジャパン	16,000	2,823.00	45,168,000	
3150	グリムス	17,300	2,560.00	44,288,000	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	62,200	1,417.00	88,137,400	
3153	八洲電機	33,200	1,766.00	58,631,200	貸付有価証券 300株
3154	メディアスホールディングス	23,900	988.00	23,613,200	貸付有価証券

					2,500株
3156	レスター	34,900	3,200.00	111,680,000	
3157	ジオリーブグループ	2,600	1,194.00	3,104,400	貸付有価証券 1,000株
3160	大光	5,400	610.00	3,294,000	貸付有価証券 2,100株
3166	OCHIホールディングス	2,800	1,478.00	4,138,400	貸付有価証券 1,300株
3167	TOKAIホールディングス	223,100	974.00	217,299,400	
3168	黒谷	3,400	716.00	2,434,400	貸付有価証券 1,000株
3173	Cominix	2,300	909.00	2,090,700	
3176	三洋貿易	42,100	1,630.00	68,623,000	
3180	ビューティガレージ	13,000	1,580.00	20,540,000	
3183	ウイン・パートナーズ	26,600	1,218.00	32,398,800	
3321	ミタチ産業	3,200	1,123.00	3,593,600	
3360	シップヘルスケアホールディングス	147,600	2,311.50	341,177,400	
3388	明治電機工業	15,200	1,887.00	28,682,400	
3392	デリカフーズホールディングス	5,300	570.00	3,021,000	
3393	スターティアホールディングス	2,900	2,220.00	6,438,000	
3543	コメダホールディングス	100,700	2,745.00	276,421,500	貸付有価証券 800株
3559	ピーバンドットコム	1,500	375.00	562,500	貸付有価証券 200株
3565	アセンテック	15,700	565.00	8,870,500	
5009	富士興産	3,400	1,769.00	6,014,600	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	1,300	2,879.00	3,742,700	
7128	フルサト・マルカホールディングス	36,600	2,159.00	79,019,400	
7130	ヤマエグループホールディングス	36,200	2,495.00	90,319,000	貸付有価証券 3,200株
7414	小野建	41,100	1,677.00	68,924,700	
7417	南陽	5,200	1,134.00	5,896,800	
7420	佐島電機	25,800	2,011.00	51,883,800	
7427	エコートレーディング	2,400	1,382.00	3,316,800	貸付有価証券 1,000株
7433	伯東	23,500	5,100.00	119,850,000	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	31,600	1,418.00	44,808,800	
7442	中山福	6,700	377.00	2,525,900	
7447	ナガイレーベン	51,900	2,597.00	134,784,300	

7451	三菱食品	37,900	5,450.00	206,555,000	
7456	松田産業	31,300	2,905.00	90,926,500	
7458	第一興商	158,900	1,661.50	264,012,350	
7459	メディopalホールディングス	417,700	2,449.00	1,022,947,300	貸付有価証券 500株
7466	S P K	18,200	2,313.00	42,096,600	
7467	萩原電気ホールディングス	17,600	3,960.00	69,696,000	
7476	アズワン	127,400	2,834.00	361,051,600	
7480	スズデン	14,400	1,963.00	28,267,200	
7481	尾家産業	3,000	2,128.00	6,384,000	
7482	シモジマ	27,500	1,367.00	37,592,500	
7483	ドウシシャ	38,000	2,300.00	87,400,000	
7487	小津産業	2,900	1,627.00	4,718,300	貸付有価証券 500株
7504	高速	24,400	2,430.00	59,292,000	
7510	たけびし	15,700	2,202.00	34,571,400	
7525	リックス	9,300	3,055.00	28,411,500	
7537	丸文	36,700	1,263.00	46,352,100	
7552	ハピネット	34,900	3,365.00	117,438,500	
7570	橋本総業ホールディングス	16,200	1,350.00	21,870,000	
7575	日本ライフライン	110,000	1,130.00	124,300,000	
7590	タカショー	35,800	540.00	19,332,000	貸付有価証券 3,700株
7599	I D O M	108,600	1,448.00	157,252,800	
7607	進和	25,100	2,905.00	72,915,500	貸付有価証券 900株
7608	エスケイジャパン	3,000	843.00	2,529,000	
7609	ダイトロン	16,200	2,953.00	47,838,600	
7613	シークス	58,500	1,323.00	77,395,500	
7619	田中商事	3,500	822.00	2,877,000	
7628	オーハシテクニカ	21,500	1,831.00	39,366,500	
7637	白銅	11,500	2,873.00	33,039,500	
7673	ダイコー通産	1,300	1,215.00	1,579,500	
8001	伊藤忠商事	2,761,300	7,615.00	21,027,299,500	
8002	丸紅	3,407,300	2,965.00	10,102,644,500	貸付有価証券 28,300株
8007	高島	7,700	1,052.00	8,100,400	貸付有価証券 500株
8012	長瀬産業	188,300	3,029.00	570,360,700	

8014	蝶理	25,700	3,510.00	90,207,000	
8015	豊田通商	359,800	9,538.00	3,431,772,400	
8018	三共生興	56,900	743.00	42,276,700	
8020	兼松	171,800	2,642.00	453,895,600	貸付有価証券 400株
8025	ツカモトコーポレーション	1,800	1,201.00	2,161,800	貸付有価証券 200株
8031	三井物産	3,076,800	7,446.00	22,909,852,800	貸付有価証券 19,500株
8032	日本紙パルプ商事	19,600	6,000.00	117,600,000	
8037	カメイ	43,700	2,415.00	105,535,500	
8038	東都水産	600	6,530.00	3,918,000	貸付有価証券 300株
8041	ＯＵＧホールディングス	1,800	2,735.00	4,923,000	
8043	スターゼン	28,300	3,030.00	85,749,000	
8051	山善	124,500	1,433.00	178,408,500	
8052	椿本興業	25,500	2,258.00	57,579,000	
8053	住友商事	2,486,100	3,969.00	9,867,330,900	貸付有価証券 36,800株
8057	内田洋行	16,600	8,210.00	136,286,000	
8058	三菱商事	7,887,800	3,165.00	24,964,887,000	
8059	第一実業	38,600	2,397.00	92,524,200	
8060	キャノンマーケティングジャパン	95,200	4,501.00	428,495,200	
8061	西華産業	16,100	4,515.00	72,691,500	
8065	佐藤商事	28,500	1,695.00	48,307,500	
8070	東京産業	37,500	719.00	26,962,500	貸付有価証券 200株
8074	ユアサ商事	32,100	5,630.00	180,723,000	
8075	神鋼商事	10,300	7,690.00	79,207,000	
8077	トルク	6,800	233.00	1,584,400	貸付有価証券 2,600株
8078	阪和興業	73,800	6,160.00	454,608,000	
8079	正栄食品工業	27,300	4,690.00	128,037,000	貸付有価証券 2,900株
8081	カナデン	30,800	1,680.00	51,744,000	
8084	RYODEN	33,100	2,746.00	90,892,600	
8088	岩谷産業	93,500	9,684.00	905,454,000	
8089	ナイス	4,000	1,885.00	7,540,000	貸付有価証券 400株
8091	ニチモウ	3,200	2,183.00	6,985,600	
8093	極東貿易	24,500	1,772.00	43,414,000	貸付有価証券

					900 株
8095	アステナホールディングス	77,200	518.00	39,989,600	
8097	三愛オブリ	95,800	2,057.00	197,060,600	
8098	稲畑産業	81,200	3,520.00	285,824,000	
8101	G S I クレオス	22,000	2,250.00	49,500,000	
8103	明和産業	48,500	736.00	35,696,000	
8104	クワザワホールディングス	4,600	825.00	3,795,000	貸付有価証券 1,600 株
8125	ワキタ	68,000	1,724.00	117,232,000	
8129	東邦ホールディングス	111,000	4,169.00	462,759,000	
8130	サンゲツ	94,500	3,010.00	284,445,000	
8131	ミツウロコグループホールディングス	52,400	1,661.00	87,036,400	
8132	シナネンホールディングス	11,400	4,960.00	56,544,000	貸付有価証券 500 株
8133	伊藤忠エネクス	101,800	1,515.00	154,227,000	
8136	サンリオ	333,600	2,850.00	950,760,000	
8137	サンワテクノス	21,000	2,290.00	48,090,000	貸付有価証券 200 株
8141	新光商事	55,200	947.00	52,274,400	貸付有価証券 200 株
8142	トーヨー	16,000	3,805.00	60,880,000	貸付有価証券 1,200 株
8150	三信電気	16,500	2,200.00	36,300,000	
8151	東陽テクニカ	37,900	1,718.00	65,112,200	
8153	モスフードサービス	60,400	3,645.00	220,158,000	貸付有価証券 2,100 株
8154	加賀電子	37,500	5,670.00	212,625,000	
8158	ソーダニッカ	39,000	1,142.00	44,538,000	
8159	立花エレテック	27,300	3,095.00	84,493,500	
8275	フォーバル	16,100	1,489.00	23,972,900	
8283	P A L T A C	55,400	4,459.00	247,028,600	
8285	三谷産業	71,700	373.00	26,744,100	
8835	太平洋興発	4,800	799.00	3,835,200	
9260	西本W i s m e t t a cホールディングス	10,400	4,325.00	44,980,000	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	1,000	2,663.00	2,663,000	
9273	コーア商事ホールディングス	30,300	708.00	21,452,400	貸付有価証券 3,500 株
9274	K P P グループホールディングス	106,300	814.00	86,528,200	
9305	ヤマタネ	18,100	2,888.00	52,272,800	

9763	丸紅建材リース	900	3, 145. 00	2, 830, 500	
9824	泉州電業	25, 500	5, 310. 00	135, 405, 000	
9830	トラスコ中山	86, 300	2, 478. 00	213, 851, 400	
9832	オートバックスセブン	143, 000	1, 554. 50	222, 293, 500	
9837	モリト	29, 400	1, 514. 00	44, 511, 600	
9869	加藤産業	50, 800	4, 315. 00	219, 202, 000	
9872	北恵	3, 000	886. 00	2, 658, 000	貸付有価証券 800 株
9882	イエローハット	65, 200	2, 284. 00	148, 916, 800	
9896	J Kホールディングス	31, 500	1, 025. 00	32, 287, 500	
9902	日伝	26, 900	3, 560. 00	95, 764, 000	貸付有価証券 400 株
9930	北沢産業	7, 100	351. 00	2, 492, 100	貸付有価証券 3, 300 株
9932	杉本商事	19, 900	2, 513. 00	50, 008, 700	
9934	因幡電機産業	106, 500	3, 920. 00	417, 480, 000	
9960	東テク	41, 100	2, 494. 00	102, 503, 400	貸付有価証券 1, 300 株
9962	ミスミグループ本社	620, 500	2, 826. 00	1, 753, 533, 000	
9972	アルテック	6, 700	274. 00	1, 835, 800	
9982	タキヒヨー	3, 000	1, 222. 00	3, 666, 000	貸付有価証券 1, 300 株
9986	蔵王産業	2, 200	2, 570. 00	5, 654, 000	
9987	スズケン	146, 700	4, 935. 00	723, 964, 500	貸付有価証券 1, 500 株
9991	ジェコス	24, 500	1, 006. 00	24, 647, 000	貸付有価証券 300 株
2651	ローソン	29, 100	10, 330. 00	300, 603, 000	
2659	サンエー	31, 300	4, 970. 00	155, 561, 000	
2664	カワチ薬品	32, 100	2, 950. 00	94, 695, 000	
2670	エービーシー・マート	179, 800	2, 912. 00	523, 577, 600	
2674	ハードオフコーポレーション	16, 400	2, 080. 00	34, 112, 000	
2678	アスクル	99, 200	2, 226. 00	220, 819, 200	
2681	ゲオホールディングス	46, 100	1, 662. 00	76, 618, 200	
2685	アダストリア	49, 600	3, 675. 00	182, 280, 000	
2686	ジーフット	8, 100	293. 00	2, 373, 300	貸付有価証券 3, 900 株
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1, 600	659. 00	1, 054, 400	貸付有価証券 600 株
2695	くら寿司	48, 100	4, 375. 00	210, 437, 500	
2698	キャンドウ	14, 600	3, 360. 00	49, 056, 000	貸付有価証券

					700 株
2722	I Kホールディングス	4,100	374.00	1,533,400	貸付有価証券 1,800 株
2726	パルグループホールディングス	80,600	1,829.00	147,417,400	貸付有価証券 3,000 株
2730	エディオン	162,600	1,605.00	260,973,000	
2734	サーラコーポレーション	86,300	875.00	75,512,500	
2735	ワッツ	5,700	702.00	4,001,400	貸付有価証券 1,900 株
2742	ハローズ	18,700	4,540.00	84,898,000	
2752	フジオフードグループ本社	46,200	1,448.00	66,897,600	
2753	あみやき亭	9,900	6,190.00	61,281,000	
2764	ひらまつ	28,600	218.00	6,234,800	貸付有価証券 8,600 株
2791	大黒天物産	12,600	8,400.00	105,840,000	
2792	ハニーズホールディングス	36,500	1,603.00	58,509,500	
2796	ファーマライズホールディングス	2,800	639.00	1,789,200	
3028	アルペン	33,900	2,041.00	69,189,900	貸付有価証券 2,400 株
3030	ハブ	4,100	876.00	3,591,600	貸付有価証券 1,300 株
3034	クオールホールディングス	56,500	1,484.00	83,846,000	
3046	ジinzホールディングス	31,300	3,950.00	123,635,000	貸付有価証券 1,200 株
3048	ビックカメラ	245,900	1,559.00	383,358,100	
3050	D C Mホールディングス	212,700	1,466.00	311,818,200	
3053	ペッパーフードサービス	103,300	129.00	13,325,700	貸付有価証券 7,000 株
3064	M o n o t a R O	582,300	1,866.50	1,086,862,950	
3067	東京一番フーズ	2,900	517.00	1,499,300	貸付有価証券 500 株
3073	D Dグループ	7,100	1,207.00	8,569,700	貸付有価証券 1,700 株
3082	きちりホールディングス	3,000	920.00	2,760,000	貸付有価証券 700 株
3086	J . フロント リテイリング	471,400	1,641.00	773,567,400	貸付有価証券 2,600 株
3087	ドトール・日レスホールディングス	72,800	2,223.00	161,834,400	
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	747,300	2,302.50	1,720,658,250	貸付有価証券 11,800 株
3091	ブロンコビリー	24,100	3,875.00	93,387,500	
3092	Z O Z O	261,800	3,971.00	1,039,607,800	
3093	トレジャー・ファクトリー	25,500	1,840.00	46,920,000	貸付有価証券 800 株

3097	物語コーポレーション	68,600	3,450.00	236,670,000	貸付有価証券 2,400株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	680,000	2,906.00	1,976,080,000	
3134	H a m e e	16,600	1,164.00	19,322,400	
3135	マーケットエンタープライズ	1,100	994.00	1,093,400	貸付有価証券 100株
3141	ウエルシアホールディングス	213,100	2,048.00	436,428,800	
3148	クリエイトSDホールディングス	58,200	3,660.00	213,012,000	
3159	丸善CH Iホールディングス	15,000	344.00	5,160,000	貸付有価証券 400株
3169	ミサワ	2,600	624.00	1,622,400	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	1,700	1,424.00	2,420,800	貸付有価証券 200株
3175	エー・ピーホールディングス	2,600	951.00	2,472,600	貸付有価証券 1,100株
3178	チムニー	3,900	1,347.00	5,253,300	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	37,100	1,382.00	51,272,200	
3182	オイシックス・ラ・大地	55,200	1,241.00	68,503,200	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	93,800	2,438.00	228,684,400	貸付有価証券 3,200株
3191	ジョイフル本田	119,500	2,197.00	262,541,500	貸付有価証券 4,200株
3193	エターナルホスピタリティグループ	15,200	3,670.00	55,784,000	貸付有価証券 600株
3196	ホットランド	31,400	2,550.00	80,070,000	
3197	すかいらくホールディングス	561,500	2,239.50	1,257,479,250	貸付有価証券 19,700株
3198	S F Pホールディングス	19,900	2,153.00	42,844,700	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	31,800	1,755.00	55,809,000	
3221	ヨシックスホールディングス	9,500	2,912.00	27,664,000	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ ホール	114,700	877.00	100,591,900	貸付有価証券 12,700株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	18,600	589.00	10,955,400	
3328	B E E N O S	24,400	2,415.00	58,926,000	
3333	あさひ	38,100	1,538.00	58,597,800	貸付有価証券 1,300株
3341	日本調剤	27,000	1,481.00	39,987,000	
3349	コスモス薬品	34,800	13,345.00	464,406,000	
3361	トーエル	5,600	850.00	4,760,000	貸付有価証券 600株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	4,205,500	1,964.50	8,261,704,750	

3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	278,100	1,105.00	307,300,500	貸付有価証券 10,800株
3391	ツルハホールディングス	86,300	9,620.00	830,206,000	
3395	サンマルクホールディングス	33,100	2,212.00	73,217,200	
3396	フェリシモ	2,800	937.00	2,623,600	
3397	トリドールホールディングス	115,200	3,646.00	420,019,200	
3415	TOKYO BASE	43,800	308.00	13,490,400	
3538	ウイルプラスホールディングス	2,100	1,131.00	2,375,100	貸付有価証券 100株
3539	J Mホールディングス	31,000	2,913.00	90,303,000	貸付有価証券 1,000株
3544	サツドラホールディングス	5,400	831.00	4,487,400	貸付有価証券 600株
3546	アレンザホールディングス	30,700	1,138.00	34,936,600	貸付有価証券 1,000株
3547	串カツ田中ホールディングス	11,000	1,696.00	18,656,000	貸付有価証券 1,200株
3548	バロックジャパンリミテッド	32,000	808.00	25,856,000	貸付有価証券 4,400株
3549	クスリのアオキホールディングス	123,600	3,143.00	388,474,800	貸付有価証券 600株
3561	力の源ホールディングス	23,800	1,452.00	34,557,600	貸付有価証券 1,900株
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	219,100	2,703.50	592,336,850	
4350	メディカルシステムネットワーク	44,500	582.00	25,899,000	
7127	一家ホールディングス	2,800	686.00	1,920,800	貸付有価証券 1,300株
7135	ジャパングラフトホールディングス	7,400	160.00	1,184,000	貸付有価証券 1,700株
7416	はるやまホールディングス	6,100	594.00	3,623,400	貸付有価証券 400株
7419	ノジマ	119,100	1,590.00	189,369,000	
7421	カップ・クリエイト	64,600	1,735.00	112,081,000	
7445	ライトオン	9,600	380.00	3,648,000	貸付有価証券 5,800株
7453	良品計画	489,200	2,642.00	1,292,466,400	貸付有価証券 10,900株
7455	パリミキホールディングス	15,900	399.00	6,344,100	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	35,100	974.00	34,187,400	
7475	アルビス	13,400	2,646.00	35,456,400	
7494	コナカ	13,800	278.00	3,836,400	貸付有価証券 5,100株
7506	ハウス オブ ローゼ	1,600	1,587.00	2,539,200	貸付有価証券 300株

7508	G－7ホールディングス	44,800	1,631.00	73,068,800	
7512	イオン北海道	121,500	915.00	111,172,500	
7513	コジマ	79,200	967.00	76,586,400	
7514	ヒマラヤ	4,100	913.00	3,743,300	
7516	コーナン商事	50,400	4,185.00	210,924,000	
7520	エコス	15,200	2,310.00	35,112,000	
7522	ワタミ	43,400	937.00	40,665,800	
7524	マルシェ	4,400	254.00	1,117,600	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	829,700	3,847.00	3,191,855,900	
7545	西松屋チェーン	80,800	2,254.00	182,123,200	
7550	ゼンショーホールディングス	209,200	6,045.00	1,264,614,000	貸付有価証券 1,700株
7554	幸楽苑ホールディングス	30,400	1,373.00	41,739,200	
7561	ハークスレイ	4,000	799.00	3,196,000	
7581	サイゼリヤ	60,700	5,400.00	327,780,000	
7593	V Tホールディングス	160,200	510.00	81,702,000	
7596	魚力	14,300	2,491.00	35,621,300	
7601	ポプラ	2,900	256.00	742,400	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	19,500	2,192.00	42,744,000	
7606	ユナイテッドアローズ	48,300	1,927.00	93,074,100	
7611	ハイデイ日高	60,900	3,070.00	186,963,000	貸付有価証券 1,400株
7615	YU－WA Creation Holdi	7,100	137.00	972,700	貸付有価証券 3,300株
7616	コロワイド	176,600	2,042.50	360,705,500	貸付有価証券 14,500株
7630	老番屋	162,200	1,105.00	179,231,000	貸付有価証券 6,000株
7640	トップカルチャー	4,200	167.00	701,400	貸付有価証券 1,900株
7646	P L A N T	2,900	1,523.00	4,416,700	貸付有価証券 100株
7649	スギホールディングス	248,300	2,380.50	591,078,150	貸付有価証券 2,700株
7679	薬王堂ホールディングス	20,100	2,865.00	57,586,500	
7918	ヴィア・ホールディングス	17,800	113.00	2,011,400	貸付有価証券 6,600株
8005	スクロール	61,200	1,091.00	66,769,200	貸付有価証券 100株
8008	ヨンドシーホールディングス	38,900	1,947.00	75,738,300	貸付有価証券

					4,400株
8160	木曽路	62,200	2,595.00	161,409,000	
8163	S R Sホールディングス	67,700	1,355.00	91,733,500	
8165	千趣会	75,600	326.00	24,645,600	
8166	タカキュー	9,000	98.00	882,000	
8167	リテールパートナーズ	61,000	1,714.00	104,554,000	
8173	上新電機	40,700	2,622.00	106,715,400	
8174	日本瓦斯	217,700	2,358.50	513,445,450	貸付有価証券 7,700株
8179	ロイヤルホールディングス	72,400	2,545.00	184,258,000	貸付有価証券 2,500株
8181	東天紅	1,000	911.00	911,000	貸付有価証券 300株
8182	いなげや	39,900	1,244.00	49,635,600	
8185	チヨダ	39,200	937.00	36,730,400	貸付有価証券 1,400株
8194	ライフコーポレーション	43,100	3,890.00	167,659,000	
8200	リンガーハット	53,000	2,351.00	124,603,000	貸付有価証券 7,200株
8203	M r M a x HD	51,800	680.00	35,224,000	
8207	テンアライド	13,600	297.00	4,039,200	貸付有価証券 8,300株
8214	A O K Iホールディングス	88,100	1,344.00	118,406,400	
8217	オークワ	59,100	962.00	56,854,200	貸付有価証券 2,300株
8218	コメリ	63,200	3,535.00	223,412,000	貸付有価証券 400株
8219	青山商事	87,800	1,488.00	130,646,400	
8227	しまむら	96,500	7,565.00	730,022,500	貸付有価証券 300株
8230	はせがわ	6,000	356.00	2,136,000	
8233	高島屋	261,600	2,638.00	690,100,800	貸付有価証券 10,900株
8237	松屋	69,600	1,081.00	75,237,600	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	181,800	2,333.00	424,139,400	
8244	近鉄百貨店	17,600	2,270.00	39,952,000	貸付有価証券 2,000株
8252	丸井グループ	272,700	2,267.00	618,210,900	
8255	アクシアル リテイリング	112,100	1,054.00	118,153,400	
8260	井筒屋	6,000	453.00	2,718,000	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	1,392,500	3,466.00	4,826,405,000	貸付有価証券 40,500株

8273	イズミ	72,800	3,215.00	234,052,000	
8276	平和堂	68,700	2,330.00	160,071,000	
8278	フジ	63,100	2,017.00	127,272,700	貸付有価証券 7,500株
8279	ヤオコー	48,700	9,634.00	469,175,800	
8281	ゼビオホールディングス	55,600	1,150.00	63,940,000	
8282	ケーズホールディングス	275,900	1,493.50	412,056,650	
8289	O l y m p i c グループ	5,500	546.00	3,003,000	貸付有価証券 2,200株
8291	日産東京販売ホールディングス	18,900	496.00	9,374,400	
9262	シルバーライフ	11,000	972.00	10,692,000	貸付有価証券 400株
9267	G e n k y D r u g S t o r e s	36,000	2,801.00	100,836,000	
9275	ナルミヤ・インターナショナル	2,100	1,383.00	2,904,300	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	26,800	1,568.00	42,022,400	貸付有価証券 3,400株
9279	ギフトホールディングス	17,400	2,760.00	48,024,000	
9627	アインホールディングス	56,600	6,114.00	346,052,400	
9828	元気寿司	23,200	3,300.00	76,560,000	
9831	ヤマダホールディングス	1,263,400	431.60	545,283,440	貸付有価証券 2,200株
9842	アークランズ	122,200	1,939.00	236,945,800	
9843	ニトリホールディングス	149,500	17,245.00	2,578,127,500	
9850	グルメ杵屋	33,300	1,113.00	37,062,900	貸付有価証券 200株
9854	愛眼	9,400	181.00	1,701,400	
9856	ケーユーホールディングス	19,200	1,320.00	25,344,000	
9861	吉野家ホールディングス	151,300	3,108.00	470,240,400	貸付有価証券 200株
9887	松屋フーズホールディングス	19,400	6,020.00	116,788,000	
9900	サガミホールディングス	61,600	1,685.00	103,796,000	貸付有価証券 100株
9919	関西フードマーケット	27,800	2,403.00	66,803,400	
9936	王将フードサービス	30,400	8,790.00	267,216,000	
9946	ミニストップ	29,900	1,708.00	51,069,200	
9948	アークス	75,300	2,917.00	219,650,100	貸付有価証券 2,700株
9956	バローホールディングス	78,400	2,443.00	191,531,200	
9974	ベルク	20,500	7,550.00	154,775,000	
9979	大庄	22,200	1,253.00	27,816,600	貸付有価証券 400株

9983	ファーストリテイリング	231,000	40,890.00	9,445,590,000	
9989	サンドラッグ	138,600	4,076.00	564,933,600	
9990	サックスパー ホールディングス	34,700	791.00	27,447,700	
9993	ヤマザワ	2,700	1,307.00	3,528,900	貸付有価証券 1,000株
9994	やまや	2,600	3,120.00	8,112,000	
9997	ベルーナ	98,800	761.00	75,186,800	
5830	いよぎんホールディングス	455,000	1,412.00	642,460,000	
5831	しずおかフィナンシャルグループ	849,500	1,483.00	1,259,808,500	貸付有価証券 5,600株
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	321,900	1,654.00	532,422,600	
5838	楽天銀行	177,300	2,897.00	513,638,100	貸付有価証券 3,400株
5844	京都フィナンシャルグループ	481,300	2,820.00	1,357,266,000	貸付有価証券 800株
7150	島根銀行	3,400	562.00	1,910,800	貸付有価証券 900株
7161	じもとホールディングス	9,000	379.00	3,411,000	貸付有価証券 2,900株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,772,000	609.40	1,079,856,800	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	49,000	4,715.00	231,035,000	
7180	九州フィナンシャルグループ	740,100	931.70	689,551,170	
7182	ゆうちょ銀行	4,201,900	1,489.50	6,258,730,050	貸付有価証券 37,000株
7184	富山第一銀行	121,400	1,223.00	148,472,200	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,034,300	936.60	1,905,325,380	貸付有価証券 72,200株
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	214,000	1,971.00	421,794,000	
7322	三十三フィナンシャルグループ	34,200	2,100.00	71,820,000	
7327	第四北越フィナンシャルグループ	60,000	5,130.00	307,800,000	
7337	ひろぎんホールディングス	544,200	1,219.50	663,651,900	貸付有価証券 1,200株
7350	おきなわフィナンシャルグループ	32,600	2,569.00	83,749,400	
7380	十六フィナンシャルグループ	49,600	4,675.00	231,880,000	
7381	北國フィナンシャルホールディングス	40,300	5,250.00	211,575,000	
7384	プロクレアホールディングス	43,700	1,904.00	83,204,800	
7389	あいちフィナンシャルグループ	78,500	2,701.00	212,028,500	貸付有価証券 1,900株
8304	あおぞら銀行	274,800	2,588.00	711,182,400	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	23,287,000	1,641.50	38,225,610,500	
8308	りそなホールディングス	4,422,300	1,044.00	4,616,881,200	貸付有価証券

					2,200株
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,374,200	3,694.00	5,076,294,800	貸付有価証券 2,900株
8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,677,800	10,350.00	27,715,230,000	貸付有価証券 17,800株
8331	千葉銀行	1,065,600	1,406.50	1,498,766,400	貸付有価証券 19,100株
8334	群馬銀行	742,000	1,004.50	745,339,000	貸付有価証券 4,000株
8336	武蔵野銀行	53,400	3,250.00	173,550,000	
8337	千葉興業銀行	81,300	1,005.00	81,706,500	貸付有価証券 2,200株
8338	筑波銀行	167,800	320.00	53,696,000	
8341	七十七銀行	111,300	4,315.00	480,259,500	
8343	秋田銀行	25,600	2,678.00	68,556,800	
8344	山形銀行	42,500	1,208.00	51,340,000	
8345	岩手銀行	24,200	2,816.00	68,147,200	
8346	東邦銀行	302,400	322.00	97,372,800	
8349	東北銀行	5,800	1,225.00	7,105,000	貸付有価証券 2,100株
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	333,000	4,262.00	1,419,246,000	
8358	スルガ銀行	286,200	1,042.00	298,220,400	
8359	八十二銀行	820,500	1,029.50	844,704,750	
8360	山梨中央銀行	42,800	2,049.00	87,697,200	
8361	大垣共立銀行	72,900	2,231.00	162,639,900	
8362	福井銀行	34,200	2,208.00	75,513,600	
8364	清水銀行	15,200	1,692.00	25,718,400	
8365	富山銀行	2,000	1,783.00	3,566,000	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	63,600	4,175.00	265,530,000	
8367	南都銀行	57,500	3,515.00	202,112,500	貸付有価証券 100株
8368	百五銀行	359,700	678.00	243,876,600	
8370	紀陽銀行	136,800	1,869.00	255,679,200	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	236,600	2,096.00	495,913,600	
8381	山陰合同銀行	239,300	1,370.00	327,841,000	
8383	鳥取銀行	4,200	1,381.00	5,800,200	貸付有価証券 200株
8386	百十四銀行	37,600	3,325.00	125,020,000	
8387	四国銀行	56,100	1,176.00	65,973,600	
8388	阿波銀行	53,600	2,768.00	148,364,800	

8392	大分銀行	23,000	3,500.00	80,500,000	
8393	宮崎銀行	23,000	3,450.00	79,350,000	
8395	佐賀銀行	22,400	2,699.00	60,457,600	
8399	琉球銀行	81,400	1,261.00	102,645,400	
8410	セブン銀行	1,198,600	268.40	321,704,240	貸付有価証券 48,200 株
8411	みずほフィナンシャルグループ	5,161,400	3,265.00	16,851,971,000	
8416	高知銀行	4,100	925.00	3,792,500	
8418	山口フィナンシャルグループ	374,900	1,800.50	675,007,450	
8522	名古屋銀行	24,300	7,600.00	184,680,000	
8524	北洋銀行	579,400	532.00	308,240,800	
8537	大光銀行	3,800	1,645.00	6,251,000	
8541	愛媛銀行	51,500	1,277.00	65,765,500	
8542	トマト銀行	4,200	1,281.00	5,380,200	
8544	京葉銀行	157,400	866.00	136,308,400	
8550	栃木銀行	191,000	373.00	71,243,000	
8551	北日本銀行	12,400	2,778.00	34,447,200	
8558	東和銀行	70,200	711.00	49,912,200	
8562	福島銀行	12,400	281.00	3,484,400	貸付有価証券 4,100 株
8563	大東銀行	5,200	761.00	3,957,200	貸付有価証券 2,200 株
8600	トモニホールディングス	361,900	420.00	151,998,000	
8713	フィデアホールディングス	39,500	1,641.00	64,819,500	
8714	池田泉州ホールディングス	530,400	390.00	206,856,000	
7148	F P G	142,300	2,171.00	308,933,300	
7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	62,000	1,600.00	99,200,000	
7347	マーキュリアホールディングス	6,000	919.00	5,514,000	貸付有価証券 800 株
8473	S B I ホールディングス	613,700	4,020.00	2,467,074,000	
8518	日本アジア投資	8,600	239.00	2,055,400	貸付有価証券 3,700 株
8595	ジャフコ グループ	114,000	1,917.00	218,538,000	
8601	大和証券グループ本社	2,962,100	1,207.00	3,575,254,700	
8604	野村ホールディングス	6,430,400	934.60	6,009,851,840	貸付有価証券 93,800 株
8609	岡三証券グループ	335,700	781.00	262,181,700	貸付有価証券 4,400 株
8613	丸三証券	127,200	1,057.00	134,450,400	貸付有価証券 4,500 株

8614	東洋証券	101,500	392.00	39,788,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	454,000	572.00	259,688,000	
8617	光世証券	2,700	612.00	1,652,400	貸付有価証券 1,300株
8622	水戸証券	112,900	569.00	64,240,100	
8624	いちよし証券	71,600	854.00	61,146,400	
8628	松井証券	188,200	840.00	158,088,000	
8698	マネックスグループ	374,500	730.00	273,385,000	
8706	極東証券	52,400	1,470.00	77,028,000	貸付有価証券 4,000株
8707	岩井コスモホールディングス	43,600	2,277.00	99,277,200	
8708	アイザワ証券グループ	55,200	2,349.00	129,664,800	
8732	マネーパートナーズグループ	12,400	253.00	3,137,200	貸付有価証券 4,600株
8739	スパークス・グループ	42,600	1,708.00	72,760,800	
8742	小林洋行	4,700	285.00	1,339,500	貸付有価証券 500株
7181	かんぽ生命保険	389,400	3,080.00	1,199,352,000	
7388	F P パートナー	10,100	2,803.00	28,310,300	貸付有価証券 100株
8630	S O M P Oホールディングス	1,725,700	3,389.00	5,848,397,300	
8715	アニコム ホールディングス	129,900	675.00	87,682,500	
8725	MS & ADインシュアランスグループ ホール	2,568,500	3,366.00	8,645,571,000	貸付有価証券 9,400株
8750	第一生命ホールディングス	1,797,900	4,198.00	7,547,584,200	貸付有価証券 1,700株
8766	東京海上ホールディングス	3,733,400	5,780.00	21,579,052,000	貸付有価証券 132,900株
8795	T & Dホールディングス	1,026,800	2,737.00	2,810,351,600	貸付有価証券 2,200株
8798	アドバンスクリエイト	29,500	1,067.00	31,476,500	貸付有価証券 2,000株
4346	N E X Y Z . G r o u p	3,800	642.00	2,439,600	貸付有価証券 1,500株
7164	全国保証	100,000	5,931.00	593,100,000	貸付有価証券 3,600株
7183	あんしん保証	5,100	223.00	1,137,300	
7187	ジェイリース	25,700	1,305.00	33,538,500	
7191	イントラスト	4,600	834.00	3,836,400	
7192	日本モーゲージサービス	6,600	424.00	2,798,400	貸付有価証券 1,800株
7196	C a s a	4,600	903.00	4,153,800	貸付有価証券 800株

7198	S B I アルヒ	36,700	906.00	33,250,200	
7199	プレミアグループ	64,600	2,175.00	140,505,000	
7383	ネットプロテクションズホールディングス	127,200	189.00	24,040,800	
8253	クレディセゾン	242,300	3,251.00	787,717,300	
8424	芙蓉総合リース	35,200	12,105.00	426,096,000	
8425	みずほリース	320,200	1,107.00	354,461,400	
8439	東京センチュリー	285,800	1,482.00	423,555,600	
8511	日本証券金融	140,500	1,587.00	222,973,500	
8515	アイフル	562,900	388.00	218,405,200	貸付有価証券 15,600 株
8566	リコーリース	36,300	5,250.00	190,575,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	219,500	1,326.00	291,057,000	
8572	アコム	680,500	408.90	278,256,450	
8584	ジャックス	40,700	4,830.00	196,581,000	貸付有価証券 800 株
8585	オリエントコーポレーション	124,800	1,039.00	129,667,200	
8591	オリックス	2,293,200	3,512.00	8,053,718,400	貸付有価証券 32,500 株
8593	三菱HCキャピタル	1,703,800	1,039.00	1,770,248,200	
8596	九州リースサービス	4,800	1,092.00	5,241,600	
8697	日本取引所グループ	985,800	3,728.00	3,675,062,400	
8771	イー・ギャランティ	62,300	1,426.00	88,839,800	
8772	アサックス	5,400	839.00	4,530,600	
8793	NECキャピタルソリューション	18,800	4,065.00	76,422,000	
1435	r o b o t h o m e	105,800	185.00	19,573,000	
1878	大東建託	140,100	16,815.00	2,355,781,500	
187A	サムティホールディングス	60,900	2,477.00	150,849,300	
2337	いちご	388,100	396.00	153,687,600	貸付有価証券 15,500 株
2353	日本駐車場開発	455,300	207.00	94,247,100	
2975	スター・マイカ・ホールディングス	44,400	639.00	28,371,600	
2980	S R Eホールディングス	16,500	4,630.00	76,395,000	貸付有価証券 1,300 株
2982	A Dワークスグループ	29,900	231.00	6,906,900	貸付有価証券 11,700 株
3003	ヒューリック	891,900	1,450.50	1,293,700,950	
3231	野村不動産ホールディングス	212,900	3,984.00	848,193,600	
3232	三重交通グループホールディングス	81,800	607.00	49,652,600	
3245	ディア・ライフ	65,200	929.00	60,570,800	

3246	コーセーアールイー	3,800	727.00	2,762,600	貸付有価証券 2,000株
3252	地主	29,200	2,693.00	78,635,600	
3254	プレサンスコーポレーション	50,600	1,922.00	97,253,200	
3271	THEグローバル社	6,900	547.00	3,774,300	貸付有価証券 2,400株
3275	ハウスコム	1,900	1,040.00	1,976,000	
3276	JPMC	22,100	1,207.00	26,674,700	
3277	サンセイランディック	3,500	1,013.00	3,545,500	貸付有価証券 300株
3280	エストラスト	1,200	725.00	870,000	
3284	フージャースホールディングス	59,000	1,171.00	69,089,000	
3288	オープンハウスグループ	140,100	4,937.00	691,673,700	
3289	東急不動産ホールディングス	1,149,600	1,060.00	1,218,576,000	
3291	飯田グループホールディングス	366,400	2,151.50	788,309,600	貸付有価証券 200株
3294	イーグランド	1,800	1,559.00	2,806,200	
3299	ムゲンエステート	7,900	1,252.00	9,890,800	貸付有価証券 600株
3452	ビーロット	8,100	926.00	7,500,600	
3454	ファーストブラザーズ	2,300	1,209.00	2,780,700	貸付有価証券 400株
3457	And Doホールディングス	23,100	1,119.00	25,848,900	
3458	シーアールイー	17,000	1,530.00	26,010,000	
3465	ケイアイスター不動産	18,400	3,475.00	63,940,000	貸付有価証券 600株
3467	アグレ都市デザイン	2,200	1,585.00	3,487,000	貸付有価証券 700株
3475	グッドコムアセット	35,500	791.00	28,080,500	貸付有価証券 2,600株
3480	ジェイ・エス・ビー	19,000	3,040.00	57,760,000	
3482	ロードスターキャピタル	24,900	2,814.00	70,068,600	
3484	テンポイノベーション	3,500	894.00	3,129,000	貸付有価証券 1,400株
3486	グローバル・リンク・マネジメント	2,200	2,204.00	4,848,800	貸付有価証券 200株
3489	フェイスネットワーク	3,200	1,816.00	5,811,200	
3498	霞ヶ関キャピタル	15,700	13,710.00	215,247,000	貸付有価証券 100株
4666	パーク24	248,300	1,630.00	404,729,000	貸付有価証券 8,800株
4809	パラカ	12,000	2,087.00	25,044,000	
5535	ミガロホールディングス	1,900	4,315.00	8,198,500	貸付有価証券

					800 株
6620	宮越ホールディングス	17,400	1,801.00	31,337,400	貸付有価証券 1,600 株
8801	三井不動産	5,305,000	1,463.50	7,763,867,500	
8802	三菱地所	2,499,500	2,492.50	6,230,003,750	貸付有価証券 81,100 株
8803	平和不動産	62,100	3,920.00	243,432,000	
8804	東京建物	334,100	2,521.00	842,266,100	
8818	京阪神ビルディング	71,500	1,653.00	118,189,500	
8830	住友不動産	553,000	4,713.00	2,606,289,000	
8841	テーオーシー	68,100	746.00	50,802,600	
8848	レオパレス 2 1	382,600	516.00	197,421,600	
8850	スターツコーポレーション	54,900	3,380.00	185,562,000	
8860	フジ住宅	48,200	780.00	37,596,000	
8864	空港施設	53,800	603.00	32,441,400	
8869	明和地所	24,500	940.00	23,030,000	貸付有価証券 2,400 株
8871	ゴールドクレスト	31,200	2,643.00	82,461,600	
8877	エスリード	18,000	4,515.00	81,270,000	
8881	日神グループホールディングス	61,400	555.00	34,077,000	
8892	日本エスコン	71,600	1,085.00	77,686,000	貸付有価証券 2,600 株
8897	M I R A R T Hホールディングス	198,900	508.00	101,041,200	
8904	A V A N T I A	6,300	843.00	5,310,900	
8905	イオンモール	198,200	1,897.00	375,985,400	貸付有価証券 500 株
8908	毎日コムネット	4,300	739.00	3,177,700	
8917	ファースト住建	4,700	1,078.00	5,066,600	貸付有価証券 2,600 株
8918	ランド	2,122,400	9.00	19,101,600	
8919	カチタス	102,800	1,750.00	179,900,000	
8923	トーセイ	63,600	2,418.00	153,784,800	
8928	穴吹興産	2,200	2,198.00	4,835,600	貸付有価証券 1,000 株
8934	サンフロンティア不動産	56,600	1,964.00	111,162,400	
8935	F J ネクストホールディングス	40,200	1,293.00	51,978,600	
8940	インテリックス	2,800	542.00	1,517,600	
8944	ランドビジネス	4,300	241.00	1,036,300	
8945	サンネクスタグループ	3,400	1,068.00	3,631,200	
8999	グランディハウス	32,200	604.00	19,448,800	

9706	日本空港ビルデング	135,200	5,518.00	746,033,600	
1717	明豊ファシリティワークス	6,000	883.00	5,298,000	
2120	L I F U L L	97,500	160.00	15,600,000	
2121	M I X I	85,600	2,988.00	255,772,800	貸付有価証券 600株
2124	ジェイエシーリクルートメント	144,200	665.00	95,893,000	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	636,000	861.50	547,914,000	
2130	メンバーズ	13,600	910.00	12,376,000	貸付有価証券 1,300株
2139	中広	2,000	527.00	1,054,000	
2146	U T グループ	51,900	3,215.00	166,858,500	
2148	アイティメディア	15,300	1,891.00	28,932,300	貸付有価証券 1,800株
2150	ケアネット	81,700	550.00	44,935,000	
2153	E・Jホールディングス	23,300	1,899.00	44,246,700	
2154	オープンアップグループ	119,900	1,995.00	239,200,500	
2157	コシダカホールディングス	119,500	863.00	103,128,500	貸付有価証券 4,200株
2163	アルトナー	3,100	1,949.00	6,041,900	
2168	パソナグループ	48,400	2,192.00	106,092,800	
2169	C D S	3,000	1,825.00	5,475,000	貸付有価証券 200株
2170	リンクアンドモチベーション	114,900	454.00	52,164,600	貸付有価証券 4,200株
2175	エス・エム・エス	139,800	2,049.00	286,450,200	
2180	サニーサイドアップグループ	3,700	669.00	2,475,300	
2181	パーソルホールディングス	4,063,000	220.90	897,516,700	
2183	リニカル	7,300	408.00	2,978,400	貸付有価証券 2,100株
2193	クックパッド	109,200	182.00	19,874,400	貸付有価証券 14,800株
2196	エスクリ	5,000	289.00	1,445,000	
2198	アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,000	791.00	4,746,000	貸付有価証券 900株
2301	学情	20,300	1,951.00	39,605,300	貸付有価証券 1,500株
2305	スタジオアリス	20,000	2,150.00	43,000,000	貸付有価証券 2,200株
2311	エプコ	2,800	828.00	2,318,400	
2325	N J S	8,800	3,875.00	34,100,000	
2331	総合警備保障	666,700	938.60	625,764,620	
2371	カカクコム	259,000	2,062.00	534,058,000	貸付有価証券

					600 株
2372	アイロムグループ	16,100	2,765.00	44,516,500	
2374	セントケア・ホールディング	29,000	880.00	25,520,000	
2376	サイネックス	2,200	738.00	1,623,600	貸付有価証券 700 株
2378	ルネサンス	31,000	990.00	30,690,000	
2379	ディップ	61,100	2,830.00	172,913,000	
2389	デジタルホールディングス	20,700	1,097.00	22,707,900	
2395	新日本科学	36,300	1,444.00	52,417,200	
2410	キャリアデザインセンター	2,400	1,794.00	4,305,600	
2413	エムスリー	788,700	1,531.50	1,207,894,050	貸付有価証券 27,800 株
2418	ツカダ・グローバルホールディング	8,000	473.00	3,784,000	
2424	プラス	1,400	689.00	964,600	貸付有価証券 700 株
2428	ウェルネット	9,400	644.00	6,053,600	貸付有価証券 800 株
2429	ワールドホールディングス	18,000	2,197.00	39,546,000	
2432	ディー・エヌ・エー	141,900	1,608.00	228,175,200	
2433	博報堂DYホールディングス	509,000	1,166.00	593,494,000	
2440	ぐるなび	74,400	309.00	22,989,600	貸付有価証券 7,300 株
2445	タカミヤ	54,100	497.00	26,887,700	
2461	ファンコミュニケーションズ	55,800	414.00	23,101,200	貸付有価証券 2,000 株
2462	ライク	14,900	1,521.00	22,662,900	貸付有価証券 900 株
2464	A o b a - B B T	4,600	354.00	1,628,400	
2471	エスプール	114,700	314.00	36,015,800	貸付有価証券 9,900 株
2475	WDBホールディングス	20,400	1,860.00	37,944,000	
2485	ティア	7,400	461.00	3,411,400	貸付有価証券 500 株
2487	CDG	1,400	1,324.00	1,853,600	
2489	アドウェイズ	54,900	410.00	22,509,000	貸付有価証券 7,400 株
2491	バリューコマース	35,000	1,202.00	42,070,000	貸付有価証券 2,100 株
2492	インフォマート	414,300	285.00	118,075,500	
2749	J Pホールディングス	102,000	529.00	53,958,000	
3521	エコナックホールディングス	10,700	130.00	1,391,000	貸付有価証券 3,800 株

4286	C Lホールディングス	9,400	1,284.00	12,069,600	
4290	プレステージ・インターナショナル	186,800	693.00	129,452,400	貸付有価証券 6,000株
4301	アミューズ	24,300	1,627.00	39,536,100	
4310	ドリームインキュベータ	13,700	2,064.00	28,276,800	貸付有価証券 1,800株
4318	クイック	27,700	2,175.00	60,247,500	
4319	T A C	6,100	183.00	1,116,300	
4324	電通グループ	392,300	4,070.00	1,596,661,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	17,200	980.00	16,856,000	
4337	びあ	13,600	3,130.00	42,568,000	貸付有価証券 1,200株
4343	イオンファンタジー	14,400	2,300.00	33,120,000	
4345	シーティーエス	50,400	839.00	42,285,600	貸付有価証券 1,600株
4544	H. U. グループホールディングス	116,800	2,375.50	277,458,400	貸付有価証券 11,900株
4641	アルプス技研	37,900	2,573.00	97,516,700	
4651	サニックス	63,900	301.00	19,233,900	
4658	日本空調サービス	42,900	1,108.00	47,533,200	
4661	オリエンタルランド	2,112,200	4,504.00	9,513,348,800	貸付有価証券 74,300株
4665	ダスキン	87,100	3,685.00	320,963,500	貸付有価証券 800株
4668	明光ネットワークジャパン	48,400	759.00	36,735,600	貸付有価証券 2,600株
4671	ファルコホールディングス	17,700	2,297.00	40,656,900	
4678	秀英予備校	2,800	302.00	845,600	
4679	田谷	2,100	386.00	810,600	貸付有価証券 200株
4680	ラウンドワン	376,100	809.00	304,264,900	
4681	リゾートトラスト	173,300	2,408.50	417,393,050	
4694	ビー・エム・エル	49,100	2,871.00	140,966,100	
4714	リソー教育	204,400	252.00	51,508,800	
4718	早稲田アカデミー	22,100	1,622.00	35,846,200	
4732	ユー・エス・エス	895,500	1,319.00	1,181,164,500	
4745	東京個別指導学院	47,300	413.00	19,534,900	貸付有価証券 1,500株
4751	サイバーエージェント	882,100	997.60	879,982,960	貸付有価証券 31,000株
4755	楽天グループ	3,425,600	848.00	2,904,908,800	
4763	クリーク・アンド・リバー社	20,000	1,828.00	36,560,000	貸付有価証券

					900 株
4765	S B I グローバルアセットマネジメン ト	78,100	669.00	52,248,900	
4767	テー・オー・ダブリュー	78,200	366.00	28,621,200	貸付有価証券 2,800 株
4792	山田コンサルティンググループ	17,300	2,034.00	35,188,200	
4801	セントラルスポーツ	15,000	2,539.00	38,085,000	
4848	フルキャストホールディングス	38,100	1,481.00	56,426,100	
4849	エン・ジャパン	65,000	2,605.00	169,325,000	
5261	リソルホールディングス	1,000	4,810.00	4,810,000	貸付有価証券 300 株
6028	テクノプロ・ホールディングス	233,700	2,671.00	624,212,700	貸付有価証券 600 株
6029	アトラグループ	2,900	166.00	481,400	貸付有価証券 300 株
6035	アイ・アールジャパンホールディング ス	20,700	1,215.00	25,150,500	
6036	K e e P e r 技研	24,600	4,150.00	102,090,000	貸付有価証券 4,100 株
6037	ファーストロジック	2,800	548.00	1,534,400	
6044	三機サービス	1,800	1,153.00	2,075,400	
6047	G u n o s y	31,700	786.00	24,916,200	貸付有価証券 1,800 株
6048	デザインワン・ジャパン	3,000	152.00	456,000	貸付有価証券 800 株
6050	イー・ガーディアン	19,100	1,993.00	38,066,300	
6054	リブセンス	5,700	222.00	1,265,400	貸付有価証券 3,200 株
6055	ジャパンマテリアル	122,100	2,080.00	253,968,000	
6058	ベクトル	47,700	1,238.00	59,052,600	貸付有価証券 2,100 株
6059	ウチヤマホールディングス	5,300	349.00	1,849,700	貸付有価証券 2,500 株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	33,200	1,615.00	53,618,000	貸付有価証券 1,100 株
6070	キャリアリンク	14,600	2,470.00	36,062,000	
6071	I B J	30,500	595.00	18,147,500	貸付有価証券 2,900 株
6073	アサンテ	19,700	1,755.00	34,573,500	
6078	バリューHR	34,900	1,501.00	52,384,900	貸付有価証券 1,600 株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	32,300	2,259.00	72,965,700	貸付有価証券 1,600 株
6082	ライドオンエクスプレスホールディン グス	15,800	1,040.00	16,432,000	

6083	E R I ホールディングス	3,100	2,317.00	7,182,700	貸付有価証券 500株
6087	アビスト	1,900	3,300.00	6,270,000	貸付有価証券 800株
6088	シグマックス・ホールディングス	52,300	1,510.00	78,973,000	
6089	ウィルグループ	33,400	993.00	33,166,200	貸付有価証券 200株
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	13,700	141.00	1,931,700	
6095	メドピア	31,900	622.00	19,841,800	貸付有価証券 1,200株
6096	レアジョブ	2,300	436.00	1,002,800	貸付有価証券 1,000株
6098	リクルートホールディングス	2,874,500	8,308.00	23,881,346,000	
6099	エラン	52,800	895.00	47,256,000	
6171	土木管理総合試験所	5,400	328.00	1,771,200	
6178	日本郵政	4,172,100	1,572.50	6,560,627,250	貸付有価証券 135,100株
6183	ベルシステム24ホールディングス	42,800	1,600.00	68,480,000	
6184	鎌倉新書	34,000	437.00	14,858,000	貸付有価証券 5,200株
6185	SMN	2,300	308.00	708,400	貸付有価証券 900株
6186	一蔵	1,600	579.00	926,400	
6189	グローバルキッズCOMPANY	2,000	667.00	1,334,000	貸付有価証券 400株
6191	エアトリ	29,300	1,409.00	41,283,700	貸付有価証券 1,900株
6194	アトラエ	30,100	768.00	23,116,800	
6196	ストライク	19,700	4,720.00	92,984,000	貸付有価証券 600株
6197	ソラスト	110,000	466.00	51,260,000	
6199	セラク	12,200	1,268.00	15,469,600	
6200	インソース	86,600	849.00	73,523,400	
6532	ペイカレント・コンサルティング	293,300	3,221.00	944,719,300	
6533	Orchestra Holdings	8,700	1,265.00	11,005,500	
6535	アイモバイル	50,700	475.00	24,082,500	
6538	キャリアインデックス	4,200	187.00	785,400	貸付有価証券 1,700株
6539	MS-Japan	16,300	1,048.00	17,082,400	
6540	船場	2,200	1,255.00	2,761,000	貸付有価証券 1,200株
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	129,300	2,680.00	346,524,000	

6546	フルテック	1,700	1,148.00	1,951,600	貸付有価証券 300株
6547	グリーンズ	4,500	1,932.00	8,694,000	貸付有価証券 700株
6551	ツナググループ・ホールディングス	3,400	671.00	2,281,400	貸付有価証券 500株
6552	G a m e W i t h	3,700	259.00	958,300	貸付有価証券 900株
6555	M S & C o n s u l t i n g	1,600	626.00	1,001,600	貸付有価証券 800株
6560	エル・ティー・エス	4,600	2,166.00	9,963,600	
6564	ミダックホールディングス	24,200	1,538.00	37,219,600	貸付有価証券 1,000株
6571	キュービーネットホールディングス	22,900	1,161.00	26,586,900	貸付有価証券 2,600株
6572	オープングループ	54,200	281.00	15,230,200	
7030	スプリックス	3,500	803.00	2,810,500	貸付有価証券 600株
7033	マネジメントソリューションズ	17,100	1,410.00	24,111,000	
7034	プロレド・パートナーズ	9,800	727.00	7,124,600	
7035	a n d f a c t o r y	3,600	321.00	1,155,600	貸付有価証券 1,000株
7037	テノ.ホールディングス	1,600	419.00	670,400	貸付有価証券 600株
7038	フロンティア・マネジメント	10,000	1,317.00	13,170,000	貸付有価証券 1,700株
7044	ピアラ	2,200	277.00	609,400	貸付有価証券 700株
7059	コプロ・ホールディングス	4,100	1,641.00	6,728,100	貸付有価証券 1,400株
7060	ギークス	1,600	481.00	769,600	
7071	アンビスホールディングス	85,400	2,320.00	198,128,000	貸付有価証券 1,500株
7085	カーブスホールディングス	109,000	772.00	84,148,000	貸付有価証券 3,900株
7088	フォーラムエンジニアリング	54,300	908.00	49,304,400	
7092	F a s t F i t n e s s J a p a n	13,600	1,453.00	19,760,800	貸付有価証券 1,500株
7354	ダイレクトマーケティングミックス	41,100	250.00	10,275,000	
7358	ポピンズ	5,900	1,205.00	7,109,500	
7366	L I T A L I C O	31,100	1,758.00	54,673,800	
7374	コンフィデンス・インターワークス	1,200	1,934.00	2,320,800	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	6,300	490.00	3,087,000	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	199,900	1,730.00	345,827,000	貸付有価証券 1,500株

8920	東祥	27,800	715.00	19,877,000	貸付有価証券 2,700株
9161	I D & E ホールディングス	24,100	4,395.00	105,919,500	
9216	ビーウィズ	8,200	1,834.00	15,038,800	貸付有価証券 500株
9247	T R E ホールディングス	76,400	1,268.00	96,875,200	
9248	人・夢・技術グループ	16,400	1,769.00	29,011,600	貸付有価証券 600株
9332	N I S S O ホールディングス	34,600	857.00	29,652,200	貸付有価証券 2,000株
9336	大栄環境	72,500	2,659.00	192,777,500	
9347	日本管財ホールディングス	41,900	2,741.00	114,847,900	
9552	M & A 総研ホールディングス	42,500	4,190.00	178,075,000	
9603	エイチ・アイ・エス	115,900	1,640.00	190,076,000	貸付有価証券 7,200株
9612	ラックランド	18,100	2,142.00	38,770,200	貸付有価証券 800株
9616	共立メンテナンス	125,300	2,985.00	374,020,500	
9619	イチネンホールディングス	42,300	1,700.00	71,910,000	
9621	建設技術研究所	20,600	5,020.00	103,412,000	
9622	スペース	26,100	1,129.00	29,466,900	
9628	燦ホールディングス	37,400	1,195.00	44,693,000	
9632	スバル興業	13,900	2,735.00	38,016,500	貸付有価証券 500株
9633	東京テアトル	4,600	1,127.00	5,184,200	貸付有価証券 300株
9644	タナベコンサルティンググループ	15,400	1,095.00	16,863,000	
9663	ナガワ	12,500	8,070.00	100,875,000	貸付有価証券 1,600株
9672	東京都競馬	33,400	4,020.00	134,268,000	
9675	常磐興産	4,600	1,211.00	5,570,600	
9678	カナモト	61,900	2,989.00	185,019,100	
9699	ニシオホールディングス	33,000	4,105.00	135,465,000	
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	72,100	44.00	3,172,400	貸付有価証券 27,100株
9715	トランス・コスモス	49,600	3,405.00	168,888,000	
9716	乃村工藝社	174,100	865.00	150,596,500	
9722	藤田観光	16,000	9,060.00	144,960,000	
9726	K N T - C T ホールディングス	23,800	1,352.00	32,177,600	
9729	トーカイ	35,300	2,281.00	80,519,300	
9731	白洋舎	1,200	2,465.00	2,958,000	貸付有価証券 500株

9735	セコム	406,500	9,582.00	3,895,083,000	
9740	セントラル警備保障	21,500	3,075.00	66,112,500	
9743	丹青社	77,300	1,007.00	77,841,100	
9744	メイテックグループホールディングス	135,900	3,234.00	439,500,600	
9755	応用地質	37,300	2,720.00	101,456,000	
9757	船井総研ホールディングス	79,900	2,304.00	184,089,600	
9760	進学会ホールディングス	3,300	240.00	792,000	貸付有価証券 1,200株
9765	オオバ	7,700	1,090.00	8,393,000	
9768	いであ	2,800	2,370.00	6,636,000	
9769	学究社	15,900	2,114.00	33,612,600	
9787	イオンディライト	42,800	4,020.00	172,056,000	
9788	ナック	33,800	580.00	19,604,000	
9793	ダイセキ	81,500	3,670.00	299,105,000	
9795	ステップ	14,500	1,912.00	27,724,000	
合 計		626,396,300		1,525,268,823,520	

(2)株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024 年 6 月 25 日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	24,946,819,369
コール・ローン	7,808,902,069
株式	5,822,135,315,794
投資証券	108,126,792,786
派生商品評価勘定	278,095,712
未収入金	64,553,351
未収配当金	5,709,158,156
未収利息	13,555
差入委託証拠金	78,142,420,441

流動資産合計	6,047,212,071,233
資産合計	6,047,212,071,233
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	478,282,559
未払解約金	2,660,838,782
流動負債合計	3,139,121,341
負債合計	3,139,121,341
純資産の部	
元本等	
元本	810,464,613,732
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,233,608,336,160
元本等合計	6,044,072,949,892
純資産合計	6,044,072,949,892
負債純資産合計	6,047,212,071,233

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 6月 25日現在]
1. 期首	2023年 6月 27日
期首元本額	513,699,458,357 円
期中追加設定元本額	368,062,572,882 円
期中一部解約元本額	71,297,417,507 円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	166,519,583 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	887,790,600 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	892,867,431 円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,067,704,789 円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	6,236,844,809 円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,235,617,158 円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	8,014,995,778 円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,915,798,959 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	38,541,890 円

三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	107,648,772 円
ファンド・マネジャー（海外株式）	777,008 円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,076,245,011 円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	914,869,083 円
eMAXIS バランス（波乗り型）	124,240,437 円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,620,273,745 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	189,328,583 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	265,234,551 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	247,962,878 円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	105,765,637,542 円
海外株式セレクション（ラップ向け）	2,126,964,720 円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	4,941,901,419 円
つみたて先進国株式	35,840,778,656 円
つみたて8資産均等バランス	2,466,198,150 円
つみたて4資産均等バランス	921,748,862 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,868,585 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,332,897 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7,163,685 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	161,220,753 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	216,203,381 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	154,206,354 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	59,846,368 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	496,191,450 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	1,482,011,033 円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	63,781,994,517 円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	730,299,469 円
三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）	4,957,293,996 円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	426,927,697,046 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	150,670,859 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	40,375,057 円
つみたて全世界株式	3,366,475,850 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	73,496,372 円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,448,576,681 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	66,097,700 円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	2,659,879,643 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	74,205,548 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	10,598,651 円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	17,971,677 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金）	941,698 円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	33,928,202,764 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	6,902,090,725 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	480,419,010 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,143,615,541 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	192,996,739 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	704,323,044 円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	128,378,872 円

eMAXIS バランス（４資産均等型）	379,404,925 円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	75,666,776 円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	112,726,823 円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	508,915,755 円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	434,333,852 円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	911,918,964 円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,080,146,334 円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	4,257,497 円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,628,379,435 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	26,559,407 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	534,048,788 円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	8,539,623,652 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	55,413 円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	423,471,185 円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	4,160,410,598 円
アドバンスト・バランスⅠ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	6,434,619 円
アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	44,336,907 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）	1,528,732,007 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）	463,684,703 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）	163,183,895 円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	52,856,697 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）	1,493,814,468 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）	68,314,458 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）	2,565,196,293 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）	82,874,954 円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	7,112,893,708 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）	14,197,081 円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	199,817 円
海外株式インデックスファンドS	9,079,683,331 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）	274,859,225 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）	145,901,846 円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	1,358,695 円
全世界株式（除く日本）インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	41,760,429 円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	4,776,531,798 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,965,386,007 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	585,968 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	1,426,255 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	377,095 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	1,592,087 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	19,741,373 円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	660,397 円

三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	5,631,086 円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	628,221 円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	6,594,779 円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	7,243,784,458 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）	68,454,375 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）	293,812,980 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）	331,275,052 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）	352,792,885 円
合計	810,464,613,732 円
2. 受益権の総数	810,464,613,732 円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 6 月 27 日 至 2024 年 6 月 25 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和 26 年法律第 198 号）第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 6 月 25 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 6 月 25 日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	153,982,790,981	
投資証券	2,200,016,426	
合計	156,182,807,407	

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024 年 6 月 25 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	121,952,346,960	—	121,755,810,856	△196,536,104
合計		121,952,346,960	—	121,755,810,856	△196,536,104

(注) 時価の算定方法

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

通貨関連

[2024 年 6 月 25 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	10,405,260,312	—	10,398,461,532	△6,798,780
	カナダドル	745,750,992	—	747,877,063	2,126,071
	オーストラリアドル	260,363,519	—	260,379,698	16,179
	イギリスポンド	447,817,195	—	447,946,050	128,855
	スイスフラン	360,165,816	—	360,163,984	△1,832
	香港ドル	33,248,778	—	33,169,737	△79,041
	シンガポールドル	49,892,427	—	49,900,041	7,614

	ニュージーランドドル	24,345,477	—	24,311,115	△34,362
	スウェーデンクローネ	92,692,344	—	92,723,339	30,995
	デンマーククローネ	154,589,724	—	154,706,164	116,440
	ユーロ	1,206,025,763	—	1,206,862,881	837,118
	合計	13,780,152,347	—	13,776,501,604	△3,650,743

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年6月25日現在]
1口当たり純資産額	7.4575円
(1万口当たり純資産額)	(74,575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	220,657	29.34	6,474,076.38	
	BAKER HUGHES CO	593,714	34.41	20,429,698.74	
	CHENIERE ENERGY INC	135,380	165.96	22,467,664.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	69,421	84.78	5,885,512.38	
	CHEVRON CORP	1,044,372	159.31	166,378,903.32	
	CHORD ENERGY CORP	36,000	168.90	6,080,400.00	
	CONOCOPHILLIPS	701,781	115.17	80,824,117.77	
	COTERRA ENERGY INC	444,081	27.65	12,278,839.65	
	DEVON ENERGY CORP	374,397	47.64	17,836,273.08	

DIAMONDBACK ENERGY INC	98,666	198.03	19,538,827.98
EOG RESOURCES INC	347,149	125.30	43,497,769.70
EQT CORP	253,672	38.52	9,771,445.44
EXXON MOBIL CORP	2,669,118	114.05	304,412,907.90
HALLIBURTON CO	539,772	34.34	18,535,770.48
HESS CORP	161,590	150.37	24,298,288.30
HF SINCLAIR CORP	99,576	53.81	5,358,184.56
KINDER MORGAN INC	1,193,504	20.11	24,001,365.44
MARATHON OIL CORP	355,072	28.74	10,204,769.28
MARATHON PETROLEUM CORP	214,673	173.99	37,350,955.27
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	393,509	63.25	24,889,444.25
ONEOK INC	348,473	80.89	28,187,980.97
OVINTIV INC	156,183	47.21	7,373,399.43
PHILLIPS 66	252,751	138.55	35,018,651.05
SCHLUMBERGER LTD	841,519	47.48	39,955,322.12
TARGA RESOURCES CORP	125,671	128.60	16,161,290.60
TEXAS PACIFIC LAND CORP	11,740	747.70	8,777,998.00
VALERO ENERGY CORP	196,645	150.73	29,640,300.85
WILLIAMS COS INC	726,040	43.11	31,299,584.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	132,809	270.90	35,977,958.10
ALBEMARLE CORP	72,787	96.40	7,016,666.80
AMCOR PLC	830,703	10.01	8,315,337.03
AVERY DENNISON CORP	47,408	229.52	10,881,084.16
BALL CORP	181,633	61.58	11,184,960.14
CELANESE CORP	69,532	139.05	9,668,424.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	113,599	75.60	8,588,084.40
CLEVELAND-CLIFFS INC	275,888	14.74	4,066,589.12
CORTEVA INC	413,021	52.91	21,852,941.11
CRH PLC	402,939	74.10	29,857,779.90
CROWN HOLDINGS INC	73,912	79.20	5,853,830.40
DOW INC	423,533	54.62	23,133,372.46
DUPONT DE NEMOURS INC	250,741	81.08	20,330,080.28
EASTMAN CHEMICAL CO	72,970	100.65	7,344,430.50
ECOLAB INC	153,251	244.64	37,491,324.64
FREEMPORT-MCMORAN INC	848,529	50.38	42,748,891.02
INTERNATIONAL PAPER CO	197,342	47.32	9,338,223.44

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	145,984	97.86	14,285,994.24
LINDE PLC	286,616	443.14	127,011,014.24
LYONDELLBASELL INDU-CL A	154,531	97.52	15,069,863.12
MARTIN MARIETTA MATERIALS	36,908	541.17	19,973,502.36
MOSAIC CO/THE	174,017	29.11	5,065,634.87
NEWMONT CORP	675,828	42.60	28,790,272.80
NUCOR CORP	144,492	155.56	22,477,175.52
PACKAGING CORP OF AMERICA	55,207	189.76	10,476,080.32
PPG INDUSTRIES INC	136,514	128.15	17,494,269.10
RELIANCE INC	32,720	282.10	9,230,312.00
RPM INTERNATIONAL INC	77,162	109.94	8,483,190.28
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	144,005	300.55	43,280,702.75
STEEL DYNAMICS INC	87,241	126.34	11,022,027.94
VULCAN MATERIALS CO	79,155	247.58	19,597,194.90
WESTLAKE CORP	25,469	150.46	3,832,065.74
WESTROCK CO	151,038	51.09	7,716,531.42
3M CO	326,811	102.99	33,658,264.89
AECOM	82,034	91.10	7,473,297.40
AERCAP HOLDINGS NV	120,566	93.31	11,250,013.46
ALLEGION PLC	47,118	118.39	5,578,300.02
AMETEK INC	137,964	171.46	23,655,307.44
AXON ENTERPRISE INC	43,457	292.70	12,719,863.90
BOEING CO/THE	345,680	179.10	61,911,288.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	71,496	142.22	10,168,161.12
CARLISLE COS INC	28,880	426.43	12,315,298.40
CARRIER GLOBAL CORP	484,742	64.63	31,328,875.46
CATERPILLAR INC	297,143	330.00	98,057,190.00
CNH INDUSTRIAL NV	529,492	10.20	5,400,818.40
CUMMINS INC	81,646	283.96	23,184,198.16
DEERE & CO	157,488	378.17	59,557,236.96
DOVER CORP	81,759	184.40	15,076,359.60
EATON CORP PLC	237,816	322.08	76,595,777.28
EMCOR GROUP INC	27,910	380.78	10,627,569.80
EMERSON ELECTRIC CO	340,781	109.32	37,254,178.92
FASTENAL CO	339,252	65.04	22,064,950.08
FERGUSON PLC	120,783	195.37	23,597,374.71

FORTIVE CORP	205,604	74.24	15,264,040.96	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	73,576	67.12	4,938,421.12	
GE VERNOVA INC	162,132	178.14	28,882,194.48	
GENERAL DYNAMICS CORP	139,085	298.53	41,521,045.05	
GENERAL ELECTRIC CO	650,673	160.54	104,459,043.42	
GRACO INC	105,925	79.79	8,451,755.75	
HEICO CORP	23,226	227.45	5,282,753.70	
HEICO CORP-CLASS A	47,152	178.71	8,426,533.92	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	387,958	215.89	83,756,252.62	
HOWMET AEROSPACE INC	232,071	78.63	18,247,742.73	
HUBBELL INC	31,805	379.56	12,071,905.80	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	25,628	251.20	6,437,753.60	
IDEX CORP	47,065	204.50	9,624,792.50	
ILLINOIS TOOL WORKS	178,691	242.59	43,348,649.69	
INGERSOLL-RAND INC	235,808	92.92	21,911,279.36	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	84,100	36.76	3,091,516.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	406,088	68.77	27,926,671.76	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	113,719	225.49	25,642,497.31	
LENNOX INTERNATIONAL INC	19,484	547.32	10,663,982.88	
LOCKHEED MARTIN CORP	128,990	471.51	60,820,074.90	
MASCO CORP	135,869	68.09	9,251,320.21	
NORDSON CORP	34,650	232.27	8,048,155.50	
NORTHROP GRUMMAN CORP	83,958	430.67	36,158,191.86	
OTIS WORLDWIDE CORP	241,010	96.87	23,346,638.70	
OWENS CORNING	53,631	178.24	9,559,189.44	
PACCAR INC	312,672	106.89	33,421,510.08	
PARKER HANNIFIN CORP	75,859	510.29	38,710,089.11	
PENTAIR PLC	101,158	80.00	8,092,640.00	
QUANTA SERVICES INC	87,412	274.23	23,970,992.76	
ROCKWELL AUTOMATION INC	66,320	265.87	17,632,498.40	
RTX CORP	791,396	101.96	80,690,736.16	
SMITH (A. O.) CORP	75,351	84.43	6,361,884.93	
SNAP-ON INC	31,639	267.40	8,460,268.60	
STANLEY BLACK & DECKER INC	85,688	84.74	7,261,201.12	
TEXTRON INC	113,409	87.48	9,921,019.32	
TORO CO	66,459	94.98	6,312,275.82	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	135,200	338.14	45,716,528.00	
TRANSDIGM GROUP INC	32,879	1,328.05	43,664,955.95	
UNITED RENTALS INC	40,208	645.37	25,949,036.96	
VERTIV HOLDINGS CO-A	215,191	89.14	19,182,125.74	
WABTEC CORP	102,624	162.01	16,626,114.24	
WATSCO INC	20,130	482.47	9,712,121.10	
WW GRAINGER INC	26,323	915.50	24,098,706.50	
XYLEM INC	144,817	138.34	20,033,983.78	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	244,766	249.20	60,995,687.20	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	75,179	157.22	11,819,642.38	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	71,234	201.84	14,377,870.56	
CINTAS CORP	54,425	711.00	38,696,175.00	
COPART INC	518,391	54.90	28,459,665.90	
DAYFORCE INC	81,226	50.21	4,078,357.46	
EQUIFAX INC	72,867	240.33	17,512,126.11	
JACOBS SOLUTIONS INC	74,200	142.09	10,543,078.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	76,768	148.56	11,404,654.08	
PAYCHEX INC	193,743	126.08	24,427,117.44	
PAYCOM SOFTWARE INC	35,074	145.00	5,085,730.00	
PAYLOCITY HOLDING CORP	24,837	135.10	3,355,478.70	
REPUBLIC SERVICES INC	130,386	194.66	25,380,938.76	
ROLLINS INC	176,448	49.92	8,808,284.16	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	132,756	63.13	8,380,886.28	
TRANSUNION	118,417	75.55	8,946,404.35	
VERALTO CORP	147,431	99.75	14,706,242.25	
VERISK ANALYTICS INC	85,451	271.77	23,223,018.27	
WASTE CONNECTIONS INC	153,566	175.58	26,963,118.28	
WASTE MANAGEMENT INC	239,454	212.44	50,869,607.76	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	75,471	88.49	6,678,428.79	
CSX CORP	1,166,495	33.21	38,739,298.95	
DELTA AIR LINES INC	96,256	49.40	4,755,046.40	
EXPEDITORS INTL WASH INC	85,680	126.98	10,879,646.40	
FEDEX CORP	139,441	256.51	35,768,010.91	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,217,326	3.53	4,297,160.78	
HUNT (JB) TRANSPORT SVCS INC	51,842	157.97	8,189,480.74	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	86,238	48.89	4,216,175.82	

NORFOLK SOUTHERN CORP	135,064	218.68	29,535,795.52	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	117,111	176.07	20,619,733.77	
SOUTHWEST AIRLINES CO	96,494	28.49	2,749,114.06	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	55,698	60.99	3,397,021.02	
UBER TECHNOLOGIES INC	1,116,177	70.54	78,735,125.58	
UNION PACIFIC CORP	362,529	226.36	82,062,064.44	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	433,555	138.60	60,090,723.00	
APTIV PLC	162,072	76.09	12,332,058.48	
FORD MOTOR CO	2,336,882	12.23	28,580,066.86	
GENERAL MOTORS CO	689,472	48.11	33,170,497.92	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	458,916	11.01	5,052,665.16	
TESLA INC	1,706,316	182.58	311,539,175.28	
DECKERS OUTDOOR CORP	15,095	978.08	14,764,117.60	
DR HORTON INC	179,113	144.05	25,801,227.65	
GARMIN LTD	92,146	162.29	14,954,374.34	
LENNAR CORP-A	142,731	150.66	21,503,852.46	
LULULEMON ATHLETICA INC	68,961	312.28	21,535,141.08	
NIKE INC -CL B	722,321	97.17	70,187,931.57	
NVR INC	1,822	7,740.78	14,103,701.16	
PULTEGROUP INC	124,567	112.68	14,036,209.56	
AIRBNB INC-CLASS A	263,819	148.39	39,148,101.41	
BOOKING HOLDINGS INC	20,352	3,981.20	81,025,382.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	115,054	38.99	4,485,955.46	
CARNIVAL CORP	615,701	16.39	10,091,339.39	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	16,485	3,193.74	52,648,803.90	
DARDEN RESTAURANTS INC	69,659	154.13	10,736,541.67	
DOMINO'S PIZZA INC	20,479	533.42	10,923,908.18	
DOORDASH INC - A	167,406	110.70	18,531,844.20	
DRAFTKINGS INC-CL A	259,420	40.01	10,379,394.20	
EXPEDIA GROUP INC	79,073	128.16	10,133,995.68	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	150,791	217.04	32,727,678.64	
HYATT HOTELS CORP - CL A	24,388	150.27	3,664,784.76	
LAS VEGAS SANDS CORP	225,905	44.84	10,129,580.20	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	145,398	245.66	35,718,472.68	
MCDONALD'S CORP	429,151	260.38	111,742,337.38	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	154,928	42.45	6,576,693.60	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	146,154	154.52	22,583,716.08
STARBUCKS CORP	676,535	79.73	53,940,135.55
WYNN RESORTS LTD	54,362	89.10	4,843,654.20
YUM! BRANDS INC	168,884	133.99	22,628,767.16
ALPHABET INC-CL A	3,507,171	179.22	628,555,186.62
ALPHABET INC-CL C	3,036,997	180.79	549,058,687.63
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	56,692	285.85	16,205,408.20
COMCAST CORP-CLASS A	2,362,596	38.48	90,912,694.08
ELECTRONIC ARTS INC	152,181	141.23	21,492,522.63
FOX CORP - CLASS A	120,205	34.46	4,142,264.30
FOX CORP - CLASS B	88,642	32.07	2,842,748.94
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	239,094	29.51	7,055,663.94
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	109,976	72.02	7,920,471.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	96,075	89.38	8,587,183.50
MATCH GROUP INC	170,281	30.80	5,244,654.80
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,303,990	498.91	650,573,650.90
NETFLIX INC	257,760	669.02	172,446,595.20
NEWS CORP - CLASS A	205,514	27.51	5,653,690.14
OMNICOM GROUP	113,234	90.73	10,273,720.82
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	317,208	10.29	3,264,070.32
PINTEREST INC- CLASS A	357,685	43.12	15,423,377.20
ROBLOX CORP -CLASS A	286,836	35.19	10,093,758.84
ROKU INC	78,724	54.45	4,286,521.80
SEA LTD-ADR	212,887	75.89	16,155,994.43
SNAP INC - A	613,729	15.67	9,617,133.43
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	95,193	159.71	15,203,274.03
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	266,299	95.76	25,500,792.24
WALT DISNEY CO/THE	1,092,844	101.98	111,448,231.12
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,344,492	7.31	9,828,236.52
AMAZON.COM INC	5,571,070	185.57	1,033,823,459.90
AUTOZONE INC	10,211	2,985.44	30,484,327.84
BATH & BODY WORKS INC	130,365	41.50	5,410,147.50
BEST BUY CO INC	118,391	89.33	10,575,868.03
BURLINGTON STORES INC	37,211	242.53	9,024,783.83
CARMAX INC	97,497	73.18	7,134,830.46
DICK'S SPORTING GOODS INC	33,562	229.78	7,711,876.36

EBAY INC	298,311	54.01	16,111,777.11
ETSY INC	73,449	59.95	4,403,267.55
GENUINE PARTS CO	83,745	142.05	11,895,977.25
GLOBAL-E ONLINE LTD	65,600	32.10	2,105,760.00
HOME DEPOT INC	590,039	350.88	207,032,884.32
LKQ CORP	157,065	41.97	6,592,018.05
LOWE'S COS INC	340,917	228.39	77,862,033.63
MERCADOLIBRE INC	26,855	1,582.86	42,507,705.30
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	34,821	1,083.52	37,729,249.92
POOL CORP	21,752	337.91	7,350,218.32
ROSS STORES INC	200,794	149.25	29,968,504.50
TJX COMPANIES INC	674,447	111.05	74,897,339.35
TRACTOR SUPPLY COMPANY	63,516	277.37	17,617,432.92
ULTA BEAUTY INC	29,313	389.72	11,423,862.36
WILLIAMS-SONOMA INC	36,901	307.55	11,348,902.55
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	183,466	19.79	3,630,792.14
COSTCO WHOLESALE CORP	264,499	848.16	224,337,471.84
DOLLAR GENERAL CORP	126,974	130.49	16,568,837.26
DOLLAR TREE INC	124,919	107.35	13,410,054.65
KROGER CO	409,658	50.02	20,491,093.16
SYSCO CORP	297,984	74.58	22,223,646.72
TARGET CORP	271,942	149.69	40,706,997.98
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	463,168	15.91	7,369,002.88
WALMART INC	2,634,480	68.90	181,515,672.00
ALTRIA GROUP INC	1,024,165	46.45	47,572,464.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	296,589	62.13	18,427,074.57
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	123,147	43.66	5,376,598.02
BUNGE GLOBAL SA	83,582	108.17	9,041,064.94
CAMPBELL SOUP CO	120,360	45.27	5,448,697.20
CELSIUS HOLDINGS INC	100,388	59.77	6,000,190.76
COCA-COLA CO/THE	2,445,044	63.97	156,409,464.68
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	116,740	75.97	8,868,737.80
CONAGRA BRANDS INC	284,657	29.34	8,351,836.38
CONSTELLATION BRANDS INC-A	97,400	265.13	25,823,662.00
GENERAL MILLS INC	334,850	68.07	22,793,239.50
HERSHEY CO/THE	89,177	187.30	16,702,852.10

HORMEL FOODS CORP	189,173	30.96	5,856,796.08
JM SMUCKER CO/THE	67,667	111.86	7,569,230.62
KELLANOVA	155,222	58.26	9,043,233.72
KEURIG DR PEPPER INC	648,712	34.67	22,490,845.04
KRAFT HEINZ CO/THE	539,608	33.21	17,920,381.68
LAMB WESTON HOLDINGS INC	79,379	84.95	6,743,246.05
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	148,517	69.20	10,277,376.40
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	99,682	51.40	5,123,654.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	803,762	68.42	54,993,396.04
MONSTER BEVERAGE CORP	448,501	49.49	22,196,314.49
PEPSICO INC	817,917	168.08	137,475,489.36
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	924,033	101.87	94,131,241.71
TYSON FOODS INC-CL A	165,986	57.68	9,574,072.48
CHURCH & DWIGHT CO INC	146,911	107.48	15,789,994.28
CLOROX COMPANY	70,270	136.12	9,565,152.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	466,218	98.99	46,150,919.82
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	140,245	115.13	16,146,406.85
KENVUE INC	1,154,935	18.90	21,828,271.50
KIMBERLY-CLARK CORP	197,469	139.70	27,586,419.30
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,399,438	168.45	235,735,331.10
ABBOTT LABORATORIES	1,032,489	105.30	108,721,091.70
ALIGN TECHNOLOGY INC	43,175	237.08	10,235,929.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	311,132	34.19	10,637,603.08
BECTON DICKINSON AND CO	170,891	235.91	40,314,895.81
BOSTON SCIENTIFIC CORP	873,923	76.71	67,038,633.33
CARDINAL HEALTH INC	146,172	104.90	15,333,442.80
CENCORA INC	107,448	239.36	25,718,753.28
CENTENE CORP	318,203	68.04	21,650,532.12
COOPER COS INC/THE	119,122	89.81	10,698,346.82
CVS HEALTH CORP	741,928	61.73	45,799,215.44
DAVITA INC	29,535	143.88	4,249,495.80
DEXCOM INC	230,630	110.57	25,500,759.10
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	359,436	90.17	32,410,344.12
ELEVANCE HEALTH INC	138,410	541.71	74,978,081.10
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	254,562	78.85	20,072,213.70
HCA HEALTHCARE INC	118,152	341.37	40,333,548.24

HENRY SCHEIN INC	70,861	67.27	4,766,819.47
HOLOGIC INC	144,223	72.48	10,453,283.04
HUMANA INC	71,884	358.04	25,737,347.36
IDEXX LABORATORIES INC	49,687	491.49	24,420,663.63
INSULET CORP	41,321	203.94	8,427,004.74
INTUITIVE SURGICAL INC	211,086	429.04	90,564,337.44
LABCORP HOLDINGS INC	50,788	208.00	10,563,904.00
MCKESSON CORP	78,196	607.81	47,528,310.76
MEDTRONIC PLC	792,145	81.04	64,195,430.80
MOLINA HEALTHCARE INC	35,487	308.98	10,964,773.26
QUEST DIAGNOSTICS INC	68,501	140.23	9,605,895.23
RESMED INC	88,892	182.20	16,196,122.40
SOLVENTUM CORP	89,642	51.30	4,598,634.60
STERIS PLC	59,503	216.56	12,885,969.68
STRYKER CORP	203,677	339.07	69,060,760.39
TELEFLEX INC	29,262	200.73	5,873,761.26
THE CIGNA GROUP	169,038	343.14	58,003,699.32
UNITEDHEALTH GROUP INC	548,652	489.98	268,828,506.96
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	31,888	191.01	6,090,926.88
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	88,545	186.70	16,531,351.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	117,535	108.46	12,747,846.10
ABBVIE INC	1,054,544	172.74	182,161,930.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	175,421	135.08	23,695,868.68
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	73,985	222.90	16,491,256.50
AMGEN INC	319,406	318.15	101,619,018.90
AVANTOR INC	389,080	22.50	8,754,300.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	11,720	283.88	3,327,073.60
BIO-TECHNE CORP	96,405	74.49	7,181,208.45
BIOGEN INC	86,956	226.60	19,704,229.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	118,650	85.14	10,101,861.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,211,235	42.23	51,150,454.05
CATALENT INC	109,349	56.47	6,174,938.03
CHARLES RIVER LABORATORIES	29,813	209.85	6,256,258.05
DANAHER CORP	418,877	256.76	107,550,858.52
ELI LILLY & CO	480,913	890.11	428,065,470.43
EXACT SCIENCES CORP	103,405	41.95	4,337,839.75

GILEAD SCIENCES INC	745,108	70.73	52,701,488.84
ILLUMINA INC	91,078	110.24	10,040,438.72
INCYTE CORP	115,210	63.75	7,344,637.50
IQVIA HOLDINGS INC	107,104	214.09	22,929,895.36
JOHNSON & JOHNSON	1,432,762	149.12	213,653,469.44
MERCK & CO. INC.	1,506,810	132.96	200,345,457.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12,868	1,453.98	18,709,814.64
MODERNA INC	190,577	137.00	26,109,049.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	60,837	133.62	8,129,039.94
PFIZER INC	3,366,652	28.36	95,478,250.72
REGENERON PHARMACEUTICALS	64,363	1,063.89	68,475,152.07
REPLIGEN CORP	27,634	123.65	3,416,944.10
REVVITY INC	76,788	106.90	8,208,637.20
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	208,355	27.11	5,648,504.05
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	671,525	16.49	11,073,447.25
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	227,234	565.95	128,603,082.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	24,588	318.94	7,842,096.72
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	153,999	474.95	73,141,825.05
VIATRIS INC	726,962	10.47	7,611,292.14
WATERS CORP	35,175	289.27	10,175,072.25
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	43,055	331.00	14,251,205.00
ZOETIS INC	270,463	171.84	46,476,361.92
BANK OF AMERICA CORP	4,228,403	40.02	169,220,688.06
CITIGROUP INC	1,142,740	61.34	70,095,671.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	256,640	35.39	9,082,489.60
FIFTH THIRD BANCORP	394,016	36.64	14,436,746.24
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	6,156	1,640.93	10,101,565.08
HUNTINGTON BANCSHARES INC	909,206	12.98	11,801,493.88
JPMORGAN CHASE & CO	1,708,697	198.88	339,825,659.36
KEYCORP	568,234	13.92	7,909,817.28
M & T BANK CORP	100,291	149.59	15,002,530.69
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	237,992	154.90	36,864,960.80
REGIONS FINANCIAL CORP	526,791	19.31	10,172,334.21
TRUIST FINANCIAL CORP	802,257	37.46	30,052,547.22
US BANCORP	918,645	40.55	37,251,054.75
WELLS FARGO & CO	2,106,901	59.01	124,328,228.01

ALLY FINANCIAL INC	150,075	40.40	6,063,030.00
AMERICAN EXPRESS CO	342,915	231.47	79,374,535.05
AMERIPRISE FINANCIAL INC	59,388	440.35	26,151,505.80
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	314,765	20.17	6,348,810.05
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	238,294	118.28	28,185,414.32
ARES MANAGEMENT CORP - A	108,433	133.85	14,513,757.05
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	451,190	59.48	26,836,781.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	780,398	413.98	323,069,164.04
BLACKROCK INC	88,687	798.95	70,856,478.65
BLACKSTONE INC	421,522	125.26	52,799,845.72
BLOCK INC	333,864	64.40	21,500,841.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	228,788	137.68	31,499,531.84
CARLYLE GROUP INC/THE	126,277	40.47	5,110,430.19
CBOE GLOBAL MARKETS INC	62,382	171.33	10,687,908.06
CME GROUP INC	214,666	195.08	41,877,043.28
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	111,163	212.31	23,601,016.53
COREBRIDGE FINANCIAL INC	135,682	29.55	4,009,403.10
CORPAY INC	40,935	269.67	11,038,941.45
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	147,039	127.67	18,772,469.13
EQUITABLE HOLDINGS INC	194,443	41.43	8,055,773.49
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	21,946	424.89	9,324,635.94
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	345,987	75.55	26,139,317.85
FISERV INC	352,483	150.27	52,967,620.41
FRANKLIN RESOURCES INC	152,703	23.17	3,538,128.51
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	37,000	69.46	2,570,020.00
GLOBAL PAYMENTS INC	151,430	97.04	14,694,767.20
GOLDMAN SACHS GROUP INC	193,365	462.09	89,352,032.85
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	341,231	138.72	47,335,564.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	46,021	166.43	7,659,275.03
KKR & CO INC	370,316	107.47	39,797,860.52
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	42,069	277.68	11,681,719.92
MARKETAXESS HOLDINGS INC	23,552	196.29	4,623,022.08
MASTERCARD INC - A	495,140	456.96	226,259,174.40
MOODY'S CORP	96,730	425.64	41,172,157.20
MORGAN STANLEY	731,364	97.10	71,015,444.40
MSCI INC	47,493	489.16	23,231,675.88

NASDAQ INC	240,048	60.10	14,426,884.80
NORTHERN TRUST CORP	120,683	83.51	10,078,237.33
PAYPAL HOLDINGS INC	587,337	59.49	34,940,678.13
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	119,700	122.38	14,648,886.00
ROBINHOOD MARKETS INC - A	320,415	21.37	6,847,268.55
S&P GLOBAL INC	191,130	444.97	85,047,116.10
SCHWAB (CHARLES) CORP	898,470	74.53	66,962,969.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	60,138	66.68	4,010,001.84
STATE STREET CORP	173,980	72.94	12,690,101.20
SYNCHRONY FINANCIAL	247,847	45.52	11,281,995.44
T ROWE PRICE GROUP INC	135,044	118.88	16,054,030.72
TOAST INC-CLASS A	214,297	25.59	5,483,860.23
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	69,891	104.40	7,296,620.40
VISA INC-CLASS A SHARES	940,343	276.30	259,816,770.90
AFLAC INC	327,985	90.43	29,659,683.55
ALLSTATE CORP	157,040	162.41	25,504,866.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	45,623	126.53	5,772,678.19
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	406,176	76.01	30,873,437.76
AON PLC-CLASS A	118,302	298.46	35,308,414.92
ARCH CAPITAL GROUP LTD	223,535	102.43	22,896,690.05
ARTHUR J GALLAGHER & CO	128,171	265.19	33,989,667.49
ASSURANT INC	28,492	169.24	4,821,986.08
BROWN & BROWN INC	142,201	93.34	13,273,041.34
CHUBB LTD	239,010	266.12	63,605,341.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	89,731	116.61	10,463,531.91
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	15,257	362.33	5,528,068.81
EVEREST GROUP LTD	26,294	382.01	10,044,570.94
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	152,029	49.78	7,568,003.62
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	176,597	104.42	18,440,258.74
LOEWS CORP	113,501	77.33	8,777,032.33
MARKEL GROUP INC	7,876	1,591.99	12,538,513.24
MARSH & MCLENNAN COS	292,084	215.75	63,017,123.00
METLIFE INC	363,442	72.12	26,211,437.04
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	142,164	80.83	11,491,116.12
PROGRESSIVE CORP	348,076	210.68	73,332,651.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	211,962	119.16	25,257,391.92

TRAVELERS COS INC/THE	135,279	211.09	28,556,044.11
WILLIS TOWERS WATSON PLC	61,066	266.44	16,270,425.04
WR BERKLEY CORP	123,178	80.84	9,957,709.52
ACCENTURE PLC-CL A	374,425	307.21	115,027,104.25
ADOBE INC	266,796	524.17	139,846,459.32
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	90,523	88.74	8,033,011.02
ANSYS INC	50,694	321.10	16,277,843.40
APPLOVIN CORP-CLASS A	102,190	78.05	7,975,929.50
ASPEN TECHNOLOGY INC	16,366	200.03	3,273,690.98
ATLASSIAN CORP-CL A	94,500	164.75	15,568,875.00
AUTODESK INC	128,581	239.17	30,752,717.77
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	115,702	50.37	5,827,909.74
CADENCE DESIGN SYS INC	160,465	309.14	49,606,150.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	53,285	155.98	8,311,394.30
CLOUDFLARE INC - CLASS A	180,968	78.60	14,224,084.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	288,979	68.68	19,847,077.72
CONFLUENT INC-CLASS A	134,592	27.34	3,679,745.28
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	135,382	377.93	51,164,919.26
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	25,510	261.34	6,666,783.40
DATADOG INC - CLASS A	163,948	118.49	19,426,198.52
DOCUSIGN INC	117,791	51.69	6,088,616.79
DYNATRACE INC	162,872	43.85	7,141,937.20
EPAM SYSTEMS INC	36,092	183.09	6,608,084.28
FAIR ISAAC CORP	14,910	1,441.50	21,492,765.00
FORTINET INC	388,884	58.28	22,664,159.52
GARTNER INC	46,386	451.09	20,924,260.74
GEN DIGITAL INC	348,898	24.08	8,401,463.84
GODADDY INC - CLASS A	83,207	138.41	11,516,680.87
HUBSPOT INC	27,985	573.60	16,052,196.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	545,782	175.01	95,517,307.82
INTUIT INC	166,912	623.88	104,133,058.56
MANHATTAN ASSOCIATES INC	38,101	241.47	9,200,438.97
MICROSOFT CORP	4,201,504	447.67	1,880,887,295.68
MICROSTRATEGY INC-CL A	9,234	1,372.15	12,670,433.10
MONDAY.COM LTD	23,133	221.68	5,128,123.44
MONGODB INC	40,846	233.92	9,554,696.32

OKTA INC	92,998	88.35	8,216,373.30	
ORACLE CORP	981,611	139.89	137,317,562.79	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,112,329	24.16	26,873,868.64	
PALO ALTO NETWORKS INC	192,764	316.68	61,044,503.52	
PTC INC	73,716	177.60	13,091,961.60	
ROPER TECHNOLOGIES INC	63,789	562.55	35,884,501.95	
SALESFORCE INC	578,191	239.94	138,731,148.54	
SAMSARA INC-CL A	124,341	29.42	3,658,112.22	
SERVICENOW INC	122,298	739.59	90,450,377.82	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	176,268	124.80	21,998,246.40	
SYNOPSYS INC	91,026	595.60	54,215,085.60	
TWILIO INC - A	101,280	54.81	5,551,156.80	
TYLER TECHNOLOGIES INC	24,361	491.57	11,975,136.77	
UIPATH INC - CLASS A	282,330	12.03	3,396,429.90	
UNITY SOFTWARE INC	132,776	16.70	2,217,359.20	
VERISIGN INC	55,384	180.00	9,969,120.00	
WIX.COM LTD	30,341	158.05	4,795,395.05	
WORKDAY INC-CLASS A	126,499	218.70	27,665,331.30	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	140,544	57.81	8,124,848.64	
ZSCALER INC	53,450	181.06	9,677,657.00	
AMPHENOL CORP-CL A	710,442	67.27	47,791,433.34	
APPLE INC	8,728,915	208.14	1,816,836,368.10	
ARISTA NETWORKS INC	158,924	329.21	52,319,370.04	
CDW CORP/DE	81,099	231.61	18,783,339.39	
CISCO SYSTEMS INC	2,407,847	47.28	113,843,006.16	
CORNING INC	475,112	39.90	18,956,968.80	
DELL TECHNOLOGIES -C	153,369	137.56	21,097,439.64	
F5 INC	35,964	168.68	6,066,407.52	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	782,384	20.47	16,015,400.48	
HP INC	575,014	36.30	20,873,008.20	
JABIL INC	73,665	112.98	8,322,671.70	
JUNIPER NETWORKS INC	197,588	35.54	7,022,277.52	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	102,332	136.91	14,010,274.12	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	99,146	388.16	38,484,511.36	
NETAPP INC	121,738	126.38	15,385,248.44	
PURE STORAGE INC - CLASS A	183,656	62.82	11,537,269.92	

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	116,599	103.33	12,048,174.67
SUPER MICRO COMPUTER INC	31,536	826.98	26,079,641.28
TE CONNECTIVITY LTD	184,908	151.10	27,939,598.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	27,598	391.23	10,797,165.54
TRIMBLE INC	149,329	56.13	8,381,836.77
WESTERN DIGITAL CORP	188,209	75.40	14,190,958.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30,509	306.71	9,357,415.39
AT&T INC	4,256,103	18.65	79,376,320.95
T-MOBILE US INC	317,516	177.95	56,501,972.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,502,006	41.17	103,007,587.02
AES CORP	433,324	18.99	8,228,822.76
ALLIANT ENERGY CORP	149,496	51.13	7,643,730.48
AMEREN CORPORATION	162,603	71.15	11,569,203.45
AMERICAN ELECTRIC POWER	308,886	88.14	27,225,212.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	118,652	132.18	15,683,421.36
ATMOS ENERGY CORP	91,064	118.02	10,747,373.28
CENTERPOINT ENERGY INC	388,890	31.31	12,176,145.90
CMS ENERGY CORP	173,174	60.77	10,523,783.98
CONSOLIDATED EDISON INC	202,194	91.27	18,454,246.38
CONSTELLATION ENERGY	187,933	216.10	40,612,321.30
DOMINION ENERGY INC	493,643	49.90	24,632,785.70
DTE ENERGY COMPANY	125,990	112.80	14,211,672.00
DUKE ENERGY CORP	459,439	101.51	46,637,652.89
EDISON INTERNATIONAL	229,651	72.76	16,709,406.76
ENTERGY CORP	127,518	107.73	13,737,514.14
ESSENTIAL UTILITIES INC	146,859	37.94	5,571,830.46
EVERGY INC	138,949	53.37	7,415,708.13
EVERSOURCE ENERGY	211,633	58.00	12,274,714.00
EXELON CORP	590,677	35.33	20,868,618.41
FIRSTENERGY CORP	313,958	38.50	12,087,383.00
NEXTERA ENERGY INC	1,222,266	73.85	90,264,344.10
NISOURCE INC	260,713	28.88	7,529,391.44
NRG ENERGY INC	127,510	81.56	10,399,715.60
P G & E CORP	1,215,697	17.71	21,529,993.87
PPL CORP	421,673	28.17	11,878,528.41
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	292,361	74.75	21,853,984.75

	SEMPRA	378,840	76.45	28,962,318.00	
	SOUTHERN CO/THE	657,671	79.34	52,179,617.14	
	VISTRA CORP	205,590	88.23	18,139,205.70	
	WEC ENERGY GROUP INC	192,004	79.35	15,235,517.40	
	XCEL ENERGY INC	322,605	53.98	17,414,217.90	
	ADVANCED MICRO DEVICES	962,927	160.25	154,309,051.75	
	ANALOG DEVICES INC	296,054	228.46	67,636,496.84	
	APPLIED MATERIALS INC	494,538	229.84	113,664,613.92	
	BROADCOM INC	262,023	1,592.21	417,195,640.83	
	ENPHASE ENERGY INC	80,001	108.02	8,641,708.02	
	ENTEGRIS INC	85,564	131.31	11,235,408.84	
	FIRST SOLAR INC	59,428	261.28	15,527,347.84	
	INTEL CORP	2,537,652	30.57	77,576,021.64	
	KLA CORP	80,558	793.98	63,961,440.84	
	LAM RESEARCH CORP	78,086	1,024.42	79,992,860.12	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	84,503	56.65	4,787,094.95	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	510,365	67.77	34,587,436.05	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	323,701	89.18	28,867,655.18	
	MICRON TECHNOLOGY INC	659,734	139.01	91,709,623.34	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	28,696	798.14	22,903,425.44	
	NVIDIA CORP	14,876,050	118.11	1,757,010,265.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	150,918	267.27	40,335,853.86	
	ON SEMICONDUCTOR	247,439	67.79	16,773,889.81	
	QORVO INC	59,269	113.53	6,728,809.57	
	QUALCOMM INC	664,476	200.84	133,453,359.84	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	96,505	104.96	10,129,164.80	
	TERADYNE INC	92,007	145.53	13,389,778.71	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	541,742	193.91	105,049,191.22	
	CBRE GROUP INC - A	184,948	89.26	16,508,458.48	
	COSTAR GROUP INC	245,565	74.36	18,260,213.40	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	487,100	3.21	1,563,591.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	82,122	47.02	3,861,376.44	
	アメリカドル 小計	215,716,093		27,810,557,333.61 (4,437,452,528,150)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	376,000	24.85	9,343,600.00	
	CAMECO CORP	253,500	68.89	17,463,615.00	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	1, 262, 600	48. 73	61, 526, 498. 00	
CENOVUS ENERGY INC	801, 500	26. 31	21, 087, 465. 00	
ENBRIDGE INC	1, 270, 900	47. 97	60, 965, 073. 00	
IMPERIAL OIL LTD	106, 800	93. 95	10, 033, 860. 00	
KEYERA CORP	124, 900	36. 72	4, 586, 328. 00	
MEG ENERGY CORP	137, 000	28. 96	3, 967, 520. 00	
PARKLAND CORP	89, 200	37. 67	3, 360, 164. 00	
PEMBINA PIPELINE CORP	351, 932	50. 02	17, 603, 638. 64	
SUNCOR ENERGY INC	769, 600	51. 77	39, 842, 192. 00	
TC ENERGY CORP	616, 300	53. 39	32, 904, 257. 00	
TOURMALINE OIL CORP	200, 400	62. 88	12, 601, 152. 00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	303, 140	89. 69	27, 188, 626. 60	
BARRICK GOLD CORP	993, 700	22. 83	22, 686, 171. 00	
CCL INDUSTRIES INC – CL B	82, 500	72. 21	5, 957, 325. 00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	400, 400	18. 18	7, 279, 272. 00	
FRANCO-NEVADA CORP	116, 100	161. 75	18, 779, 175. 00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	418, 900	18. 04	7, 556, 956. 00	
KINROSS GOLD CORP	677, 600	10. 46	7, 087, 696. 00	
LUNDIN MINING CORP	362, 100	15. 06	5, 453, 226. 00	
NUTRIEN LTD	298, 559	71. 89	21, 463, 406. 51	
PAN AMERICAN SILVER CORP	243, 300	27. 70	6, 739, 410. 00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	276, 400	65. 82	18, 192, 648. 00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	26, 600	105. 80	2, 814, 280. 00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	278, 000	72. 84	20, 249, 520. 00	
CAE INC	166, 100	26. 38	4, 381, 718. 00	
STANTEC INC	65, 700	113. 60	7, 463, 520. 00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	49, 100	119. 25	5, 855, 175. 00	
WSP GLOBAL INC	74, 400	211. 45	15, 731, 880. 00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	211, 400	23. 95	5, 063, 030. 00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	120, 300	51. 73	6, 223, 119. 00	
RB GLOBAL INC	111, 800	106. 88	11, 949, 184. 00	
THOMSON REUTERS CORP	93, 932	225. 74	21, 204, 209. 68	
AIR CANADA	62, 200	17. 01	1, 058, 022. 00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	320, 800	161. 58	51, 834, 864. 00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	551, 700	108. 90	60, 080, 130. 00	
TFI INTERNATIONAL INC	48, 600	191. 40	9, 302, 040. 00	

MAGNA INTERNATIONAL INC	162,200	58.16	9,433,552.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	89.16	1,399,812.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	74,300	52.20	3,878,460.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	181,010	95.85	17,349,808.50
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	34,500	138.28	4,770,660.00
DOLLARAMA INC	168,100	126.06	21,190,686.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	458,500	78.42	35,955,570.00
EMPIRE CO LTD 'A'	108,000	34.46	3,721,680.00
LOBLAW COMPANIES LTD	92,800	156.50	14,523,200.00
METRO INC/CN	149,700	75.53	11,306,841.00
WESTON (GEORGE) LTD	36,011	193.94	6,983,973.34
SAPUTO INC	150,300	30.20	4,539,060.00
BANK OF MONTREAL	432,200	116.40	50,308,080.00
BANK OF NOVA SCOTIA	723,800	62.84	45,483,592.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	561,500	66.15	37,143,225.00
NATIONAL BANK OF CANADA	191,700	106.72	20,458,224.00
ROYAL BANK OF CANADA	837,900	145.10	121,579,290.00
TORONTO-DOMINION BANK	1,052,900	75.41	79,399,189.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	221,588	52.30	11,589,052.40
BROOKFIELD CORP	810,950	56.63	45,924,098.50
IGM FINANCIAL INC	39,400	38.34	1,510,596.00
ONEX CORPORATION	41,700	97.00	4,044,900.00
TMX GROUP LTD	176,300	38.00	6,699,400.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12,000	1,525.05	18,300,600.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	176,800	39.09	6,911,112.00
IA FINANCIAL CORP INC	58,800	86.09	5,062,092.00
INTACT FINANCIAL CORP	104,300	227.79	23,758,497.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,075,300	35.79	38,484,987.00
POWER CORP OF CANADA	361,500	38.28	13,838,220.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	355,700	67.07	23,856,799.00
CGI INC	125,700	136.08	17,105,256.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	12,000	3,848.34	46,180,080.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	50,600	129.13	6,533,978.00
OPEN TEXT CORP	144,900	40.12	5,813,388.00
SHOPIFY INC - CLASS A	722,300	87.82	63,432,386.00
BCE INC	57,900	45.41	2,629,239.00

	QUEBECOR INC -CL B	98,000	28.96	2,838,080.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	217,400	51.93	11,289,582.00	
	TELUS CORP	231,200	21.64	5,003,168.00	
	ALTAGAS LTD	172,600	30.48	5,260,848.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	94,950	40.29	3,825,535.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	29.88	1,747,980.00	
	EMERA INC	160,600	45.98	7,384,388.00	
	FORTIS INC	299,500	53.78	16,107,110.00	
	HYDRO ONE LTD	199,400	39.32	7,840,408.00	
	NORTHLAND POWER INC	148,200	23.70	3,512,340.00	
	FIRSTSERVICE CORP	24,100	208.36	5,021,476.00	
カナダドル 小計		24,397,272		1,567,810,465.67 (183,182,974,808)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	168,058	32.21	5,413,148.18	
	SANTOS LTD	1,889,577	7.50	14,171,827.50	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,140,450	26.97	30,757,936.50	
	BHP GROUP LTD	3,015,593	42.43	127,951,610.99	
	BLUESCOPE STEEL LTD	246,529	19.61	4,834,433.69	
	FORTESCUE LTD	1,019,659	21.26	21,677,950.34	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	263,533	47.44	12,502,005.52	
	MINERAL RESOURCES LTD	95,706	54.76	5,240,860.56	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	728,362	13.45	9,796,468.90	
	ORICA LTD	302,423	17.82	5,389,177.86	
	PILBARA MINERALS LTD	1,540,998	3.11	4,792,503.78	
	RIO TINTO LTD	221,957	118.99	26,410,663.43	
	SOUTH32 LTD	2,760,848	3.64	10,049,486.72	
	REECE LTD	130,639	25.81	3,371,792.59	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	123,115	37.57	4,625,430.55	
	BRAMBLES LTD	859,720	14.36	12,345,579.20	
	COMPUTERSHARE LTD	288,146	26.55	7,650,276.30	
	AURIZON HOLDINGS LTD	1,366,902	3.66	5,002,861.32	
	QANTAS AIRWAYS LTD	658,092	6.06	3,988,037.52	
	TRANSURBAN GROUP	1,818,456	12.68	23,058,022.08	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	342,680	49.01	16,794,746.80	
	LOTTERY CORP LTD/THE	1,165,622	5.15	6,002,953.30	
	CAR GROUP LTD	236,772	34.04	8,059,718.88	

	REA GROUP LTD	32,440	197.29	6,400,087.60	
	SEEK LTD	199,466	21.97	4,382,268.02	
	WESFARMERS LTD	678,072	65.30	44,278,101.60	
	COLES GROUP LTD	806,840	17.10	13,796,964.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	801,622	5.07	4,064,223.54	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	700,223	33.43	23,408,454.89	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	476,918	12.42	5,923,321.56	
	COCHLEAR LTD	38,183	323.75	12,361,746.25	
	PRO MEDICUS LTD	38,535	141.15	5,439,215.25	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	129,562	47.83	6,196,950.46	
	SONIC HEALTHCARE LTD	252,714	26.54	6,707,029.56	
	CSL LTD	285,352	292.01	83,325,637.52	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,764,829	28.65	50,562,350.85	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	993,419	126.80	125,965,529.20	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,842,771	35.96	66,266,045.16	
	WESTPAC BANKING CORP	2,064,259	27.15	56,044,631.85	
	ASX LTD	113,672	58.06	6,599,796.32	
	MACQUARIE GROUP LTD	213,218	199.27	42,487,950.86	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	138,803	33.25	4,615,199.75	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,429,616	6.68	9,549,834.88	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	1,517,475	3.70	5,614,657.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	894,442	17.57	15,715,345.94	
	SUNCORP GROUP LTD	763,385	16.64	12,702,726.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	104,309	94.14	9,819,649.26	
	XERO LTD	89,163	131.33	11,709,776.79	
	TELSTRA GROUP LTD	2,180,806	3.62	7,894,517.72	
	APA GROUP	737,148	8.39	6,184,671.72	
	ORIGIN ENERGY LTD	1,048,250	10.66	11,174,345.00	
	オーストラリアドル 小計	40,719,329		1,029,078,521.96 (109,257,266,676)	
イギリスポンド	BP PLC	10,042,778	4.74	47,617,831.88	
	SHELL PLC	3,813,474	27.94	106,567,530.93	
	ANGLO AMERICAN PLC	757,736	25.00	18,943,400.00	
	ANTOFAGASTA PLC	229,746	21.21	4,872,912.66	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	81,986	40.98	3,359,786.28	
	ENDEAVOUR MINING PLC	106,898	16.83	1,799,093.34	

GLENCORE PLC	6, 205, 618	4. 59	28, 514, 814. 71
MONDI PLC	239, 805	15. 05	3, 609, 065. 25
RIO TINTO PLC	672, 931	52. 28	35, 180, 832. 68
ASHTED GROUP PLC	262, 395	54. 94	14, 415, 981. 30
BAE SYSTEMS PLC	1, 805, 714	13. 52	24, 422, 281. 85
BUNZL PLC	205, 485	30. 54	6, 275, 511. 90
DCC PLC	56, 482	56. 40	3, 185, 584. 80
MELROSE INDUSTRIES PLC	818, 590	5. 81	4, 760, 919. 44
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	5, 032, 000	4. 71	23, 715, 816. 00
SMITHS GROUP PLC	180, 764	17. 25	3, 118, 179. 00
SPIRAX GROUP PLC	46, 237	87. 30	4, 036, 490. 10
EXPERIAN PLC	539, 897	36. 87	19, 906, 002. 39
INTERTEK GROUP PLC	105, 981	47. 78	5, 063, 772. 18
RELX PLC	1, 109, 011	36. 12	40, 057, 477. 32
RENTOKIL INITIAL PLC	1, 426, 851	4. 57	6, 532, 123. 87
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	519, 922	4. 75	2, 473, 788. 87
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	65, 065	46. 32	3, 013, 810. 80
BURBERRY GROUP PLC	223, 981	10. 18	2, 280, 126. 58
PERSIMMON PLC	218, 440	13. 65	2, 982, 798. 20
TAYLOR WIMPEY PLC	2, 505, 525	1. 44	3, 607, 956. 00
COMPASS GROUP PLC	1, 021, 422	22. 44	22, 920, 709. 68
ENTAIN PLC	406, 322	6. 70	2, 722, 357. 40
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	102, 844	146. 00	15, 015, 224. 00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	99, 456	83. 38	8, 292, 641. 28
PEARSON PLC	322, 789	9. 75	3, 149, 775. 06
WHITBREAD PLC	109, 945	29. 61	3, 255, 471. 45
AUTO TRADER GROUP PLC	520, 853	8. 04	4, 190, 783. 23
INFORMA PLC	861, 202	8. 68	7, 482, 122. 97
WPP PLC	695, 292	7. 65	5, 320, 374. 38
JD SPORTS FASHION PLC	1, 458, 356	1. 29	1, 895, 133. 62
KINGFISHER PLC	1, 064, 697	2. 47	2, 632, 995. 68
NEXT PLC	73, 640	92. 92	6, 842, 628. 80
SAINSBURY (J) PLC	864, 017	2. 60	2, 248, 172. 23
TESCO PLC	4, 258, 271	3. 08	13, 132, 507. 76
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	178, 973	25. 19	4, 508, 329. 87
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1, 204, 346	25. 35	30, 530, 171. 10

COCA-COLA HBC AG-DI	139,727	27.30	3,814,547.10	
DIAGEO PLC	1,331,181	25.78	34,317,846.18	
IMPERIAL BRANDS PLC	475,337	20.64	9,810,955.68	
HALEON PLC	4,003,569	3.34	13,383,931.16	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	416,618	44.44	18,514,503.92	
UNILEVER PLC	1,493,327	44.37	66,258,918.99	
SMITH & NEPHEW PLC	543,981	9.96	5,419,138.72	
ASTRAZENECA PLC	923,057	124.78	115,179,052.46	
GSK PLC	2,469,279	16.08	39,718,352.71	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	106,917	19.79	2,115,887.43	
BARCLAYS PLC	8,918,202	2.07	18,509,728.25	
HSBC HOLDINGS PLC	11,248,200	6.90	77,691,317.40	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	37,636,137	0.55	20,955,801.08	
NATWEST GROUP PLC	3,865,885	3.15	12,204,598.94	
STANDARD CHARTERED PLC	1,327,549	7.31	9,715,003.58	
3I GROUP PLC	579,549	31.28	18,128,292.72	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	208,222	11.39	2,372,689.69	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	266,746	96.26	25,676,969.96	
M&G PLC	1,211,540	2.09	2,534,541.68	
SCHRODERS PLC	465,209	3.78	1,760,350.85	
WISE PLC - A	378,893	6.86	2,601,100.44	
ADMIRAL GROUP PLC	145,253	25.69	3,731,549.57	
AVIVA PLC	1,654,734	4.84	8,013,876.76	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,703,509	2.30	8,532,884.73	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	427,896	5.25	2,248,593.48	
PRUDENTIAL PLC	1,664,062	7.59	12,630,230.58	
SAGE GROUP PLC/THE	595,993	10.66	6,356,265.34	
HALMA PLC	207,364	27.02	5,602,975.28	
BT GROUP PLC	3,495,838	1.45	5,070,713.01	
VODAFONE GROUP PLC	13,899,367	0.72	10,049,242.34	
CENTRICA PLC	2,862,357	1.37	3,927,153.80	
NATIONAL GRID PLC	2,885,560	8.88	25,646,857.28	
SEVERN TRENT PLC	147,941	24.74	3,660,060.34	
SSE PLC	627,105	18.26	11,450,937.30	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	433,205	10.14	4,394,864.72	
イギリスポンド 小計	161,275,046		1,166,453,020.31	

				(236, 171, 743, 022)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99, 007	14. 00	1, 386, 098. 00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4, 820	747. 00	3, 600, 540. 00	
	GIVAUDAN-REG	5, 530	4, 349. 00	24, 049, 970. 00	
	HOLCIM LTD	309, 438	78. 78	24, 377, 525. 64	
	SIG GROUP AG	180, 750	16. 64	3, 007, 680. 00	
	SIKA AG-REG	91, 127	257. 20	23, 437, 864. 40	
	ABB LTD-REG	952, 476	50. 12	47, 738, 097. 12	
	GEBERIT AG-REG	20, 321	547. 40	11, 123, 715. 40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	15, 651	230. 50	3, 607, 555. 50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22, 674	234. 00	5, 305, 716. 00	
	VAT GROUP AG	16, 784	501. 40	8, 415, 497. 60	
	ADECCO GROUP AG-REG	89, 253	31. 28	2, 791, 833. 84	
	SGS SA-REG	92, 854	80. 30	7, 456, 176. 20	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	28, 395	259. 00	7, 354, 305. 00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	317, 275	140. 50	44, 577, 137. 50	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	19, 981	192. 50	3, 846, 342. 50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	26, 795	38. 10	1, 020, 889. 50	
	AVOLTA AG	58, 100	36. 60	2, 126, 460. 00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1, 816	1, 566. 00	2, 843, 856. 00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	516	10, 940. 00	5, 645, 040. 00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	69	107, 600. 00	7, 424, 400. 00	
	NESTLE SA-REG	1, 591, 107	94. 68	150, 646, 010. 76	
	ALCON INC	299, 150	80. 80	24, 171, 320. 00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	30, 986	273. 20	8, 465, 375. 20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	65, 136	108. 35	7, 057, 485. 60	
	BACHEM HOLDING AG	21, 842	79. 30	1, 732, 070. 60	
	LONZA GROUP AG-REG	44, 644	487. 10	21, 746, 092. 40	
	NOVARTIS AG-REG	1, 172, 563	96. 01	112, 577, 773. 63	
	ROCHE HOLDING AG-BR	17, 136	279. 00	4, 780, 944. 00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	420, 906	255. 40	107, 499, 392. 40	
	SANDOZ GROUP AG	237, 909	32. 13	7, 644, 016. 17	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	14, 828	96. 75	1, 434, 609. 00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	123, 773	51. 42	6, 364, 407. 66	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	13, 341	1, 171. 00	15, 622, 311. 00	
	UBS GROUP AG-REG	1, 963, 473	27. 38	53, 759, 890. 74	

	BALOISE HOLDING AG - REG	24,788	158.60	3,931,376.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	20,883	122.50	2,558,167.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	17,162	656.00	11,258,272.00	
	SWISS RE AG	181,194	113.10	20,493,041.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	87,559	487.20	42,658,744.80	
	TEMENOS AG - REG	34,525	61.75	2,131,918.75	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	89,920	87.38	7,857,209.60	
	SWISSCOM AG-REG	15,056	506.50	7,625,864.00	
	BKW AG	9,300	146.20	1,359,660.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	50,281	84.75	4,261,314.75	
	スイスフラン 小計	8,901,094		868,773,968.96 (155,371,536,608)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,515,868	36.75	55,708,149.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	787,000	92.80	73,033,600.00	
	MTR CORP	1,006,500	24.50	24,659,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	622,000	21.90	13,621,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,366,000	37.50	51,225,000.00	
	SANDS CHINA LTD	1,265,600	17.36	21,970,816.00	
	WH GROUP LTD	3,953,000	5.22	20,634,660.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,992,000	24.00	47,808,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	496,100	103.30	51,247,130.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	726,800	257.80	187,369,040.00	
	AIA GROUP LTD	6,675,200	55.45	370,139,840.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	2,189,000	8.75	19,153,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	453,000	42.90	19,433,700.00	
	CLP HOLDINGS LTD	989,000	63.30	62,603,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	5,821,348	5.84	33,996,672.32	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	847,000	41.85	35,446,950.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	1,381,368	29.45	40,681,287.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	965,641	21.50	20,761,281.50	
	SINO LAND CO	2,619,400	8.05	21,086,170.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	935,500	69.40	64,923,700.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	221,500	69.50	15,394,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	12.40	6,209,920.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	527,000	22.20	11,699,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,110,000	20.55	22,810,500.00	

香港ドル 小計		38,966,625		1,291,618,566.42 (26,400,683,497)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	801,600	6.54	5,242,464.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	754,200	4.10	3,092,220.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	860,940	6.77	5,828,563.80	
	GENTING SINGAPORE LTD	3,983,000	0.87	3,465,210.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,300,300	3.15	4,095,945.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,171,530	35.54	41,636,176.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,015,400	14.31	28,840,374.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	738,300	30.58	22,577,214.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	666,800	9.50	6,334,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,128,060	2.65	13,589,359.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	748,700	5.00	3,743,500.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,432,100	2.66	3,809,386.00	
シンガポールドル 小計		19,600,930		142,255,012.00 (16,783,246,315)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	743,217	7.63	5,670,745.71	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	362,328	29.73	10,772,011.44	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,073,324	3.98	4,271,829.52	
	MERCURY NZ LTD	288,052	6.62	1,906,904.24	
	MERIDIAN ENERGY LTD	765,945	6.15	4,710,561.75	
ニュージーランドドル 小計		3,232,866		27,332,052.66 (2,668,974,942)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	178,730	347.90	62,180,167.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	423.60	13,986,001.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	384,247	156.35	60,077,018.45	
	ALFA LAVAL AB	159,289	471.50	75,104,763.50	
	ASSA ABLOY AB-B	600,345	297.20	178,422,534.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,580,116	202.30	319,657,466.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	953,663	173.65	165,603,579.95	
	BEIJER REF AB	222,900	170.25	37,948,725.00	
	EPIROC AB-A	411,012	216.10	88,819,693.20	
	EPIROC AB-B	210,487	197.30	41,529,085.10	
	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	89.66	14,276,741.12	
	INDUTRADE AB	150,700	279.60	42,135,720.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	143,545	288.60	41,427,087.00	

	LIFCO AB-B SHS	130,200	291.80	37,992,360.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	964,700	48.16	46,459,952.00	
	SAAB AB-B	197,724	245.35	48,511,583.40	
	SANDVIK AB	641,798	217.30	139,462,705.40	
	SKANSKA AB-B SHS	209,707	195.55	41,008,203.85	
	SKF AB-B SHARES	208,393	213.00	44,387,709.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	143,031	421.00	60,216,051.00	
	VOLVO AB-A SHS	129,112	276.60	35,712,379.20	
	VOLVO AB-B SHS	920,911	271.30	249,843,154.30	
	SECURITAS AB-B SHS	235,929	105.85	24,973,084.65	
	VOLVO CAR AB-B	442,279	33.31	14,732,313.49	
	EVOLUTION AB	104,162	1,105.50	115,151,091.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	375,134	193.00	72,400,862.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	363,596	277.40	100,861,530.40	
	GETINGE AB-B SHS	131,116	180.30	23,640,214.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	124,031	276.00	34,232,556.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	907,944	153.65	139,505,595.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	893,229	100.65	89,903,498.85	
	SWEDBANK AB - A SHARES	487,581	218.00	106,292,658.00	
	EQT AB	212,742	320.00	68,077,440.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	91,454	363.20	33,216,092.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89,196	360.30	32,137,318.80	
	INVESTOR AB-B SHS	1,013,030	288.85	292,613,715.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	43,685	528.50	23,087,522.50	
	ERICSSON LM-B SHS	1,680,039	64.94	109,101,732.66	
	HEXAGON AB-B SHS	1,187,146	118.15	140,261,299.90	
	TELE2 AB-B SHS	367,709	106.70	39,234,550.30	
	TELIA CO AB	1,284,253	28.04	36,010,454.12	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	459,633	70.50	32,404,126.50	
	SAGAX AB-B	105,140	266.40	28,009,296.00	
	スウェーデンクローネ 小計	19,331,887		3,400,609,634.34 (51,757,278,634)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	205,999	265.90	54,775,134.10	
	EQUINOR ASA	542,080	293.95	159,344,416.00	
	NORSK HYDRO ASA	836,698	66.38	55,540,013.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	83,488	305.50	25,505,584.00	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	46,700	876.50	40,932,550.00	
	MOWI ASA	251,136	184.90	46,435,046.40	
	ORKLA ASA	493,828	88.15	43,530,938.20	
	SALMAR ASA	40,591	601.00	24,395,191.00	
	DNB BANK ASA	533,264	211.00	112,518,704.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114,704	194.00	22,252,576.00	
	TELENOR ASA	333,379	122.60	40,872,265.40	
	ノルウェークローネ 小計	3,481,867		626,102,418.34 (9,472,929,589)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	226,084	432.50	97,781,330.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	6,061	2,766.00	16,764,726.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	591,405	178.20	105,388,371.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,724	11,460.00	19,757,040.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2,834	11,690.00	33,129,460.00	
	DSV A/S	100,380	1,074.00	107,808,120.00	
	PANDORA A/S	44,829	1,067.00	47,832,543.00	
	CARLSBERG AS-B	58,566	859.20	50,319,907.20	
	COLOPLAST-B	70,770	848.60	60,055,422.00	
	DEMANT A/S	60,610	313.00	18,970,930.00	
	GENMAB A/S	39,585	1,805.00	71,450,925.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,943,076	988.40	1,920,536,318.40	
	DANSKE BANK A/S	406,811	209.90	85,389,628.90	
	TRYG A/S	186,282	153.30	28,557,030.60	
	ORSTED A/S	116,437	395.00	45,992,615.00	
	デンマーククローネ 小計	3,855,454		2,709,734,367.10 (62,215,501,068)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	547,223	16.22	8,875,957.06	
	ELBIT SYSTEMS LTD	14,469	670.80	9,705,805.20	
	BANK HAPOLIM BM	758,702	33.47	25,393,755.94	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	900,703	30.55	27,516,476.65	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	759,946	18.55	14,096,998.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	107,140	127.80	13,692,492.00	
	NICE LTD	37,747	613.90	23,172,883.30	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	218.50	3,235,111.00	
	イスラエルシェケル 小計	3,140,736		125,689,479.45 (5,378,479,066)	

ユーロ	ENI SPA	1, 279, 529	14. 12	18, 072, 067. 59	
	GALP ENERGIA SGPS SA	283, 258	19. 08	5, 405, 978. 93	
	NESTE OYJ	240, 492	16. 78	4, 036, 658. 22	
	OMV AG	76, 362	39. 66	3, 028, 516. 92	
	REPSOL SA	739, 311	14. 80	10, 941, 802. 80	
	TENARIS SA	260, 856	14. 50	3, 782, 412. 00	
	TOTALENERGIES SE	1, 280, 200	62. 51	80, 025, 302. 00	
	AIR LIQUIDE SA	344, 309	164. 76	56, 728, 350. 84	
	AKZO NOBEL N. V.	91, 917	57. 88	5, 320, 155. 96	
	ARCELORMITTAL	310, 796	22. 14	6, 881, 023. 44	
	ARKEMA	35, 633	85. 30	3, 039, 494. 90	
	BASF SE	523, 118	46. 16	24, 147, 126. 88	
	COVESTRO AG	104, 095	53. 86	5, 606, 556. 70	
	DSM-FIRMENICH AG	109, 408	104. 50	11, 433, 136. 00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	123, 314	19. 09	2, 354, 064. 26	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	83, 092	95. 96	7, 973, 508. 32	
	OCI NV	80, 550	23. 25	1, 872, 787. 50	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	162, 088	42. 86	6, 947, 091. 68	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	377, 505	12. 58	4, 749, 012. 90	
	SYENSCO SA	46, 110	88. 90	4, 099, 179. 00	
	SYMRISE AG	82, 005	114. 70	9, 405, 973. 50	
	UMICORE	118, 677	14. 82	1, 758, 793. 14	
	UPM-KYMMENE OYJ	311, 739	33. 05	10, 302, 973. 95	
	VOESTALPINE AG	62, 408	25. 78	1, 608, 878. 24	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	129, 451	40. 90	5, 294, 545. 90	
	AIRBUS SE	354, 151	148. 78	52, 690, 585. 78	
	ALSTOM	192, 488	15. 67	3, 017, 249. 40	
	BOUYGUES SA	103, 648	31. 82	3, 298, 079. 36	
	BRENTAG SE	71, 852	65. 64	4, 716, 365. 28	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	271, 506	73. 16	19, 863, 378. 96	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	322, 444	37. 25	12, 011, 039. 00	
	DASSAULT AVIATION SA	9, 266	179. 60	1, 664, 173. 60	
	EIFPAGE	46, 140	90. 02	4, 153, 522. 80	
	FERROVIAL SE	303, 733	36. 56	11, 104, 478. 48	
	GEA GROUP AG	88, 362	39. 80	3, 516, 807. 60	
	IMCD NV	35, 704	134. 35	4, 796, 832. 40	

KINGSPAN GROUP PLC	92,479	80.20	7,416,815.80	
KNORR-BREMSE AG	40,814	71.55	2,920,241.70	
KONE OYJ-B	208,302	47.07	9,804,775.14	
LEGRAND SA	158,999	93.88	14,926,826.12	
LEONARDO SPA	240,845	22.29	5,368,435.05	
METSO CORP	358,750	10.26	3,682,568.75	
MTU AERO ENGINES AG	33,898	228.80	7,755,862.40	
PRYSMIAN SPA	162,614	58.88	9,574,712.32	
RATIONAL AG	3,372	830.00	2,798,760.00	
REXEL SA	122,383	24.80	3,035,098.40	
RHEINMETALL AG	26,370	500.40	13,195,548.00	
SAFRAN SA	203,700	206.00	41,962,200.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	324,126	227.15	73,625,220.90	
SIEMENS AG-REG	452,899	171.04	77,463,844.96	
SIEMENS ENERGY AG	366,520	24.58	9,009,061.60	
THALES SA	52,989	158.10	8,377,560.90	
VINCI SA	298,450	102.90	30,710,505.00	
WARTSILA OYJ ABP	296,181	18.66	5,526,737.46	
BUREAU VERITAS SA	201,388	26.92	5,421,364.96	
RANDSTAD NV	52,875	45.46	2,403,697.50	
TELEPERFORMANCE	29,501	100.10	2,953,050.10	
WOLTERS KLUWER	148,983	153.75	22,906,136.25	
ADP	17,115	117.80	2,016,147.00	
AENA SME SA	46,423	188.00	8,727,524.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	338,250	5.81	1,965,232.50	
DHL GROUP	594,411	38.15	22,676,779.65	
GETLINK SE	172,576	15.91	2,745,684.16	
INPOST SA	141,398	16.40	2,318,927.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	187,219	89.64	16,782,311.16	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	40,076	84.00	3,366,384.00	
CONTINENTAL AG	69,435	55.30	3,839,755.50	
DR ING HC F PORSCHE AG	69,570	70.36	4,894,945.20	
FERRARI NV	74,984	393.70	29,521,200.80	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	477,813	64.54	30,838,051.02	
MICHELIN (CGDE)	413,033	37.38	15,439,173.54	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	83,301	42.94	3,576,944.94	

RENAULT SA	114, 124	48. 71	5, 558, 980. 04	
STELLANTIS NV	1, 314, 822	19. 38	25, 489, 139. 29	
VOLKSWAGEN AG	19, 218	114. 40	2, 198, 539. 20	
VOLKSWAGEN AG-PREF	117, 861	106. 20	12, 516, 838. 20	
ADIDAS AG	95, 351	220. 10	20, 986, 755. 10	
HERMES INTERNATIONAL	18, 919	2, 178. 00	41, 205, 582. 00	
KERING	45, 475	324. 20	14, 742, 995. 00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	164, 385	726. 50	119, 425, 702. 50	
MONCLER SPA	121, 056	58. 26	7, 052, 722. 56	
PUMA SE	70, 653	44. 65	3, 154, 656. 45	
SEB SA	17, 113	105. 20	1, 800, 287. 60	
ACCOR SA	103, 418	39. 18	4, 051, 917. 24	
AMADEUS IT GROUP SA	271, 149	64. 02	17, 358, 958. 98	
DELIVERY HERO SE	104, 269	25. 92	2, 702, 652. 48	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	68, 879	32. 50	2, 238, 567. 50	
SODEXO SA	58, 085	85. 70	4, 977, 884. 50	
BOLLORE SE	416, 392	5. 77	2, 402, 581. 84	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	42, 374	78. 70	3, 334, 833. 80	
PUBLICIS GROUPE	138, 060	103. 80	14, 330, 628. 00	
SCOUT24 SE	41, 543	71. 45	2, 968, 247. 35	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	492, 346	27. 98	13, 775, 841. 08	
VIVENDI SE	404, 329	9. 88	3, 998, 005. 15	
D' IETEREN GROUP	13, 308	196. 80	2, 619, 014. 40	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	651, 783	47. 21	30, 770, 675. 43	
PROSUS NV	841, 775	34. 49	29, 032, 819. 75	
ZALANDO SE	125, 157	21. 67	2, 712, 152. 19	
CARREFOUR SA	330, 839	13. 80	4, 567, 232. 39	
JERONIMO MARTINS	169, 984	19. 44	3, 304, 488. 96	
KESKO OYJ-B SHS	133, 348	16. 89	2, 252, 914. 46	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	548, 403	28. 15	15, 437, 544. 45	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	537, 231	56. 66	30, 439, 508. 46	
DANONE	383, 632	58. 86	22, 580, 579. 52	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	367, 895	9. 56	3, 517, 811. 99	
HEINEKEN HOLDING NV	79, 993	75. 65	6, 051, 470. 45	
HEINEKEN NV	170, 653	92. 50	15, 785, 402. 50	
JDE PEET' S NV	53, 600	19. 87	1, 065, 032. 00	

KERRY GROUP PLC-A	86,856	75.95	6,596,713.20	
LOTUS BAKERIES	279	10,020.00	2,795,580.00	
PERNOD RICARD SA	121,189	133.20	16,142,374.80	
REMY COINTREAU	9,646	79.35	765,410.10	
BEIERSDORF AG	61,115	141.75	8,663,051.25	
HENKEL AG & CO KGAA	57,972	73.75	4,275,435.00	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	102,673	83.24	8,546,500.52	
L'OREAL	143,444	442.10	63,416,592.40	
AMPLIFON SPA	68,691	34.01	2,336,180.91	
BIOMERIEUX	22,555	90.45	2,040,099.75	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	22,646	66.80	1,512,752.80	
DIASORIN SPA	9,103	95.96	873,523.88	
ESSILORLUXOTTICA	174,801	208.90	36,515,928.90	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	127,004	36.35	4,616,595.40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	246,854	28.37	7,003,247.98	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	460,335	24.55	11,301,224.25	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	167,713	53.50	8,972,645.50	
ARGENX SE	34,568	405.50	14,017,324.00	
BAYER AG-REG	595,741	26.65	15,879,476.35	
EUROFINS SCIENTIFIC	85,929	44.22	3,799,780.38	
GRIFOLS SA	126,564	9.34	1,182,107.76	
IPSEN	21,710	116.80	2,535,728.00	
MERCK KGAA	78,124	167.05	13,050,614.20	
ORION OYJ-CLASS B	50,154	40.01	2,006,661.54	
QIAGEN N.V.	131,652	39.20	5,160,758.40	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	58,531	50.10	2,932,403.10	
SANOFI	679,056	90.36	61,359,500.16	
SARTORIUS AG-VORZUG	16,372	224.80	3,680,425.60	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	18,395	159.45	2,933,082.75	
UCB SA	76,947	138.85	10,684,090.95	
ABN AMRO BANK NV-CVA	290,262	15.58	4,522,281.96	
AIB GROUP PLC	1,031,237	4.96	5,121,122.94	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,438,230	9.39	32,291,856.16	
BANCO BPM SPA	723,370	6.20	4,484,894.00	
BANCO DE SABADELL SA	3,266,886	1.81	5,913,063.66	
BANCO SANTANDER SA	9,451,124	4.40	41,670,005.71	

BANK OF IRELAND GROUP PLC	639,461	9.79	6,264,159.95	
BNP PARIBAS	619,174	61.27	37,936,790.98	
CAIXABANK SA	2,212,480	5.00	11,080,099.84	
COMMERZBANK AG	626,119	14.23	8,909,673.37	
CREDIT AGRICOLE SA	617,427	13.28	8,202,517.69	
ERSTE GROUP BANK AG	202,525	43.99	8,909,074.75	
FINECOBANK SPA	375,456	14.38	5,399,057.28	
ING GROEP NV	1,973,764	15.80	31,201,261.31	
INTESA SANPAOLO	8,759,612	3.53	30,938,949.58	
KBC GROUP NV	152,074	67.12	10,207,206.88	
MEDIOBANCA SPA	298,281	13.93	4,156,545.73	
NORDEA BANK ABP	1,857,374	11.39	21,164,776.73	
SOCIETE GENERALE SA	437,480	22.55	9,867,361.40	
UNICREDIT SPA	904,299	35.36	31,980,534.13	
ADYEN NV	12,973	1,140.80	14,799,598.40	
AMUNDI SA	42,569	63.85	2,718,030.65	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,146,314	14.84	17,013,592.38	
DEUTSCHE BOERSE AG	113,975	194.00	22,111,150.00	
EDENRED	146,617	42.63	6,250,282.71	
EURAZEO SE	30,125	76.35	2,300,043.75	
EURONEXT NV	49,351	90.10	4,446,525.10	
EXOR NV	61,120	99.35	6,072,272.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	58,617	67.60	3,962,509.20	
NEXI SPA	338,814	5.82	1,971,897.48	
SOFINA	9,693	216.80	2,101,442.40	
AEGON LTD	856,692	5.97	5,119,591.39	
AGEAS	85,112	43.80	3,727,905.60	
ALLIANZ SE-REG	233,299	261.50	61,007,688.50	
ASR NEDERLAND NV	95,241	45.00	4,285,845.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	617,515	23.66	14,610,404.90	
AXA SA	1,072,568	30.90	33,142,351.20	
HANNOVER RUECK SE	33,983	237.10	8,057,369.30	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	81,432	467.10	38,036,887.20	
NN GROUP NV	160,370	43.18	6,924,776.60	
POSTE ITALIANE SPA	269,406	12.03	3,242,301.21	
SAMPO OYJ-A SHS	268,909	40.39	10,861,234.51	

TALANX AG	40,850	74.75	3,053,537.50
BECHTLE AG	39,938	45.04	1,798,807.52
CAPGEMINI SE	93,378	187.05	17,466,354.90
DASSAULT SYSTEMES SE	392,835	34.82	13,678,514.70
NEMETSCHEK SE	32,589	88.65	2,889,014.85
SAP SE	621,920	179.46	111,609,763.20
NOKIA OYJ	3,149,790	3.52	11,096,710.17
CELLNEX TELECOM SA	301,308	31.47	9,482,162.76
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,930,054	23.15	44,680,750.10
ELISA OYJ	88,430	42.86	3,790,109.80
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	180,053	9.86	1,775,322.58
KONINKLIJKE KPN NV	2,412,828	3.61	8,712,721.90
ORANGE	1,094,314	9.58	10,483,528.12
TELECOM ITALIA SPA	6,768,851	0.23	1,564,281.46
TELEFONICA SA	2,783,952	4.10	11,439,258.76
ACCIONA SA	13,178	115.70	1,524,694.60
E.ON SE	1,354,815	12.60	17,077,443.07
EDP RENOVAVEIS SA	231,965	13.81	3,203,436.65
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,709,490	3.61	6,183,225.33
ELIA GROUP SA/NV	17,969	92.10	1,654,944.90
ENDESA SA	199,107	19.05	3,793,983.88
ENEL SPA	4,780,882	6.54	31,276,530.04
ENGIE	1,087,360	13.73	14,929,452.80
FORTUM OYJ	254,538	14.47	3,683,164.86
IBERDROLA SA	3,424,842	12.32	42,194,053.44
REDEIA CORP SA	220,809	17.32	3,824,411.88
RWE AG	362,247	33.47	12,124,407.09
SNAM SPA	1,319,110	4.13	5,449,243.41
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	888,343	7.43	6,603,941.86
VEOLIA ENVIRONNEMENT	396,328	29.16	11,556,924.48
VERBUND AG	48,497	75.30	3,651,824.10
ASM INTERNATIONAL NV	28,150	690.80	19,446,020.00
ASML HOLDING NV	237,870	948.50	225,619,695.00
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	46,282	149.75	6,930,729.50
INFINEON TECHNOLOGIES AG	782,285	34.00	26,601,601.42
STMICROELECTRONICS NV	406,101	37.76	15,334,373.76

	LEG IMMOBILIEN SE	41,849	75.64	3,165,458.36	
	VONOVIA SE	431,666	26.43	11,408,932.38	
ユーロ 小計		110,037,703		3,070,945,025.51 (526,022,173,419)	
合 計		652,656,902		5,822,135,315,794 (5,822,135,315,794)	

(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	99,307	11,721,205.21	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	200,103	7,363,790.40	
		AMERICAN TOWER CORP	275,177	54,042,011.03	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	84,545	17,450,933.45	
		BOSTON PROPERTIES INC	93,232	5,798,098.08	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	68,399	7,599,128.90	
		CROWN CASTLE INC	259,935	25,325,467.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	185,074	27,207,728.74	
		EQUINIX INC	56,079	42,182,623.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,026	7,023,850.52	
		EQUITY RESIDENTIAL	205,240	14,200,555.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,480	10,464,041.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	122,615	19,536,247.95	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	175,988	7,827,946.24	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	437,815	8,603,064.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	453,144	8,206,437.84	
		INVITATION HOMES INC	353,860	12,685,881.00	
		IRON MOUNTAIN INC	175,922	15,672,890.98	
		KIMCO REALTY CORP	388,713	7,439,966.82	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	74,228	10,638,356.96	
		PROLOGIS INC	546,942	61,055,135.46	
		PUBLIC STORAGE	94,397	27,593,187.07	
		REALTY INCOME CORP	516,514	27,705,810.96	
		REGENCY CENTERS CORP	107,187	6,673,462.62	

		SBA COMMUNICATIONS CORP	60,761	11,980,246.37	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	194,193	29,216,336.85	
		SUN COMMUNITIES INC	75,315	9,045,331.50	
		UDR INC	183,019	7,533,062.04	
		VENTAS INC	240,064	12,168,844.16	
		VICI PROPERTIES INC	628,718	17,874,452.74	
		WELLTOWER INC	338,604	34,866,053.88	
		WEYERHAEUSER CO	441,260	12,814,190.40	
		WP CAREY INC	133,886	7,485,566.26	
アメリカドル合計			7,415,742	587,001,906.83 (93,662,024,253)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	36,100	1,599,591.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	984,480.00	
カナダドル合計			94,700	2,584,071.00 (301,922,855)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	603,939	4,010,154.96	
		GOODMAN GROUP	1,017,734	35,803,882.12	
		GPT GROUP	1,535,318	6,432,982.42	
		MIRVAC GROUP	2,214,980	4,230,611.80	
		SCENTRE GROUP	3,534,724	11,311,116.80	
		STOCKLAND	1,319,965	5,807,846.00	
		VICINITY CENTRES	1,843,215	3,456,028.12	
オーストラリアドル合計			12,069,875	71,052,622.22 (7,543,656,901)	
イギリスポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	352,124	2,216,620.58	
		SEGRO PLC	726,973	6,596,553.00	
イギリスポンド合計			1,079,097	8,813,173.58 (1,784,403,254)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,609,200	51,011,640.00	
香港ドル合計			1,609,200	51,011,640.00 (1,042,677,921)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,228,300	5,659,882.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,977,171	5,805,483.45	
シンガポールドル合計			5,205,471	11,465,365.45 (1,352,683,815)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	26,523	1,226,953.98	

	GECINA SA	24,517	2,265,370.80	
	KLEPIERRE	129,417	3,377,783.70	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE	64,908	4,842,136.80	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	98,953	2,529,238.68	
ユーロ合計		344,318	14,241,483.96 (2,439,423,787)	
合計			108,126,792,786 (108,126,792,786)	

(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 581 銘柄	97.93%	—	74.83%
	投資証券 33 銘柄	—	2.07%	1.58%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.84%	—	3.09%
	投資証券 2 銘柄	—	0.16%	0.01%
オーストラリアドル	株式 51 銘柄	93.54%	—	1.84%
	投資証券 7 銘柄	—	6.46%	0.13%
イギリスポンド	株式 77 銘柄	99.25%	—	3.98%
	投資証券 2 銘柄	—	0.75%	0.03%
スイスフラン	株式 45 銘柄	100.00%	—	2.62%
香港ドル	株式 24 銘柄	96.20%	—	0.45%
	投資証券 1 銘柄	—	3.80%	0.02%
シンガポールドル	株式 12 銘柄	92.54%	—	0.28%
	投資証券 2 銘柄	—	7.46%	0.02%
ニュージーランドドル	株式 5 銘柄	100.00%	—	0.05%
スウェーデンクローネ	株式 43 銘柄	100.00%	—	0.87%
ノルウェークローネ	株式 11 銘柄	100.00%	—	0.16%
デンマーククローネ	株式 15 銘柄	100.00%	—	1.05%
イスラエルシェケル	株式 8 銘柄	100.00%	—	0.09%
ユーロ	株式 218 銘柄	99.54%	—	8.87%
	投資証券 5 銘柄	—	0.46%	0.04%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

貸借対照表

(単位：円)

[2024年6月25日現在]

資産の部

流動資産

コール・ローン	6,813,496,839
国債証券	788,806,029,330
地方債証券	49,325,597,116
特殊債券	39,496,915,621
社債券	56,953,100,000
派生商品評価勘定	4,542,235
未収利息	1,115,508,966
前払費用	73,846,103
差入委託証拠金	39,145,368
流動資産合計	942,628,181,578
資産合計	942,628,181,578

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	2,825,610
前受金	4,240,000
未払金	200,000,000
未払解約金	170,891,910
流動負債合計	377,957,520
負債合計	377,957,520

純資産の部

元本等

元本	754,784,148,877
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	187,466,075,181
元本等合計	942,250,224,058
純資産合計	942,250,224,058
負債純資産合計	942,628,181,578

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

[2024年6月25日現在]

1. 期首	2023 年 6 月 27 日
期首元本額	562, 256, 036, 879 円
期中追加設定元本額	268, 805, 798, 088 円
期中一部解約元本額	76, 277, 686, 090 円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	7, 997, 142, 791 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	12, 577, 572, 325 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	3, 481, 644, 618 円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	59, 340, 775, 760 円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	113, 550, 719, 679 円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	38, 665, 655, 215 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	220, 481, 260 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	205, 024, 066 円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1, 689, 744, 956 円
eMAXIS 国内債券インデックス	6, 155, 485, 588 円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	4, 743, 189, 331 円
eMAXIS バランス（波乗り型）	92, 894, 361 円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	19, 511, 575, 820 円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）	42, 745, 047, 450 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	11, 816, 442, 055 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	5, 840, 682, 630 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	2, 740, 471, 308 円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	18, 691, 213, 856 円
国内債券セレクション（ラップ向け）	5, 237, 609, 746 円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	25, 938, 001, 795 円
つみたて8資産均等バランス	13, 028, 377, 260 円
つみたて4資産均等バランス	5, 147, 596, 689 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	21, 024, 949 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	15, 605, 741 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	502, 449 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	6, 890, 866, 399 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	3, 195, 111, 659 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	1, 291, 522, 785 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	7, 664, 408, 601 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	7, 966, 957, 069 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	5, 350, 885, 719 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	997, 298, 330 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	1, 466, 327, 947 円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	965, 232, 140 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	490, 759, 324 円
ラップ向けインデックスf 国内債券	6, 789, 552, 784 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	2, 290, 168, 796 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	13, 783, 064 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金）	6, 327, 503 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）コンサバティブコース	6, 027, 635 円

三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	56,719,654 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	91,833,237 円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	76,745,735 円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	2,131,465,178 円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	2,169,616,438 円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	1,280,788,549 円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	2,396,097,967 円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	149,284,978 円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	63,903,066 円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	5,613,796,817 円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	29,208,146 円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	9,058,245,218 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	612,690,875 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	4,648,956,997 円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	180,015,151,502 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	471,708,286 円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	1,642,813 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	312,820 円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,442,867,065 円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	2,486,042,625 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	3,285,209,740 円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	636,508,309 円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	30,858,664,393 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	1,652,197,578 円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,156,260 円
日本債券インデックスファンドS	5,837,646,907 円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	8,549,594 円
国内債券インデックスオープンV（適格機関投資家限定）	7,200,847 円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	24,503,259,248 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）	554,334,205 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）	546,840,063 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）	547,010,780 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）	543,756,712 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）	546,757,835 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）	548,694,334 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）	539,198,394 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）	536,900,992 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）	545,804,051 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）	559,816,343 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)	587,761,901 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)	606,830,601 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)	622,785,795 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)	627,454,324 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)	628,202,232 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)	628,183,105 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)	628,165,479 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)	628,207,051 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	19,363,126 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	23,175,376 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,511,605 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	10,095,639 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	18,786,848 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	49,120,687 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	9,659,880 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	31,749,983 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,266,130,082 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,296,229,732 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,886,402,771 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)	3,087,216,505 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)	2,227,820,151 円
合計	754,784,148,877 円
2. 受益権の総数	754,784,148,877 口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 6 月 27 日 至 2024 年 6 月 25 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 6 月 25 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 6 月 25 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△4,921,943,890
地方債証券	△19,564,362
特殊債券	△76,400,110
社債券	27,640,000
合計	△4,990,268,362

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2024 年 6 月 25 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	3,585,260,000	—	3,587,000,000	1,740,000
合計		3,585,260,000	—	3,587,000,000	1,740,000

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024 年 6 月 25 日現在]
1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	1.2484 円 (12,484 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4 5 0 回利付国債 (2 年)	800,000,000	798,824,000	
	第4 5 1 回利付国債 (2 年)	5,800,000,000	5,790,140,000	
	第4 5 2 回利付国債 (2 年)	3,100,000,000	3,093,955,000	
	第4 5 3 回利付国債 (2 年)	4,600,000,000	4,589,788,000	
	第4 5 4 回利付国債 (2 年)	3,550,000,000	3,545,456,000	
	第4 5 5 回利付国債 (2 年)	1,550,000,000	1,545,458,500	
	第4 5 6 回利付国債 (2 年)	4,100,000,000	4,092,210,000	
	第4 5 7 回利付国債 (2 年)	5,710,000,000	5,697,209,600	
	第4 5 8 回利付国債 (2 年)	6,400,000,000	6,394,112,000	
	第4 6 0 回利付国債 (2 年)	6,700,000,000	6,701,809,000	
	第1 4 5 回利付国債 (5 年)	6,410,000,000	6,404,038,700	
	第1 4 6 回利付国債 (5 年)	4,450,000,000	4,442,746,500	
	第1 4 7 回利付国債 (5 年)	5,830,000,000	5,804,872,700	
	第1 4 8 回利付国債 (5 年)	7,200,000,000	7,158,816,000	
	第1 4 9 回利付国債 (5 年)	11,970,000,000	11,890,160,100	
	第1 5 0 回利付国債 (5 年)	7,430,000,000	7,372,268,900	
	第1 5 1 回利付国債 (5 年)	50,000,000	49,553,000	
	第1 5 2 回利付国債 (5 年)	5,480,000,000	5,445,092,400	
	第1 5 3 回利付国債 (5 年)	7,920,000,000	7,839,295,200	
	第1 5 4 回利付国債 (5 年)	5,230,000,000	5,184,812,800	
	第1 5 5 回利付国債 (5 年)	2,850,000,000	2,840,680,500	
	第1 5 6 回利付国債 (5 年)	8,050,000,000	7,995,984,500	
	第1 5 7 回利付国債 (5 年)	2,020,000,000	2,003,658,200	
	第1 5 8 回利付国債 (5 年)	9,040,000,000	8,933,689,600	

第 1 5 9 回利付国債（5 年）	1,980,000,000	1,953,250,200	
第 1 6 0 回利付国債（5 年）	2,850,000,000	2,822,668,500	
第 1 6 1 回利付国債（5 年）	4,720,000,000	4,693,190,400	
第 1 6 2 回利付国債（5 年）	190,000,000	188,618,700	
第 1 6 3 回利付国債（5 年）	7,230,000,000	7,207,442,400	
第 1 6 4 回利付国債（5 年）	1,900,000,000	1,874,160,000	
第 1 6 5 回利付国債（5 年）	6,100,000,000	6,043,819,000	
第 1 6 6 回利付国債（5 年）	4,910,000,000	4,886,284,700	
第 1 6 7 回利付国債（5 年）	350,000,000	347,739,000	
第 1 6 8 回利付国債（5 年）	9,300,000,000	9,325,668,000	
第 1 回利付国債（4 0 年）	2,105,000,000	2,280,872,750	
第 2 回利付国債（4 0 年）	1,335,000,000	1,389,521,400	
第 3 回利付国債（4 0 年）	1,668,000,000	1,724,661,960	
第 4 回利付国債（4 0 年）	1,838,000,000	1,890,493,280	
第 5 回利付国債（4 0 年）	1,525,000,000	1,498,266,750	
第 6 回利付国債（4 0 年）	1,230,000,000	1,175,375,700	
第 7 回利付国債（4 0 年）	1,540,000,000	1,397,827,200	
第 8 回利付国債（4 0 年）	2,110,000,000	1,764,888,400	
第 9 回利付国債（4 0 年）	3,830,000,000	2,300,949,100	
第 1 0 回利付国債（4 0 年）	3,000,000,000	2,120,640,000	
第 1 1 回利付国債（4 0 年）	3,080,000,000	2,076,228,000	
第 1 2 回利付国債（4 0 年）	2,670,000,000	1,581,708,000	
第 1 3 回利付国債（4 0 年）	3,920,000,000	2,279,048,800	
第 1 4 回利付国債（4 0 年）	3,590,000,000	2,224,830,700	
第 1 5 回利付国債（4 0 年）	4,200,000,000	2,873,514,000	
第 1 6 回利付国債（4 0 年）	4,000,000,000	3,002,280,000	
第 1 7 回利付国債（4 0 年）	700,000,000	681,219,000	
第 3 4 0 回利付国債（1 0 年）	3,470,000,000	3,479,611,900	
第 3 4 1 回利付国債（1 0 年）	3,320,000,000	3,324,415,600	
第 3 4 2 回利付国債（1 0 年）	2,570,000,000	2,563,112,400	
第 3 4 3 回利付国債（1 0 年）	4,870,000,000	4,851,250,500	
第 3 4 4 回利付国債（1 0 年）	4,620,000,000	4,598,932,800	
第 3 4 5 回利付国債（1 0 年）	6,340,000,000	6,305,573,800	
第 3 4 6 回利付国債（1 0 年）	6,130,000,000	6,090,951,900	
第 3 4 7 回利付国債（1 0 年）	5,700,000,000	5,657,877,000	
第 3 4 8 回利付国債（1 0 年）	4,970,000,000	4,927,059,200	

第349回利付国債（10年）	6,090,000,000	6,028,186,500	
第350回利付国債（10年）	6,530,000,000	6,453,207,200	
第351回利付国債（10年）	4,870,000,000	4,804,206,300	
第352回利付国債（10年）	4,110,000,000	4,045,966,200	
第353回利付国債（10年）	4,630,000,000	4,546,752,600	
第354回利付国債（10年）	6,320,000,000	6,190,250,400	
第355回利付国債（10年）	4,840,000,000	4,734,342,800	
第356回利付国債（10年）	9,580,000,000	9,358,223,000	
第357回利付国債（10年）	4,150,000,000	4,047,329,000	
第358回利付国債（10年）	9,440,000,000	9,188,612,800	
第359回利付国債（10年）	9,790,000,000	9,509,908,100	
第360回利付国債（10年）	6,640,000,000	6,434,624,800	
第361回利付国債（10年）	10,610,000,000	10,253,185,700	
第362回利付国債（10年）	7,240,000,000	6,974,147,200	
第363回利付国債（10年）	9,720,000,000	9,334,796,400	
第364回利付国債（10年）	6,840,000,000	6,548,342,400	
第365回利付国債（10年）	10,970,000,000	10,464,612,100	
第366回利付国債（10年）	7,040,000,000	6,744,672,000	
第367回利付国債（10年）	8,390,000,000	8,009,177,900	
第368回利付国債（10年）	10,130,000,000	9,637,985,900	
第369回利付国債（10年）	9,670,000,000	9,402,141,000	
第370回利付国債（10年）	9,510,000,000	9,216,901,800	
第371回利付国債（10年）	8,910,000,000	8,529,008,400	
第372回利付国債（10年）	8,270,000,000	8,178,533,800	
第373回利付国債（10年）	9,780,000,000	9,465,670,800	
第374回利付国債（10年）	3,350,000,000	3,292,011,500	
第1回利付国債（30年）	196,000,000	218,720,320	
第2回利付国債（30年）	268,000,000	295,271,680	
第3回利付国債（30年）	307,000,000	337,595,620	
第4回利付国債（30年）	252,000,000	288,003,240	
第5回利付国債（30年）	238,000,000	262,442,600	
第6回利付国債（30年）	339,000,000	379,825,770	
第7回利付国債（30年）	339,000,000	378,320,610	
第8回利付国債（30年）	302,000,000	325,661,700	
第9回利付国債（30年）	206,000,000	215,478,060	
第10回利付国債（30年）	398,000,000	405,757,020	

第 1 1 回利付国債（30年）	237,000,000	253,388,550	
第 1 2 回利付国債（30年）	325,000,000	358,712,250	
第 1 3 回利付国債（30年）	595,000,000	651,340,550	
第 1 4 回利付国債（30年）	683,000,000	772,247,610	
第 1 5 回利付国債（30年）	686,000,000	782,245,800	
第 1 6 回利付国債（30年）	547,000,000	624,050,420	
第 1 7 回利付国債（30年）	577,000,000	652,725,480	
第 1 8 回利付国債（30年）	687,000,000	770,188,830	
第 1 9 回利付国債（30年）	593,000,000	664,687,770	
第 2 0 回利付国債（30年）	655,000,000	748,193,400	
第 2 1 回利付国債（30年）	529,000,000	592,818,560	
第 2 2 回利付国債（30年）	1,975,000,000	2,254,087,250	
第 2 3 回利付国債（30年）	194,000,000	221,466,520	
第 2 4 回利付国債（30年）	981,000,000	1,119,448,530	
第 2 5 回利付国債（30年）	1,287,000,000	1,438,364,070	
第 2 6 回利付国債（30年）	1,014,000,000	1,145,221,740	
第 2 7 回利付国債（30年）	760,000,000	866,407,600	
第 2 8 回利付国債（30年）	2,926,000,000	3,333,152,900	
第 2 9 回利付国債（30年）	1,630,000,000	1,832,168,900	
第 3 0 回利付国債（30年）	1,721,000,000	1,907,831,760	
第 3 1 回利付国債（30年）	2,223,000,000	2,428,005,060	
第 3 2 回利付国債（30年）	1,989,000,000	2,195,716,770	
第 3 3 回利付国債（30年）	1,227,000,000	1,299,454,350	
第 3 4 回利付国債（30年）	2,231,000,000	2,418,827,890	
第 3 5 回利付国債（30年）	3,179,000,000	3,341,733,010	
第 3 6 回利付国債（30年）	2,579,000,000	2,700,960,910	
第 3 7 回利付国債（30年）	2,717,000,000	2,794,570,350	
第 3 8 回利付国債（30年）	1,590,000,000	1,603,467,300	
第 3 9 回利付国債（30年）	1,360,000,000	1,390,056,000	
第 4 0 回利付国債（30年）	1,720,000,000	1,724,919,200	
第 4 1 回利付国債（30年）	1,210,000,000	1,191,680,600	
第 4 2 回利付国債（30年）	1,820,000,000	1,786,985,200	
第 4 3 回利付国債（30年）	2,020,000,000	1,978,670,800	
第 4 4 回利付国債（30年）	2,230,000,000	2,179,133,700	
第 4 5 回利付国債（30年）	2,190,000,000	2,062,344,900	
第 4 6 回利付国債（30年）	2,530,000,000	2,375,948,300	

第47回利付国債（30年）	2,890,000,000	2,757,840,300	
第48回利付国債（30年）	2,270,000,000	2,082,498,000	
第49回利付国債（30年）	2,510,000,000	2,297,478,300	
第50回利付国債（30年）	2,710,000,000	2,187,566,200	
第51回利付国債（30年）	2,560,000,000	1,829,785,600	
第52回利付国債（30年）	2,990,000,000	2,232,692,800	
第53回利付国債（30年）	2,490,000,000	1,894,939,800	
第54回利付国債（30年）	2,240,000,000	1,778,246,400	
第55回利付国債（30年）	2,760,000,000	2,181,807,600	
第56回利付国債（30年）	2,310,000,000	1,818,316,500	
第57回利付国債（30年）	2,340,000,000	1,835,566,200	
第58回利付国債（30年）	2,140,000,000	1,671,575,400	
第59回利付国債（30年）	2,410,000,000	1,829,527,400	
第60回利付国債（30年）	2,200,000,000	1,746,514,000	
第61回利付国債（30年）	1,940,000,000	1,458,356,200	
第62回利付国債（30年）	2,070,000,000	1,469,865,600	
第63回利付国債（30年）	2,720,000,000	1,867,416,000	
第64回利付国債（30年）	2,330,000,000	1,590,085,200	
第65回利付国債（30年）	1,860,000,000	1,262,754,000	
第66回利付国債（30年）	1,760,000,000	1,187,753,600	
第67回利付国債（30年）	2,740,000,000	1,949,126,400	
第68回利付国債（30年）	2,940,000,000	2,081,343,600	
第69回利付国債（30年）	2,470,000,000	1,790,058,400	
第70回利付国債（30年）	2,340,000,000	1,689,456,600	
第71回利付国債（30年）	2,610,000,000	1,875,650,400	
第72回利付国債（30年）	2,510,000,000	1,796,858,800	
第73回利付国債（30年）	2,910,000,000	2,075,266,500	
第74回利付国債（30年）	2,580,000,000	1,993,514,400	
第75回利付国債（30年）	2,670,000,000	2,224,884,300	
第76回利付国債（30年）	2,640,000,000	2,250,600,000	
第77回利付国債（30年）	2,690,000,000	2,403,138,400	
第78回利付国債（30年）	3,260,000,000	2,766,762,000	
第79回利付国債（30年）	2,030,000,000	1,634,556,000	
第80回利付国債（30年）	2,710,000,000	2,526,099,400	
第81回利付国債（30年）	2,580,000,000	2,290,859,400	
第82回利付国債（30年）	2,430,000,000	2,259,341,100	

第 8 1 回利付国債（20年）	250,000,000	255,625,000	
第 8 2 回利付国債（20年）	1,082,000,000	1,107,675,860	
第 8 3 回利付国債（20年）	395,000,000	406,048,150	
第 8 4 回利付国債（20年）	880,000,000	903,311,200	
第 8 5 回利付国債（20年）	520,000,000	536,582,800	
第 8 6 回利付国債（20年）	1,047,000,000	1,084,000,980	
第 8 7 回利付国債（20年）	420,000,000	434,116,200	
第 8 8 回利付国債（20年）	1,264,000,000	1,314,104,960	
第 8 9 回利付国債（20年）	340,000,000	352,804,400	
第 9 0 回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,323,581,300	
第 9 1 回利付国債（20年）	548,000,000	572,336,680	
第 9 2 回利付国債（20年）	1,282,000,000	1,338,420,820	
第 9 3 回利付国債（20年）	190,000,000	198,588,000	
第 9 4 回利付国債（20年）	875,000,000	916,921,250	
第 9 5 回利付国債（20年）	1,107,000,000	1,171,084,230	
第 9 6 回利付国債（20年）	340,000,000	357,673,200	
第 9 7 回利付国債（20年）	573,000,000	606,715,320	
第 9 8 回利付国債（20年）	610,000,000	643,946,500	
第 9 9 回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,567,275,600	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,097,959,400	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	723,000,000	776,017,590	
第 1 0 2 回利付国債（20年）	520,000,000	560,118,000	
第 1 0 3 回利付国債（20年）	760,000,000	815,654,800	
第 1 0 4 回利付国債（20年）	610,000,000	649,894,000	
第 1 0 5 回利付国債（20年）	920,000,000	982,679,600	
第 1 0 6 回利付国債（20年）	571,000,000	612,277,590	
第 1 0 7 回利付国債（20年）	607,000,000	649,738,870	
第 1 0 8 回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,061,640,000	
第 1 0 9 回利付国債（20年）	560,000,000	595,548,800	
第 1 1 0 回利付国債（20年）	876,000,000	939,693,960	
第 1 1 1 回利付国債（20年）	861,000,000	931,033,740	
第 1 1 2 回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,130,031,000	
第 1 1 3 回利付国債（20年）	922,000,000	995,483,400	
第 1 1 4 回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,732,960,000	
第 1 1 5 回利付国債（20年）	944,000,000	1,027,477,920	
第 1 1 6 回利付国債（20年）	461,000,000	503,259,870	

第 1 1 7 回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,433,678,400	
第 1 1 8 回利付国債（20年）	520,000,000	563,024,800	
第 1 1 9 回利付国債（20年）	400,000,000	428,468,000	
第 1 2 0 回利付国債（20年）	780,000,000	826,246,200	
第 1 2 1 回利付国債（20年）	1,299,000,000	1,401,763,890	
第 1 2 2 回利付国債（20年）	100,000,000	107,309,000	
第 1 2 3 回利付国債（20年）	1,318,000,000	1,440,943,040	
第 1 2 4 回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,347,929,600	
第 1 2 5 回利付国債（20年）	1,844,000,000	2,030,944,720	
第 1 2 6 回利付国債（20年）	200,000,000	217,622,000	
第 1 2 7 回利付国債（20年）	440,000,000	475,930,400	
第 1 2 8 回利付国債（20年）	1,974,000,000	2,137,407,720	
第 1 2 9 回利付国債（20年）	280,000,000	301,308,000	
第 1 3 0 回利付国債（20年）	1,862,000,000	2,005,113,320	
第 1 3 1 回利付国債（20年）	420,000,000	449,387,400	
第 1 3 2 回利付国債（20年）	187,000,000	200,157,320	
第 1 3 3 回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,499,707,200	
第 1 3 4 回利付国債（20年）	4,545,000,000	4,899,100,950	
第 1 3 5 回利付国債（20年）	50,000,000	53,529,500	
第 1 3 6 回利付国債（20年）	190,000,000	201,949,100	
第 1 3 7 回利付国債（20年）	4,342,000,000	4,649,196,500	
第 1 3 8 回利付国債（20年）	160,000,000	168,848,000	
第 1 3 9 回利付国債（20年）	310,000,000	329,474,200	
第 1 4 0 回利付国債（20年）	2,817,000,000	3,016,359,090	
第 1 4 1 回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,198,657,600	
第 1 4 2 回利付国債（20年）	3,090,000,000	3,332,843,100	
第 1 4 3 回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,846,818,600	
第 1 4 4 回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,600,301,600	
第 1 4 5 回利付国債（20年）	3,100,000,000	3,314,365,000	
第 1 4 6 回利付国債（20年）	3,420,000,000	3,653,278,200	
第 1 4 7 回利付国債（20年）	3,450,000,000	3,651,445,500	
第 1 4 8 回利付国債（20年）	3,360,000,000	3,519,902,400	
第 1 4 9 回利付国債（20年）	3,780,000,000	3,953,350,800	
第 1 5 0 回利付国債（20年）	4,800,000,000	4,964,400,000	
第 1 5 1 回利付国債（20年）	4,480,000,000	4,537,030,400	
第 1 5 2 回利付国債（20年）	3,980,000,000	4,020,118,400	

第 1 5 3 回利付国債（20年）	4,540,000,000	4,622,174,000	
第 1 5 4 回利付国債（20年）	4,160,000,000	4,182,755,200	
第 1 5 5 回利付国債（20年）	4,720,000,000	4,631,688,800	
第 1 5 6 回利付国債（20年）	3,100,000,000	2,828,936,000	
第 1 5 7 回利付国債（20年）	4,980,000,000	4,411,981,200	
第 1 5 8 回利付国債（20年）	3,760,000,000	3,440,625,600	
第 1 5 9 回利付国債（20年）	4,350,000,000	4,012,135,500	
第 1 6 0 回利付国債（20年）	4,430,000,000	4,121,627,700	
第 1 6 1 回利付国債（20年）	3,970,000,000	3,631,001,700	
第 1 6 2 回利付国債（20年）	5,130,000,000	4,671,685,800	
第 1 6 3 回利付国債（20年）	3,750,000,000	3,400,050,000	
第 1 6 4 回利付国債（20年）	3,490,000,000	3,104,983,200	
第 1 6 5 回利付国債（20年）	3,810,000,000	3,371,545,200	
第 1 6 6 回利付国債（20年）	4,660,000,000	4,222,659,000	
第 1 6 7 回利付国債（20年）	3,710,000,000	3,249,180,900	
第 1 6 8 回利付国債（20年）	4,300,000,000	3,689,228,000	
第 1 6 9 回利付国債（20年）	3,640,000,000	3,056,981,200	
第 1 7 0 回利付国債（20年）	3,120,000,000	2,605,574,400	
第 1 7 1 回利付国債（20年）	3,070,000,000	2,549,389,400	
第 1 7 2 回利付国債（20年）	4,090,000,000	3,434,291,200	
第 1 7 3 回利付国債（20年）	3,550,000,000	2,964,356,500	
第 1 7 4 回利付国債（20年）	6,120,000,000	5,085,046,800	
第 1 7 5 回利付国債（20年）	3,620,000,000	3,043,008,200	
第 1 7 6 回利付国債（20年）	4,500,000,000	3,762,270,000	
第 1 7 7 回利付国債（20年）	3,790,000,000	3,095,785,700	
第 1 7 8 回利付国債（20年）	4,170,000,000	3,450,049,500	
第 1 7 9 回利付国債（20年）	3,640,000,000	2,994,737,200	
第 1 8 0 回利付国債（20年）	4,280,000,000	3,699,717,600	
第 1 8 1 回利付国債（20年）	3,800,000,000	3,328,572,000	
第 1 8 2 回利付国債（20年）	4,160,000,000	3,760,182,400	
第 1 8 3 回利付国債（20年）	3,820,000,000	3,620,596,000	
第 1 8 4 回利付国債（20年）	4,190,000,000	3,760,692,600	
第 1 8 5 回利付国債（20年）	4,890,000,000	4,368,579,300	
第 1 8 6 回利付国債（20年）	3,700,000,000	3,531,280,000	
第 1 8 7 回利付国債（20年）	3,170,000,000	2,914,022,500	
第 1 8 8 回利付国債（20年）	2,580,000,000	2,490,345,000	

	第 1 回大韓民国	100,000,000	100,025,000	
	第 2 回大韓民国	100,000,000	100,299,000	
国債証券 合計		831,599,000,000	788,806,029,330	
地方債証券	第 7 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,346,000	
	第 7 回東京都公募公債（30年）	80,000,000	89,948,800	
	第 10 回東京都公募公債（30年）	100,000,000	109,297,000	
	第 12 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,921,000	
	第 20 回東京都公募公債（20年）	80,000,000	85,966,400	
	第 21 回東京都公募公債（20年）	80,000,000	86,665,600	
	第 28 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,285,000	
	第 33 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	87,564,000	
	第 747 回東京都公募公債	500,000,000	501,320,000	
	第 750 回東京都公募公債	200,000,000	200,454,000	
	第 751 回東京都公募公債	500,000,000	500,590,000	
	第 757 回東京都公募公債	150,000,000	148,983,000	
	第 758 回東京都公募公債	150,000,000	148,983,000	
	第 782 回東京都公募公債	100,000,000	98,828,000	
	第 783 回東京都公募公債	400,000,000	395,156,000	
	第 807 回東京都公募公債	200,000,000	193,322,000	
	第 809 回東京都公募公債	100,000,000	96,441,000	
	平成 27 年度第 5 回北海道公募公債	100,000,000	100,356,000	
	平成 30 年度第 14 回北海道公募公債	100,000,000	98,262,000	
	令和 3 年度第 14 回北海道公募公債（5年）	400,000,000	395,848,000	
	第 32 回 1 号宮城県公募公債	200,000,000	198,794,000	
	第 36 回 2 号宮城県公募公債	342,000,000	330,053,940	
	第 2 回神奈川県公募公債（30年）	180,000,000	210,751,200	
	第 4 回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	114,063,000	
	第 19 回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,186,000	
	第 20 回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	531,825,000	
	第 27 回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	102,502,000	
	第 96 回神奈川県公募公債（5年）	300,000,000	300,549,000	
	第 226 回神奈川県公募公債	100,000,000	99,405,000	
	第 234 回神奈川県公募公債	400,000,000	395,688,000	
	第 243 回神奈川県公募公債	100,000,000	97,003,000	
	第 256 回神奈川県公募公債	350,000,000	335,016,500	
	第 7 回大阪府公募公債（20年）	220,000,000	236,013,800	

第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	105,870,000	
第179回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,508,000	
第184回大阪府公募公債（5年）	120,000,000	119,106,000	
第186回大阪府公募公債（5年）	300,000,000	297,546,000	
第191回大阪府公募公債（5年）	160,000,000	158,339,200	
第400回大阪府公募公債	136,000,000	136,463,760	
第407回大阪府公募公債	200,000,000	199,030,000	
第410回大阪府公募公債	200,000,000	198,430,000	
第415回大阪府公募公債	100,000,000	99,360,000	
第417回大阪府公募公債	300,000,000	298,713,000	
第418回大阪府公募公債	800,000,000	795,736,000	
第420回大阪府公募公債	100,000,000	99,247,000	
第426回大阪府公募公債	100,000,000	98,977,000	
第435回大阪府公募公債	130,000,000	128,139,700	
第439回大阪府公募公債	100,000,000	98,255,000	
第455回大阪府公募公債	148,000,000	143,357,240	
第460回大阪府公募公債	194,000,000	187,134,340	
第464回大阪府公募公債	800,000,000	766,136,000	
第465回大阪府公募公債	500,000,000	479,970,000	
第467回大阪府公募公債	200,000,000	192,116,000	
第471回大阪府公募公債	97,000,000	92,244,090	
第483回大阪府公募公債	200,000,000	197,680,000	
平成26年度第2回京都府公募公債（15年）	200,000,000	204,188,000	
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	103,141,000	
令和6年度第1回京都府公募公債（5年）	200,000,000	198,710,000	
第1回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	410,592,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	300,000,000	318,288,000	
第2回兵庫県公募公債（30年）	90,000,000	98,616,600	
第4回兵庫県公募公債（12年）	300,000,000	302,235,000	
第5回兵庫県公募公債（12年）	400,000,000	403,004,000	
第5回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	206,066,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,232,000	
第9回兵庫県公募公債（15年）	800,000,000	815,064,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	216,986,000	
第27回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	180,002,000	
平成28年度第29回兵庫県公募公債	100,000,000	99,548,000	

令和５年度第４回兵庫県公募公債（グリーン）	100,000,000	97,240,000	
令和５年度第５回兵庫県公募公債	100,000,000	98,264,000	
令和６年度第１回兵庫県公募公債（５年）	100,000,000	99,629,000	
令和６年度第２回兵庫県公募公債	200,000,000	197,310,000	
第１回静岡県公募公債（１５年）	100,000,000	102,996,000	
第６回静岡県公募公債（１５年）	300,000,000	306,354,000	
第１１回静岡県公募公債（２０年）	550,000,000	588,489,000	
第１４回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	106,589,000	
平成２７年度第１０回静岡県公募公債	400,000,000	400,988,000	
令和２年度第１５回静岡県公募公債（５年）	120,000,000	119,316,000	
令和２年度第１３回静岡県公募公債（５年）	120,000,000	119,316,000	
平成２０年度第８回愛知県公募公債（２０年）	200,000,000	212,770,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	700,000,000	756,567,000	
平成２３年度第１３回愛知県公募公債	500,000,000	513,460,000	
平成２４年度第１４回愛知県公募公債（１５年）	300,000,000	308,535,000	
平成２７年度第７回愛知県公募公債	100,000,000	100,334,000	
平成２７年度第１６回愛知県公募公債	100,000,000	100,245,000	
平成２９年度第５回愛知県公募公債	600,000,000	595,788,000	
平成３０年度第５回愛知県公募公債	100,000,000	98,684,000	
平成３０年度第８回愛知県公募公債	200,000,000	197,626,000	
令和３年度第１８回愛知県公募公債	100,000,000	95,705,000	
令和５年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	97,901,000	
令和６年度第１回愛知県公募公債（５年）	100,000,000	99,333,000	
平成２３年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	107,236,000	
平成２８年度第１回広島県公募公債	100,000,000	99,458,000	
平成２８年度第４回広島県公募公債	100,000,000	99,197,000	
平成２８年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	89,684,000	
平成３０年度第４回広島県公募公債	200,000,000	197,280,000	
令和３年度第７回広島県公募公債	100,000,000	95,529,000	
第２回埼玉県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	98,080,000	
第３回埼玉県公募公債	200,000,000	197,440,000	
第４回埼玉県公募公債	200,000,000	198,310,000	
第９回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	217,086,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	107,643,000	
第１４回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	208,324,000	
第１６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	99,863,000	

平成２９年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	99,400,000	
平成２９年度第３回埼玉県公募公債	200,000,000	198,556,000	
平成３０年度第４回埼玉県公募公債	200,000,000	197,452,000	
令和２年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	96,990,000	
令和３年度第２回埼玉県公募公債（５年）	110,000,000	109,327,900	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	70,000,000	79,899,400	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	80,000,000	87,624,000	
平成２１年度第２回福岡県公募公債（２０年）	200,000,000	217,464,000	
平成２２年度第２回福岡県公募公債（２０年）	800,000,000	871,536,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	800,000,000	821,152,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	100,259,000	
令和２年度第４回福岡県公募公債	200,000,000	193,300,000	
令和５年度第１回福岡県公募公債（グリーン）	100,000,000	97,500,000	
令和５年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	97,244,000	
令和６年度第１回福岡県公募公債（グリーン）	300,000,000	297,567,000	
令和６年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	99,969,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	80,000,000	85,576,800	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	300,000,000	318,966,000	
第１４回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	101,434,000	
平成２７年度第６回千葉県公募公債	500,000,000	501,335,000	
平成２７年度第９回千葉県公募公債	200,000,000	199,144,000	
平成２８年度第３回千葉県公募公債	400,000,000	397,320,000	
平成３０年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	97,960,000	
令和元年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	97,240,000	
令和５年度第７回千葉県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	97,689,000	
令和５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	98,675,000	
令和６年度第１回千葉県公募公債	300,000,000	294,018,000	
平成２７年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	99,815,000	
令和４年度第１回長野県公募公債	300,000,000	287,457,000	
令和５年度第２回長野県公募公債	100,000,000	97,858,000	
令和６年度第１回長野県公募公債	200,000,000	199,168,000	
第２回群馬県公募公債（２０年）	100,000,000	108,476,000	
第７回群馬県公募公債（２０年）	100,000,000	89,084,000	
第２４回群馬県公募公債	200,000,000	190,256,000	
第３０回群馬県公募公債	300,000,000	299,907,000	

平成 2 7 年度第 1 回岐阜県公募公債	300,000,000	300,963,000	
令和 2 年度第 2 回岐阜県公募公債（5 年）	100,000,000	99,632,000	
平成 2 7 年度第 1 回大分県公募公債	203,400,000	203,947,146	
第 2 回共同発行市場公募地方債（グリーン）	200,000,000	196,624,000	
第 1 4 8 回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,685,000	
第 1 5 0 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,622,000	
第 1 5 1 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,520,000	
第 1 5 2 回共同発行市場公募地方債	700,000,000	702,135,000	
第 1 5 3 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,534,000	
第 1 5 7 回共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,540,000	
第 1 5 8 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,916,000	
第 1 5 9 回共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,980,000	
第 1 7 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,345,000	
第 1 7 3 回共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,120,000	
第 1 8 5 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,331,000	
第 1 9 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,536,000	
第 1 9 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,025,000	
第 2 0 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,998,000	
第 2 0 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,906,000	
第 2 0 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,942,000	
第 2 3 2 回共同発行市場公募地方債	450,000,000	432,018,000	
令和元年度第 3 回堺市公募公債	100,000,000	97,190,000	
平成 2 7 年度第 1 回長崎県公募公債	300,000,000	300,963,000	
平成 2 7 年度第 1 回佐賀県公募公債	500,000,000	501,390,000	
平成 2 9 年度第 1 回佐賀県公募公債	100,000,000	99,037,000	
令和 3 年度第 1 回佐賀県公募公債	100,000,000	95,104,000	
平成 3 0 年度第 1 回福島県公募公債	100,000,000	98,634,000	
第 2 回滋賀県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	98,091,000	
令和元年度第 2 回栃木県公募公債	100,000,000	97,112,000	
令和 2 年度第 2 回栃木県公募公債	100,000,000	96,405,000	
令和 3 年度第 1 回熊本県公募公債（5 年）	200,000,000	198,442,000	
令和 5 年度第 2 回奈良県公募公債	200,000,000	196,062,000	
令和 6 年度第 1 回奈良県公募公債（5 年）	100,000,000	99,838,000	
第 5 回大阪市公募公債（2 0 年）	100,000,000	108,002,000	
第 1 5 回大阪市公募公債（2 0 年）	100,000,000	108,903,000	
令和 2 年度第 3 回大阪市公募公債（5 年）	500,000,000	498,575,000	

令和6年度第1回大阪市公募公債（5年）	600,000,000	599,136,000	
令和6年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	198,310,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	113,348,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	106,517,000	
第9回名古屋市公募公債（30年）	90,000,000	93,781,800	
第28回名古屋市公募公債（5年）	500,000,000	497,925,000	
第33回名古屋市公募公債（5年）	300,000,000	299,568,000	
第511回名古屋市公募公債	100,000,000	96,733,000	
第1回京都市公募公債（15年）	100,000,000	100,376,000	
第3回京都市公募公債（20年）	100,000,000	102,669,000	
第5回京都市公募公債（20年）	50,000,000	52,421,500	
令和5年度第7回京都市公募公債（5年）	100,000,000	99,364,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	110,000,000	114,713,500	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	213,120,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	107,282,000	
平成23年度第4回神戸市公募公債（20年）	150,000,000	161,722,500	
令和6年度第1回神戸市公募公債（5年）	300,000,000	297,990,000	
第7回横浜市公募公債（20年）	450,000,000	461,808,000	
第19回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	215,924,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	400,000,000	401,276,000	
平成27年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	300,852,000	
第27回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	105,282,000	
第33回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	89,422,000	
第35回横浜市公募公債（20年）	500,000,000	449,395,000	
第54回横浜市公募公債（5年）	300,000,000	298,896,000	
第64回横浜市公募公債（5年）	800,000,000	794,664,000	
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）	80,000,000	86,606,400	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	107,969,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債	600,000,000	617,022,000	
令和2年度第7回札幌市公募公債	200,000,000	192,434,000	
令和3年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	99,283,000	
令和3年度第9回札幌市公募公債（5年）	500,000,000	495,645,000	
第7回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,190,000	
第12回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	108,569,000	
第62回川崎市公募公債（5年）	490,000,000	486,182,900	
第3回北九州市公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	97,689,000	

	第17回北九州市公募公債（20年）	100,000,000	103,913,000	
	令和3年度第1回北九州市公募公債（5年）	200,000,000	198,296,000	
	2020年度第9回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	199,162,000	
	2023年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	97,770,000	
	2024年度第1回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	198,710,000	
	令和3年度第4回千葉市公募公債	100,000,000	95,063,000	
	令和5年度第4回千葉市公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	98,320,000	
	第21回さいたま市公募公債	170,000,000	167,217,100	
	令和5年度第2回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,365,000	
	令和2年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	96,405,000	
	平成28年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	198,464,000	
	平成30年度第1回山梨県公募公債	100,000,000	98,807,000	
	令和2年度第1回山梨県公募公債	700,000,000	675,535,000	
	第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	106,810,000	
地方債証券 合計		49,080,400,000	49,325,597,116	
特殊債券	第19回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	500,000,000	496,805,000	
	第21回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	600,000,000	598,788,000	
	第6回神奈川県住宅供給公社債券	100,000,000	97,099,000	
	第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	30,000,000	31,517,100	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	116,073,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	140,000,000	144,957,400	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	312,702,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	34,143,900	
	第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	223,368,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	210,070,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	110,000,000	121,286,000	
	第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	317,271,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	211,950,000	
	第28回道路債券（財投機関債）	100,000,000	115,012,000	
	第33回道路債券（財投機関債）	300,000,000	347,175,000	

第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	150,000,000	161,028,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,411,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,288,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,763,000	
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,993,000	
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,461,000	
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	91,938,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,169,000	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	296,517,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	93,370,000	
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,680,000	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,847,000	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,768,000	
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	100,906,000	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,654,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	101,289,870	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,380,000	
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,189,000	
第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,356,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,062,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,496,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	298,317,000	
第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	298,194,000	
第327回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	495,630,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,650,000	

第437回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	991,170,000	
第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	295,866,000	
第467回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	984,960,000	
第1回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	53,932,000	
第4回公営企業債券（30年）（財投機関債）	100,000,000	116,706,000	
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	106,860,000	
第13回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	108,753,000	
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	87,396,000	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	85,562,400	
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	150,000,000	155,211,000	
第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）	1,000,000,000	1,054,500,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	105,770,000	
第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	319,713,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	200,000,000	211,858,000	
第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	53,256,000	
第29回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債）	500,000,000	495,650,000	
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	100,168,000	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	400,968,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,196,000	
第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	300,684,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,283,500	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,761,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	674,000,000	670,710,880	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	102,000,000	101,448,180	
F90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,824,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	1,500,000,000	1,489,710,000	
第94回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,367,000	
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	325,000,000	321,529,000	
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,152,000	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	131,000,000	129,773,840	

第108回政府保証地方公共団体金融機構債券	223,000,000	220,056,400	
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,550,000	
F131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	73,407,600	
F134回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	308,853,000	
F151回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,788,000	
F203回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	203,810,000	
F234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,483,000	
第27回首都高速道路	100,000,000	99,542,000	
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	86,520,000	
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	85,704,000	
第48回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	397,200,000	
第54回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	98,578,000	
第4回中部国際空港（財投機関債）	200,000,000	198,818,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	28,157,000	27,818,552	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	29,447,000	29,142,223	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	34,058,000	33,584,934	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	48,742,000	47,838,323	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,733,000	18,407,917	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,674,000	18,310,440	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,003,000	18,641,746	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,486,000	18,103,780	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,220,000	34,276,063	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,502,000	35,541,200	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,862,000	19,393,908	
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,530,000	37,251,102	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,679,000	22,317,446	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,288,000	85,141,747	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,114,000	52,688,822	
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,711,000	15,144,680	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,590,000	32,580,978	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,298,000	33,234,964	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,476,000	34,390,899	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,296,000	36,262,051	

第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,880,000	38,806,544	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,036,000	41,000,467	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,406,000	22,920,441	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,606,000	23,142,440	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,964,000	49,110,339	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,390,000	49,316,184	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,156,000	49,930,207	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,806,000	28,147,457	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,141,000	27,360,570	
第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,576,000	190,882,178	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,071,000	91,619,247	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,534,000	28,922,918	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,083,000	32,555,903	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,975,000	27,311,108	
第77回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	30,783,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,166,000	28,339,784	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,743,000	31,832,832	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,225,000	34,193,513	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,912,000	133,676,314	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,800,000	69,630,386	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	107,057,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,457,000	37,132,247	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,743,000	114,289,267	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,977,000	40,050,919	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	205,408,000	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,894,000	50,712,892	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,362,000	47,994,178	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,740,000	49,702,874	
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	214,646,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,632,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,951,000	52,529,930	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,260,000	107,769,155	
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,984,000	110,646,976	

第 1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	248,076,000	233,459,362	
第 1 1 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	314,810,000	293,783,840	
第 1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	512,000,000	476,042,240	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,596,000	124,902,780	
第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	460,586,000	434,613,555	
第 1 2 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	332,645,000	311,708,323	
第 1 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機 関債）	130,000,000	137,257,900	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	205,182,000	192,483,286	
第 1 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機 関債）	100,000,000	106,625,000	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,940,000	63,558,549	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,279,000	65,515,489	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,770,000	64,275,880	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,220,000	132,125,432	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,352,000	131,916,754	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,207,000	65,330,421	
第 1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,656,000	64,851,825	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,574,000	198,080,704	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,643,000	66,514,794	
第 1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,542,000	67,560,540	
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	292,004,000	272,460,172	
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,468,000	135,167,150	
第 1 4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機 関債）	100,000,000	102,428,000	
第 1 4 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,500,000	139,583,690	
第 1 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	232,845,000	210,484,894	
第 1 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	237,174,000	215,434,631	
第 1 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,944,000	146,602,280	
第 1 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,832,000	73,173,212	
第 1 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,780,000	147,306,636	
第 1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,843,000	75,930,580	
第 1 6 1 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機 関債）	100,000,000	100,652,000	
第 1 6 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,044,000	153,733,372	
第 1 6 4 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機 関債）	100,000,000	100,234,000	
第 1 6 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,776,000	77,529,347	

第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,982,000	233,711,401	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,176,000	158,452,576	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,112,000	158,200,132	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,312,000	159,369,126	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,231,000	79,282,511	
第174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	176,421,600	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,385,000	81,536,997	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,878,000	161,477,648	
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,316,000	162,996,872	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,019,000	82,036,349	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,240,000	164,615,808	
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,772,000	82,896,362	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,382,000	83,349,376	
第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,666,000	168,279,225	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,358,000	168,307,316	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,384,000	169,684,907	
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,862,000	87,507,577	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,762,000	179,256,614	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,558,000	90,805,523	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,328,000	91,047,272	
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	376,588,000	366,254,425	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,070,000	91,742,550	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,382,000	91,881,480	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,138,000	
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,740,000	186,310,071	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	290,640,000	281,961,489	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,238,000	189,284,931	
第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,592,000	191,338,421	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	389,528,000	380,736,353	
第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,231,000	286,413,282	
第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	295,068,000	285,832,371	
第202回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,921,000	96,835,745	
第203回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	396,920,000	390,061,222	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,366,000	

	第204回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	299,646,000	296,991,136	
	第205回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,744,000	
	第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,502,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	50,863,000	
	い第843号商工債券	200,000,000	199,416,000	
	い第848号商工債券	100,000,000	99,414,000	
	い第850号商工債券	300,000,000	297,909,000	
	い第852号商工債券	100,000,000	99,117,000	
	い第854号商工債券	500,000,000	494,950,000	
	い第857号商工債券	100,000,000	98,845,000	
	い第871号商工債券	200,000,000	197,468,000	
	い第872号商工債券	400,000,000	396,076,000	
	い第885号商工債券	400,000,000	396,152,000	
	第376回信金中金債	100,000,000	99,319,000	
	第32号商工債券（10年）	200,000,000	193,148,000	
	第280号商工債券（3年）	200,000,000	198,728,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,224,000	
	第7回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	75,527,200	
	第83回東日本高速道路	400,000,000	396,820,000	
	第111回東日本高速道路	200,000,000	199,036,000	
	第29回西日本高速道路	200,000,000	199,704,000	
	第56回西日本高速道路	900,000,000	896,895,000	
	第61回西日本高速道路	700,000,000	694,302,000	
	第87回西日本高速道路	500,000,000	500,115,000	
	第88回西日本高速道路	200,000,000	200,034,000	
	第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,150,000	
特殊債券 合計		39,800,279,000	39,496,915,621	
社債券	第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,447,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,896,000	
	第35回フランス相互信用連合銀行	500,000,000	494,235,000	
	第38回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	300,573,000	
	第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,540,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,442,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	198,328,000	
	第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	400,000,000	400,004,000	

第1回サントンデール銀行（2019）	500,000,000	499,555,000	
第12回新関西国際空港	100,000,000	101,495,000	
第27回新関西国際空港	100,000,000	99,328,000	
第32回成田国際空港	100,000,000	97,721,000	
第1回国際石油開発帝石	100,000,000	99,254,000	
第27回大林組（サステナビリティ）	100,000,000	100,018,000	
第48回鹿島建設（サステナビリティ）	100,000,000	99,474,000	
第10回明治ホールディングス（サステナビリティ）	200,000,000	198,384,000	
第16回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,334,000	
第19回アサヒグループホールディングス	400,000,000	398,744,000	
第21回麒麟ホールディングス（ソーシャル）	300,000,000	296,808,000	
第22回麒麟ホールディングス（ソーシャル）	100,000,000	99,448,000	
第9回サントリーホールディングス	500,000,000	495,970,000	
第22回味の素	100,000,000	99,756,000	
第3回 キューピー	100,000,000	99,632,000	
第13回日本たばこ産業	400,000,000	392,836,000	
第16回日本たばこ産業	300,000,000	292,470,000	
第6回ヒューリック	400,000,000	392,600,000	
第14回ヒューリック	300,000,000	299,181,000	
第24回森ヒルズリート投資法人（グリーン）	300,000,000	297,987,000	
第9回クラレ	100,000,000	99,127,000	
第56回住友化学	200,000,000	196,206,000	
第59回住友化学	200,000,000	194,770,000	
第3回三菱ケミカルグループ	500,000,000	496,755,000	
第4回野村総合研究所	100,000,000	98,386,000	
第12回野村総合研究所	200,000,000	198,020,000	
第6回花王	200,000,000	199,242,000	
第1回アステラス製薬	400,000,000	399,012,000	
第10回テルモ	300,000,000	299,679,000	
第17回Zホールディングス	100,000,000	99,018,000	
第22回Zホールディングス	200,000,000	197,494,000	
第7回住友三井オートサービス（サステナビリティ）	100,000,000	98,816,000	
第8回住友三井オートサービス（サステナビリティ）	100,000,000	99,695,000	
第12回日本電気硝子	100,000,000	98,253,000	

第４回新日本製鐵	200,000,000	198,222,000	
第３６回ジェイ エフ イー ホールディングス	400,000,000	395,856,000	
第１回住友生命２０２３基金	400,000,000	394,168,000	
第１４回ＬＩＸＩＬ	200,000,000	197,940,000	
第１回日本郵政（グリーン）	100,000,000	98,680,000	
第４回日本郵政	500,000,000	496,820,000	
第９回住友重機械工業	200,000,000	199,452,000	
第３０回ダイキン工業	200,000,000	195,610,000	
第２２回パナソニック	100,000,000	98,152,000	
第２４回パナソニックホールディングス	300,000,000	297,675,000	
第２５回パナソニックホールディングス	800,000,000	799,488,000	
第４０回ソニーグループ	600,000,000	595,716,000	
第１５回デンソー	300,000,000	296,913,000	
第１８回デンソー	300,000,000	295,857,000	
第４０回三菱重工業	300,000,000	296,190,000	
第２９回ＪＡ三井リース	400,000,000	400,864,000	
第２６回トヨタ自動車（サステナビリティ）	800,000,000	793,816,000	
第２７回トヨタ自動車（サステナビリティ）	600,000,000	572,418,000	
第３１回トヨタ自動車（サステナビリティ）	200,000,000	192,562,000	
第６回ヤマハ発動機	100,000,000	99,921,000	
第１回明治安田生命２０１９基金	200,000,000	199,950,000	
第７回アシックス	100,000,000	99,473,000	
第６３回三井物産	400,000,000	419,852,000	
第４０回住友商事	200,000,000	215,706,000	
第５１回住友商事	100,000,000	101,813,000	
第５３回住友商事	300,000,000	297,024,000	
第５５回住友商事	500,000,000	492,440,000	
第６１回住友商事	100,000,000	99,749,000	
第４４回丸井グループ	100,000,000	98,635,000	
第１０１回クレディセゾン	500,000,000	498,695,000	
第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	300,000,000	299,829,000	
第１７回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	500,000,000	487,620,000	
第２３回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	216,476,000	
第２６回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	202,896,000	
第２９回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	203,842,000	
第３０回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	106,251,000	

第 8 8 回三菱東京UFJ 銀行	100,000,000	104,634,000	
第 1 5 回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	97,340,000	
第 1 8 回みずほ銀行（劣後特約付）	100,000,000	102,377,000	
第 3 8 回芙蓉総合リース（サステナビリティ）	400,000,000	399,052,000	
第 4 0 回芙蓉総合リース（サステナビリティ）	100,000,000	99,089,000	
第 7 回みずほリース	500,000,000	492,200,000	
第 9 回みずほリース	300,000,000	292,545,000	
第 1 2 回みずほリース	200,000,000	195,354,000	
第 2 1 回みずほリース	300,000,000	297,072,000	
第 2 2 回みずほリース（サステナビリティ）	300,000,000	297,981,000	
第 2 3 回みずほリース	200,000,000	198,142,000	
第 1 6 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,200,000,000	1,194,396,000	
第 1 7 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	295,725,000	
第 1 8 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,500,000,000	1,451,610,000	
第 2 5 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	300,000,000	295,761,000	
第 2 6 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	500,000,000	484,010,000	
第 2 8 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	300,000,000	298,086,000	
第 2 9 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	300,000,000	299,079,000	
第 3 0 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	200,000,000	199,496,000	
第 3 2 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	400,000,000	402,140,000	
第 3 4 回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	302,769,000	
第 5 3 回日産フィナンシャルサービス	300,000,000	296,298,000	
第 5 6 回日産フィナンシャルサービス	500,000,000	495,320,000	
第 5 7 回日産フィナンシャルサービス	400,000,000	392,576,000	
第 5 8 回日産フィナンシャルサービス	100,000,000	99,633,000	
第 3 0 回東京センチュリー	100,000,000	98,292,000	
第 3 4 回東京センチュリー	300,000,000	292,800,000	
第 1 0 2 回トヨタファイナンス	700,000,000	697,858,000	
第 1 0 3 回トヨタファイナンス	300,000,000	297,945,000	
第 2 2 回ポケットカード	100,000,000	99,470,000	
第 2 3 回ポケットカード	200,000,000	196,906,000	
第 2 4 回ポケットカード	300,000,000	297,768,000	
第 2 0 9 回オリックス	500,000,000	494,890,000	

第220回オリックス	400,000,000	397,664,000	
第222回オリックス	500,000,000	495,085,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	300,000,000	299,418,000	
第2回三菱HCキャピタル	500,000,000	492,995,000	
第40回大和証券グループ本社	500,000,000	498,130,000	
第3回野村ホールディングス	200,000,000	197,452,000	
第24回野村ホールディングス	100,000,000	101,611,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	101,688,000	
第83回三井不動産（グリーン）	200,000,000	191,938,000	
第142回三菱地所（サステナビリティ）	200,000,000	197,870,000	
第143回三菱地所	100,000,000	96,760,000	
第111回住友不動産（グリーン）	100,000,000	99,126,000	
第76回東京急行電鉄	200,000,000	205,538,000	
第36回京王電鉄	200,000,000	198,050,000	
第53回東日本旅客鉄道	300,000,000	318,840,000	
第71回東日本旅客鉄道	400,000,000	424,692,000	
第100回東日本旅客鉄道	200,000,000	198,364,000	
第163回東日本旅客鉄道	600,000,000	595,266,000	
第73回西日本旅客鉄道	400,000,000	396,812,000	
第42回東海旅客鉄道	100,000,000	107,056,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	105,533,000	
第28回東京地下鉄	300,000,000	294,915,000	
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	196,972,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	198,732,000	
第68回名古屋鉄道（サステナビリティ）	200,000,000	196,864,000	
第1回横浜高速鉄道	300,000,000	299,943,000	
第20回三菱倉庫	100,000,000	98,778,000	
第31回KDDI（サステナビリティ）	200,000,000	198,088,000	
第9回ソフトバンク	600,000,000	587,892,000	
第13回ソフトバンク	500,000,000	465,455,000	
第16回ソフトバンク	500,000,000	462,670,000	
第21回ソフトバンク	700,000,000	690,816,000	
第22回ソフトバンク	300,000,000	292,791,000	
第25回ソフトバンク	600,000,000	601,122,000	
第26回ソフトバンク	500,000,000	500,670,000	
第548回東京電力	100,000,000	102,145,000	

第567回東京電力	100,000,000	99,931,000	
第566回中部電力	300,000,000	291,603,000	
第508回関西電力	200,000,000	198,748,000	
第510回関西電力	500,000,000	496,675,000	
第511回関西電力	100,000,000	99,005,000	
第518回関西電力	200,000,000	197,142,000	
第524回関西電力	200,000,000	197,190,000	
第400回中国電力	200,000,000	197,742,000	
第409回中国電力	200,000,000	196,750,000	
第446回中国電力	100,000,000	97,545,000	
第448回中国電力	200,000,000	192,914,000	
第322回北陸電力	100,000,000	99,129,000	
第492回東北電力	300,000,000	297,873,000	
第494回東北電力	200,000,000	198,524,000	
第527回東北電力	400,000,000	380,712,000	
第552回東北電力	400,000,000	399,976,000	
第449回九州電力	300,000,000	297,996,000	
第451回九州電力	300,000,000	298,020,000	
第468回九州電力	100,000,000	98,408,000	
第471回九州電力	300,000,000	294,702,000	
第484回九州電力	400,000,000	388,256,000	
第503回九州電力	600,000,000	594,828,000	
第524回九州電力	300,000,000	291,918,000	
第50回電源開発	200,000,000	198,360,000	
第57回電源開発	100,000,000	98,210,000	
第59回電源開発	300,000,000	294,834,000	
第64回電源開発	600,000,000	586,146,000	
第67回電源開発	200,000,000	193,150,000	
第86回電源開発	100,000,000	96,637,000	
第87回電源開発（グリーン）	200,000,000	194,196,000	
第89回電源開発（グリーン）	200,000,000	194,034,000	
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,990,000	
第13回東京電力パワーグリッド	300,000,000	297,693,000	
第15回東京電力パワーグリッド	100,000,000	97,900,000	
第25回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,656,000	
第28回東京電力パワーグリッド	400,000,000	397,516,000	

第3 1回東京電力パワーグリッド	300,000,000	297,297,000	
第3 3回東京電力パワーグリッド	700,000,000	698,005,000	
第3 5回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,883,000	
第3 9回東京電力パワーグリッド	400,000,000	396,132,000	
第4 7回東京電力パワーグリッド	200,000,000	190,382,000	
第4 9回東京電力パワーグリッド	400,000,000	397,588,000	
第1 6回J E R A	200,000,000	198,412,000	
第1 7回J E R A	400,000,000	396,124,000	
第2 1回J E R A	200,000,000	197,958,000	
第2 2回J E R A	1,000,000,000	994,830,000	
第2 3回J E R A	100,000,000	96,961,000	
第2 5回J E R A	400,000,000	396,368,000	
第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	400,000,000	399,148,000	
第5 1回大阪ガス	100,000,000	96,528,000	
第5 3回大阪ガス	300,000,000	300,039,000	
第1 3回広島ガス	200,000,000	195,940,000	
第7回ファーストリテイリング	100,000,000	98,737,000	
社債券 合計	57,500,000,000	56,953,100,000	
合計	977,979,679,000	934,581,642,067	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024 年 6 月 25 日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	4,188,611,259
コール・ローン	4,412,479,219
国債証券	654,894,548,669
派生商品評価勘定	59,524,162
未収入金	2,703,610
未収利息	4,696,244,062
前払費用	685,848,739
流動資産合計	668,939,959,720

資産合計	668,939,959,720
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	607,130
未払金	1,116,842,855
未払解約金	657,395,965
流動負債合計	1,774,845,950
負債合計	1,774,845,950
純資産の部	
元本等	
元本	238,956,530,761
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	428,208,583,009
元本等合計	667,165,113,770
純資産合計	667,165,113,770
負債純資産合計	668,939,959,720

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年6月25日現在]
1. 期首	2023年6月27日
期首元本額	188,907,060,645円
期中追加設定元本額	76,196,962,982円
期中一部解約元本額	26,147,492,866円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	272,861,072円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	684,585,110円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	468,180,025円
三菱UFJ 外国債券オープン	803,132,037円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	2,024,699,819円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	6,180,457,517円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	5,199,409,145円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	514,026,278円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	95,594,882円
ファンド・マネジャー（海外債券）	640,481,128円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,459,595,665円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,418,048,530円

eMAXIS バランス (波乗り型)	209, 598, 341 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1, 061, 999, 965 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	415, 927, 659 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	252, 139, 895 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	173, 412, 934 円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	51, 446, 952, 504 円
海外債券セレクション (ラップ向け)	3, 238, 672, 711 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	12, 878, 846, 143 円
つみたて8資産均等バランス	6, 450, 369, 007 円
つみたて4資産均等バランス	2, 435, 532, 461 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4, 928, 325 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3, 715, 493 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	683, 734 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	238, 435, 014 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	169, 443, 785 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	97, 910, 659 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	784, 517, 635 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1, 300, 905, 235 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	2, 158, 606, 583 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国債券)	2, 654, 868, 240 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	87, 225, 302 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	176, 424, 646 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	42, 752, 136 円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	3, 314, 397, 543 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	47, 261, 424 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	15, 716, 646 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	26, 743, 614 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	548, 536 円
三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金)	3, 173, 827, 727 円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	16, 044, 649, 207 円
ワールド・インカムオープン	948, 044, 357 円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15, 385, 471, 177 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	390, 712, 134 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	2, 385, 917, 710 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1, 007, 598, 752 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	544, 595, 658 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	300, 147, 046 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	570, 517, 987 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	237, 256, 740 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	87, 151, 180 円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	960, 251, 360 円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	9, 894, 082 円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	881, 930, 431 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	11, 176, 618 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1, 405, 399, 508 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限	1, 064, 944, 506 円

定)	
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	49,058,405,814 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	438,430,512 円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	377,142 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	100,444 円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,160,108,328 円
アドバンスト・バランスⅠ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	31,727,206 円
アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	55,568,872 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	1,022,914,625 円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	34,644,652 円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	4,334,448,194 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）	531,396,236 円
外国債券インデックスファンドV（適格機関投資家限定）	25,367,800 円
海外債券インデックスファンドS	5,921,611,828 円
グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）	4,065,032 円
MUAM グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	12,357,414,449 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,551,725 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	2,520,300 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	500,931 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	852,500 円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	4,222,358 円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	3,469,445 円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	7,451,285 円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	3,338,316 円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	8,817,629 円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,752,311,981 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）	182,938,334 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）	525,056,310 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）	439,979,520 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	187,845,435 円
合計	238,956,530,761 円
2. 受益権の総数	238,956,530,761 口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 6 月 27 日 至 2024 年 6 月 25 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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。
	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。
	また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 6 月 25 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 6 月 25 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	5,949,526,433
合計	5,949,526,433

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024 年 6 月 25 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	3,397,851,700	—	3,455,316,460	57,464,760
	カナダドル	8,169,140	—	8,177,729	8,589
	オーストラリアドル	7,430,080	—	7,429,989	△91

	イギリスポンド	28,308,100	—	28,340,400	32,300
	マレーシアリンギット	21,363,300	—	21,338,226	△25,074
	ポーランドズロチ	8,294,769	—	8,377,404	82,635
	オフショア元	183,679,062	—	184,769,324	1,090,262
	ユーロ	176,140,766	—	176,404,417	263,651
合計		3,831,236,917	—	3,890,153,949	58,917,032

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- ①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
- ②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[2024 年 6 月 25 日現在]
1 口当たり純資産額	2.7920 円
(1 万口当たり純資産額)	(27,920 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 250731	5,800,000.00	5,507,167.97	
		0.25 T-NOTE 250831	6,700,000.00	6,336,996.07	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,163,742.21	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,678,781.25	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,519,986.35	
		0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,947,001.98	
		0.375 T-NOTE 260131	11,700,000.00	10,902,023.49	

0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,314,623.02	
0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,410,882.77	
0.5 T-NOTE 260228	9,900,000.00	9,218,408.16	
0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,723,743.76	
0.5 T-NOTE 270531	5,490,000.00	4,896,608.18	
0.5 T-NOTE 270630	5,900,000.00	5,248,580.05	
0.5 T-NOTE 270831	6,650,000.00	5,879,535.11	
0.5 T-NOTE 271031	8,590,000.00	7,551,817.92	
0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,296,529.31	
0.625 T-NOTE 270331	3,800,000.00	3,421,484.35	
0.625 T-NOTE 271130	8,780,000.00	7,733,087.90	
0.625 T-NOTE 271231	8,630,000.00	7,579,230.09	
0.625 T-NOTE 300515	14,210,000.00	11,544,514.91	
0.625 T-NOTE 300815	17,350,000.00	13,980,982.36	
0.75 T-NOTE 260331	13,590,000.00	12,673,471.23	
0.75 T-NOTE 260430	9,200,000.00	8,556,359.35	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,604,378.89	
0.75 T-NOTE 260831	10,100,000.00	9,292,000.00	
0.75 T-NOTE 280131	9,950,000.00	8,756,000.00	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,699,708.97	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,208,203.10	
0.875 T-NOTE 301115	22,310,000.00	18,153,019.64	
1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	8,012,504.84	
1.125 T-BOND 400515	6,890,000.00	4,338,412.31	
1.125 T-BOND 400815	9,380,000.00	5,849,309.36	
1.125 T-NOTE 261031	10,450,000.00	9,650,125.96	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,699,710.93	
1.125 T-NOTE 280229	9,760,000.00	8,688,687.54	
1.125 T-NOTE 280831	16,430,000.00	14,431,765.48	
1.125 T-NOTE 310215	17,120,000.00	14,092,234.35	
1.25 T-BOND 500515	10,720,000.00	5,493,162.55	
1.25 T-NOTE 261130	11,360,000.00	10,500,456.27	
1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,566,101.54	
1.25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,880,763.64	
1.25 T-NOTE 280430	9,740,000.00	8,674,307.05	
1.25 T-NOTE 280531	9,750,000.00	8,665,883.75	

1. 25 T-NOTE 280630	9, 680, 000. 00	8, 584, 950. 00	
1. 25 T-NOTE 280930	10, 700, 000. 00	9, 428, 748. 08	
1. 25 T-NOTE 310815	19, 990, 000. 00	16, 334, 406. 90	
1. 375 T-BOND 401115	9, 910, 000. 00	6, 401, 434. 16	
1. 375 T-BOND 500815	11, 180, 000. 00	5, 910, 988. 30	
1. 375 T-NOTE 260831	3, 800, 000. 00	3, 543, 945. 32	
1. 375 T-NOTE 281031	9, 050, 000. 00	8, 004, 123. 98	
1. 375 T-NOTE 281231	8, 700, 000. 00	7, 663, 986. 33	
1. 375 T-NOTE 311115	20, 320, 000. 00	16, 646, 525. 00	
1. 5 T-NOTE 260815	9, 740, 000. 00	9, 117, 933. 56	
1. 5 T-NOTE 270131	13, 540, 000. 00	12, 542, 747. 31	
1. 5 T-NOTE 281130	9, 700, 000. 00	8, 610, 455. 06	
1. 5 T-NOTE 300215	9, 680, 000. 00	8, 351, 646. 89	
1. 625 T-BOND 501115	11, 410, 000. 00	6, 447, 987. 13	
1. 625 T-NOTE 260215	9, 760, 000. 00	9, 270, 856. 22	
1. 625 T-NOTE 260515	7, 670, 000. 00	7, 242, 157. 81	
1. 625 T-NOTE 260930	5, 500, 000. 00	5, 152, 382. 84	
1. 625 T-NOTE 261031	3, 350, 000. 00	3, 130, 417. 95	
1. 625 T-NOTE 261130	3, 400, 000. 00	3, 171, 562. 50	
1. 625 T-NOTE 290815	7, 050, 000. 00	6, 203, 173. 81	
1. 625 T-NOTE 310515	17, 540, 000. 00	14, 822, 327. 66	
1. 75 T-BOND 410815	14, 850, 000. 00	10, 050, 433. 66	
1. 75 T-NOTE 261231	4, 700, 000. 00	4, 391, 011. 70	
1. 75 T-NOTE 290131	10, 040, 000. 00	8, 980, 505. 50	
1. 75 T-NOTE 291115	5, 150, 000. 00	4, 542, 259. 77	
1. 875 T-BOND 410215	10, 700, 000. 00	7, 490, 835. 88	
1. 875 T-BOND 510215	12, 560, 000. 00	7, 563, 474. 99	
1. 875 T-BOND 511115	12, 630, 000. 00	7, 565, 172. 71	
1. 875 T-NOTE 260630	5, 100, 000. 00	4, 826, 472. 66	
1. 875 T-NOTE 260731	5, 500, 000. 00	5, 195, 136. 70	
1. 875 T-NOTE 270228	9, 120, 000. 00	8, 516, 690. 65	
1. 875 T-NOTE 290228	7, 800, 000. 00	7, 006, 289. 08	
1. 875 T-NOTE 320215	16, 860, 000. 00	14, 270, 738. 65	
2 T-BOND 411115	10, 220, 000. 00	7, 184, 939. 41	
2 T-BOND 500215	8, 590, 000. 00	5, 374, 286. 50	
2 T-BOND 510815	12, 060, 000. 00	7, 468, 249. 17	

2 T-NOTE 250815	8,600,000.00	8,315,460.91	
2 T-NOTE 261115	8,680,000.00	8,175,135.95	
2.125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,762,109.40	
2.25 T-BOND 410515	9,320,000.00	6,895,525.76	
2.25 T-BOND 460815	5,730,000.00	3,921,021.11	
2.25 T-BOND 490815	6,950,000.00	4,625,415.01	
2.25 T-BOND 520215	10,280,000.00	6,747,856.24	
2.25 T-NOTE 251115	10,290,000.00	9,924,222.60	
2.25 T-NOTE 260331	4,500,000.00	4,308,750.00	
2.25 T-NOTE 270215	11,010,000.00	10,391,977.75	
2.25 T-NOTE 270815	9,390,000.00	8,787,719.57	
2.25 T-NOTE 271115	7,500,000.00	6,991,406.25	
2.375 T-BOND 420215	8,920,000.00	6,641,218.74	
2.375 T-BOND 491115	6,600,000.00	4,511,460.95	
2.375 T-BOND 510515	12,850,000.00	8,715,914.06	
2.375 T-NOTE 260430	4,000,000.00	3,832,812.48	
2.375 T-NOTE 270515	18,570,000.00	17,513,105.90	
2.375 T-NOTE 290331	12,000,000.00	11,015,390.64	
2.375 T-NOTE 290515	8,510,000.00	7,798,284.78	
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	3,687,387.68	
2.5 T-BOND 460215	5,410,000.00	3,908,090.99	
2.5 T-BOND 460515	4,210,000.00	3,033,502.36	
2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,321,568.36	
2.5 T-NOTE 270331	7,700,000.00	7,307,029.26	
2.625 T-NOTE 251231	3,200,000.00	3,095,875.00	
2.625 T-NOTE 260131	3,900,000.00	3,767,308.58	
2.625 T-NOTE 270531	7,900,000.00	7,500,679.64	
2.625 T-NOTE 290215	9,640,000.00	8,965,011.73	
2.625 T-NOTE 290731	6,790,000.00	6,279,689.06	
2.75 T-BOND 420815	2,520,000.00	1,980,611.71	
2.75 T-BOND 421115	3,700,000.00	2,898,285.14	
2.75 T-BOND 470815	5,190,000.00	3,879,727.72	
2.75 T-BOND 471115	5,710,000.00	4,261,422.04	
2.75 T-NOTE 250831	4,050,000.00	3,944,794.93	
2.75 T-NOTE 270430	10,100,000.00	9,634,847.63	
2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,275,568.37	

2. 75 T-NOTE 280215	9, 990, 000. 00	9, 440, 550. 00	
2. 75 T-NOTE 290531	7, 160, 000. 00	6, 674, 322. 66	
2. 75 T-NOTE 320815	17, 340, 000. 00	15, 567, 052. 79	
2. 875 T-BOND 430515	4, 680, 000. 00	3, 714, 932. 80	
2. 875 T-BOND 450815	3, 500, 000. 00	2, 719, 472. 66	
2. 875 T-BOND 461115	2, 340, 000. 00	1, 801, 434. 37	
2. 875 T-BOND 490515	8, 570, 000. 00	6, 504, 496. 13	
2. 875 T-BOND 520515	10, 840, 000. 00	8, 179, 542. 16	
2. 875 T-NOTE 250731	6, 100, 000. 00	5, 960, 367. 21	
2. 875 T-NOTE 251130	3, 800, 000. 00	3, 694, 164. 07	
2. 875 T-NOTE 280515	11, 990, 000. 00	11, 353, 499. 57	
2. 875 T-NOTE 280815	10, 310, 000. 00	9, 736, 908. 95	
2. 875 T-NOTE 290430	8, 000, 000. 00	7, 508, 124. 96	
2. 875 T-NOTE 320515	17, 030, 000. 00	15, 472, 021. 00	
3 T-BOND 420515	2, 270, 000. 00	1, 861, 000. 97	
3 T-BOND 441115	3, 900, 000. 00	3, 114, 515. 62	
3 T-BOND 450515	2, 790, 000. 00	2, 219, 030. 85	
3 T-BOND 451115	2, 000, 000. 00	1, 585, 195. 32	
3 T-BOND 470215	5, 290, 000. 00	4, 156, 369. 49	
3 T-BOND 470515	3, 990, 000. 00	3, 129, 734. 17	
3 T-BOND 480215	5, 970, 000. 00	4, 662, 663. 25	
3 T-BOND 480815	7, 070, 000. 00	5, 509, 352. 71	
3 T-BOND 490215	7, 850, 000. 00	6, 109, 201. 17	
3 T-BOND 520815	9, 700, 000. 00	7, 512, 005. 81	
3 T-NOTE 250715	6, 700, 000. 00	6, 559, 355. 61	
3 T-NOTE 250930	5, 400, 000. 00	5, 270, 062. 50	
3 T-NOTE 251031	3, 300, 000. 00	3, 217, 500. 00	
3. 125 T-BOND 411115	1, 990, 000. 00	1, 674, 981. 44	
3. 125 T-BOND 420215	2, 200, 000. 00	1, 845, 851. 56	
3. 125 T-BOND 430215	3, 160, 000. 00	2, 614, 714. 85	
3. 125 T-BOND 440815	5, 680, 000. 00	4, 640, 959. 35	
3. 125 T-BOND 480515	7, 240, 000. 00	5, 778, 849. 19	
3. 125 T-NOTE 250815	5, 000, 000. 00	4, 895, 898. 45	
3. 125 T-NOTE 270831	7, 300, 000. 00	7, 016, 269. 51	
3. 125 T-NOTE 281115	14, 380, 000. 00	13, 694, 983. 96	
3. 125 T-NOTE 290831	5, 900, 000. 00	5, 586, 101. 59	

3. 25 T-BOND 420515	8, 950, 000. 00	7, 602, 605. 42	
3. 25 T-NOTE 270630	8, 090, 000. 00	7, 818, 384. 55	
3. 25 T-NOTE 290630	6, 170, 000. 00	5, 883, 914. 43	
3. 375 T-BOND 420815	6, 370, 000. 00	5, 494, 249. 40	
3. 375 T-BOND 440515	5, 380, 000. 00	4, 577, 833. 60	
3. 375 T-BOND 481115	8, 120, 000. 00	6, 769, 415. 66	
3. 375 T-NOTE 330515	16, 800, 000. 00	15, 719, 812. 41	
3. 5 T-BOND 390215	1, 490, 000. 00	1, 365, 387. 11	
3. 5 T-NOTE 250915	7, 900, 000. 00	7, 759, 281. 25	
3. 5 T-NOTE 280131	9, 030, 000. 00	8, 764, 567. 38	
3. 5 T-NOTE 280430	6, 900, 000. 00	6, 690, 843. 75	
3. 5 T-NOTE 300131	5, 800, 000. 00	5, 579, 781. 24	
3. 5 T-NOTE 300430	5, 600, 000. 00	5, 380, 156. 26	
3. 5 T-NOTE 330215	17, 690, 000. 00	16, 734, 325. 34	
3. 625 T-BOND 430815	3, 400, 000. 00	3, 017, 500. 00	
3. 625 T-BOND 440215	3, 870, 000. 00	3, 424, 723. 25	
3. 625 T-BOND 530215	9, 740, 000. 00	8, 521, 548. 78	
3. 625 T-BOND 530515	10, 160, 000. 00	8, 892, 381. 30	
3. 625 T-NOTE 260515	7, 000, 000. 00	6, 860, 820. 33	
3. 625 T-NOTE 280331	6, 000, 000. 00	5, 845, 898. 46	
3. 625 T-NOTE 280531	6, 600, 000. 00	6, 428, 296. 90	
3. 625 T-NOTE 300331	5, 500, 000. 00	5, 321, 679. 66	
3. 75 T-BOND 410815	2, 060, 000. 00	1, 898, 660. 16	
3. 75 T-BOND 431115	4, 830, 000. 00	4, 359, 829. 68	
3. 75 T-NOTE 260415	7, 000, 000. 00	6, 877, 226. 58	
3. 75 T-NOTE 281231	10, 260, 000. 00	10, 028, 749. 22	
3. 75 T-NOTE 300531	5, 600, 000. 00	5, 449, 937. 47	
3. 75 T-NOTE 300630	6, 250, 000. 00	6, 080, 566. 36	
3. 75 T-NOTE 301231	6, 660, 000. 00	6, 470, 866. 37	
3. 875 T-BOND 400815	2, 560, 000. 00	2, 419, 999. 99	
3. 875 T-BOND 430215	6, 740, 000. 00	6, 215, 412. 10	
3. 875 T-BOND 430515	6, 920, 000. 00	6, 370, 589. 85	
3. 875 T-NOTE 260115	6, 700, 000. 00	6, 600, 808. 57	
3. 875 T-NOTE 271130	6, 900, 000. 00	6, 782, 888. 64	
3. 875 T-NOTE 271231	7, 000, 000. 00	6, 881, 054. 67	
3. 875 T-NOTE 290930	6, 030, 000. 00	5, 915, 288. 65	

3. 875 T-NOTE 291130	6, 190, 000. 00	6, 072, 244. 90	
3. 875 T-NOTE 291231	5, 700, 000. 00	5, 590, 453. 12	
3. 875 T-NOTE 330815	18, 320, 000. 00	17, 798, 309. 41	
4 T-BOND 421115	6, 840, 000. 00	6, 429, 065. 65	
4 T-BOND 521115	9, 790, 000. 00	9, 167, 417. 18	
4 T-NOTE 251215	7, 750, 000. 00	7, 652, 065. 42	
4 T-NOTE 260215	8, 000, 000. 00	7, 895, 156. 24	
4 T-NOTE 270115	12, 300, 000. 00	12, 137, 361. 28	
4 T-NOTE 280229	7, 640, 000. 00	7, 541, 366. 37	
4 T-NOTE 280630	8, 990, 000. 00	8, 876, 571. 46	
4 T-NOTE 290131	10, 050, 000. 00	9, 926, 534. 13	
4 T-NOTE 291031	6, 600, 000. 00	6, 513, 503. 89	
4 T-NOTE 300228	7, 330, 000. 00	7, 232, 075. 73	
4 T-NOTE 300731	5, 400, 000. 00	5, 324, 378. 88	
4 T-NOTE 310131	6, 950, 000. 00	6, 849, 822. 28	
4 T-NOTE 340215	25, 750, 000. 00	25, 253, 105. 32	
4. 125 T-BOND 530815	10, 700, 000. 00	10, 245, 876. 90	
4. 125 T-NOTE 260615	7, 000, 000. 00	6, 923, 574. 21	
4. 125 T-NOTE 270215	9, 500, 000. 00	9, 404, 628. 93	
4. 125 T-NOTE 270930	7, 440, 000. 00	7, 371, 412. 50	
4. 125 T-NOTE 271031	6, 500, 000. 00	6, 439, 951. 18	
4. 125 T-NOTE 280731	7, 700, 000. 00	7, 638, 941. 38	
4. 125 T-NOTE 290331	11, 300, 000. 00	11, 222, 753. 87	
4. 125 T-NOTE 300831	7, 100, 000. 00	7, 046, 472. 66	
4. 125 T-NOTE 310331	12, 100, 000. 00	12, 014, 921. 87	
4. 125 T-NOTE 321115	16, 070, 000. 00	15, 936, 606. 46	
4. 25 T-BOND 390515	2, 270, 000. 00	2, 258, 295. 30	
4. 25 T-BOND 401115	1, 980, 000. 00	1, 954, 669. 91	
4. 25 T-BOND 540215	13, 340, 000. 00	13, 060, 693. 74	
4. 25 T-NOTE 251015	6, 000, 000. 00	5, 945, 976. 54	
4. 25 T-NOTE 251231	13, 580, 000. 00	13, 454, 278. 92	
4. 25 T-NOTE 260131	9, 390, 000. 00	9, 303, 435. 93	
4. 25 T-NOTE 270315	11, 800, 000. 00	11, 721, 640. 68	
4. 25 T-NOTE 290228	11, 330, 000. 00	11, 316, 280. 04	
4. 25 T-NOTE 310228	8, 180, 000. 00	8, 180, 639. 02	
4. 375 T-BOND 380215	1, 280, 000. 00	1, 298, 175. 00	

4. 375 T-BOND 391115	2, 270, 000. 00	2, 286, 581. 64	
4. 375 T-BOND 400515	2, 080, 000. 00	2, 091, 050. 00	
4. 375 T-BOND 410515	1, 960, 000. 00	1, 960, 038. 27	
4. 375 T-BOND 430815	7, 570, 000. 00	7, 453, 197. 23	
4. 375 T-NOTE 260815	7, 600, 000. 00	7, 555, 320. 27	
4. 375 T-NOTE 261215	9, 640, 000. 00	9, 596, 318. 75	
4. 375 T-NOTE 280831	7, 000, 000. 00	7, 010, 937. 50	
4. 375 T-NOTE 281130	9, 310, 000. 00	9, 337, 093. 58	
4. 375 T-NOTE 301130	6, 250, 000. 00	6, 290, 527. 37	
4. 375 T-NOTE 340515	2, 430, 000. 00	2, 455, 628. 90	
4. 5 T-BOND 360215	1, 160, 000. 00	1, 196, 839. 05	
4. 5 T-BOND 380515	1, 330, 000. 00	1, 364, 860. 55	
4. 5 T-BOND 390815	1, 880, 000. 00	1, 921, 345. 31	
4. 5 T-BOND 440215	6, 130, 000. 00	6, 135, 746. 87	
4. 5 T-NOTE 251115	7, 500, 000. 00	7, 456, 201. 19	
4. 5 T-NOTE 260331	5, 980, 000. 00	5, 950, 917. 58	
4. 5 T-NOTE 260715	6, 500, 000. 00	6, 476, 259. 79	
4. 5 T-NOTE 270415	13, 000, 000. 00	13, 000, 000. 00	
4. 5 T-NOTE 331115	19, 430, 000. 00	19, 804, 938. 37	
4. 625 T-BOND 400215	2, 100, 000. 00	2, 173, 746. 09	
4. 625 T-BOND 440515	1, 700, 000. 00	1, 732, 406. 24	
4. 625 T-BOND 540515	2, 570, 000. 00	2, 677, 217. 17	
4. 625 T-NOTE 250630	2, 450, 000. 00	2, 438, 682. 61	
4. 625 T-NOTE 260228	19, 800, 000. 00	19, 738, 898. 38	
4. 625 T-NOTE 260315	6, 000, 000. 00	5, 981, 718. 72	
4. 625 T-NOTE 260915	7, 500, 000. 00	7, 496, 337. 90	
4. 625 T-NOTE 261015	6, 800, 000. 00	6, 801, 195. 30	
4. 625 T-NOTE 261115	8, 720, 000. 00	8, 727, 153. 10	
4. 625 T-NOTE 280930	8, 030, 000. 00	8, 121, 905. 83	
4. 625 T-NOTE 290430	4, 550, 000. 00	4, 617, 894. 55	
4. 625 T-NOTE 300930	5, 700, 000. 00	5, 811, 773. 46	
4. 625 T-NOTE 310430	2, 700, 000. 00	2, 760, 750. 00	
4. 75 T-BOND 410215	2, 010, 000. 00	2, 103, 433. 60	
4. 75 T-BOND 431115	6, 220, 000. 00	6, 429, 925. 00	
4. 75 T-BOND 531115	11, 120, 000. 00	11, 818, 474. 99	
4. 75 T-NOTE 250731	7, 500, 000. 00	7, 477, 001. 92	

		4. 875 T-NOTE 251130	8, 400, 000. 00	8, 395, 078. 10	
		4. 875 T-NOTE 281031	8, 500, 000. 00	8, 685, 605. 49	
		4. 875 T-NOTE 301031	6, 100, 000. 00	6, 306, 828. 12	
		5 T-BOND 370515	1, 020, 000. 00	1, 099, 249. 21	
		5 T-NOTE 250831	8, 500, 000. 00	8, 496, 347. 63	
		5 T-NOTE 250930	7, 600, 000. 00	7, 600, 593. 71	
		5 T-NOTE 251031	9, 500, 000. 00	9, 505, 380. 89	
		5. 25 T-BOND 281115	2, 690, 000. 00	2, 793, 554. 48	
		5. 375 T-BOND 310215	1, 300, 000. 00	1, 390, 847. 65	
		6 T-BOND 260215	1, 200, 000. 00	1, 225, 921. 87	
		6. 125 T-BOND 271115	1, 160, 000. 00	1, 223, 732. 03	
		6. 25 T-BOND 300515	1, 150, 000. 00	1, 267, 964. 83	
アメリカドル合計			2, 136, 200, 000. 00	1, 928, 996, 584. 98 (307, 790, 695, 099)	
カナダドル	国債証券	0. 25 CAN GOVT 260301	2, 200, 000. 00	2, 069, 987. 48	
		0. 5 CAN GOVT 250901	2, 900, 000. 00	2, 779, 582. 16	
		0. 5 CAN GOVT 301201	4, 500, 000. 00	3, 773, 551. 50	
		1 CAN GOVT 260901	2, 500, 000. 00	2, 356, 279. 07	
		1 CAN GOVT 270601	1, 930, 000. 00	1, 795, 560. 61	
		1. 25 CAN GOVT 270301	2, 500, 000. 00	2, 349, 947. 15	
		1. 25 CAN GOVT 300601	5, 710, 000. 00	5, 080, 487. 68	
		1. 5 CAN GOVT 260601	4, 070, 000. 00	3, 896, 539. 48	
		1. 5 CAN GOVT 310601	5, 900, 000. 00	5, 237, 148. 39	
		1. 5 CAN GOVT 311201	4, 930, 000. 00	4, 339, 379. 34	
		1. 75 CAN GOVT 531201	5, 550, 000. 00	3, 963, 974. 11	
		2 CAN GOVT 280601	2, 670, 000. 00	2, 537, 292. 99	
		2 CAN GOVT 320601	5, 350, 000. 00	4, 855, 271. 64	
		2 CAN GOVT 511201	7, 140, 000. 00	5, 487, 419. 65	
		2. 25 CAN GOVT 250601	4, 360, 000. 00	4, 278, 048. 21	
		2. 25 CAN GOVT 290601	2, 210, 000. 00	2, 109, 244. 81	
		2. 25 CAN GOVT 291201	1, 000, 000. 00	951, 290. 52	
		2. 5 CAN GOVT 321201	3, 500, 000. 00	3, 287, 223. 03	
		2. 75 CAN GOVT 270901	2, 000, 000. 00	1, 955, 130. 76	
		2. 75 CAN GOVT 330601	3, 000, 000. 00	2, 864, 985. 84	
		2. 75 CAN GOVT 481201	1, 680, 000. 00	1, 528, 857. 52	
		2. 75 CAN GOVT 551201	2, 990, 000. 00	2, 693, 171. 24	

		2.75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,122,559.08	
		3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,957,290.26	
		3 CAN GOVT 340601	4,540,000.00	4,409,994.68	
		3.25 CAN GOVT 280901	2,600,000.00	2,584,742.08	
		3.25 CAN GOVT 331201	3,170,000.00	3,146,759.93	
		3.5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	2,003,412.68	
		3.5 CAN GOVT 340301	2,020,000.00	2,049,952.62	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,696,748.72	
		4 CAN GOVT 260501	3,200,000.00	3,204,691.80	
		4 CAN GOVT 290301	5,060,000.00	5,197,944.84	
		4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,301,663.11	
		4.5 CAN GOVT 251101	2,540,000.00	2,551,532.89	
		4.5 CAN GOVT 260201	5,200,000.00	5,237,370.32	
		5 CAN GOVT 370601	1,330,000.00	1,557,288.70	
		5.75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,055,709.39	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,693,950.25	
カナダドル合計			119,730,000.00	111,961,984.53 (13,081,638,272)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	3,650,000.00	3,456,670.08	
		0.5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,798,137.13	
		1 AUST GOVT 301221	4,260,000.00	3,527,439.75	
		1 AUST GOVT 311121	5,310,000.00	4,265,238.86	
		1.25 AUST GOVT 320521	5,070,000.00	4,090,030.39	
		1.5 AUST GOVT 310621	3,740,000.00	3,159,154.13	
		1.75 AUST GOVT 321121	5,090,000.00	4,222,217.25	
		1.75 AUST GOVT 510621	3,490,000.00	1,950,811.79	
		2.25 AUST GOVT 280521	2,900,000.00	2,725,469.61	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,631,474.12	
		2.75 AUST GOVT 271121	4,390,000.00	4,226,655.47	
		2.75 AUST GOVT 281121	3,040,000.00	2,896,440.89	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,804,319.70	
		2.75 AUST GOVT 350621	2,220,000.00	1,928,736.04	
		2.75 AUST GOVT 410521	2,170,000.00	1,720,214.13	
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,720,242.46	
		3 AUST GOVT 470321	2,420,000.00	1,873,090.83	
		3.25 AUST GOVT 290421	3,400,000.00	3,296,640.81	

		3. 25 AUST GOVT 390621	2, 130, 000. 00	1, 858, 581. 46	
		3. 5 AUST GOVT 341221	3, 090, 000. 00	2, 898, 600. 36	
		3. 75 AUST GOVT 340521	3, 700, 000. 00	3, 561, 539. 00	
		3. 75 AUST GOVT 370421	3, 150, 000. 00	2, 976, 279. 35	
		4. 25 AUST GOVT 260421	2, 490, 000. 00	2, 499, 506. 07	
		4. 5 AUST GOVT 330421	3, 900, 000. 00	3, 990, 312. 30	
		4. 75 AUST GOVT 270421	3, 050, 000. 00	3, 115, 798. 26	
		4. 75 AUST GOVT 540621	1, 270, 000. 00	1, 301, 567. 62	
オーストラリアドル合計			89, 050, 000. 00	79, 495, 167. 86 (8, 440, 001, 971)	
イギリス ポンド	国債証券	0. 125 GILT 260130	2, 600, 000. 00	2, 438, 904. 00	
		0. 125 GILT 280131	2, 300, 000. 00	2, 005, 535. 60	
		0. 25 GILT 310731	5, 110, 000. 00	3, 958, 231. 55	
		0. 375 GILT 261022	4, 870, 000. 00	4, 461, 845. 30	
		0. 375 GILT 301022	3, 100, 000. 00	2, 495, 872. 31	
		0. 5 GILT 290131	4, 900, 000. 00	4, 197, 104. 80	
		0. 5 GILT 611022	3, 700, 000. 00	1, 124, 405. 32	
		0. 625 GILT 250607	1, 480, 000. 00	1, 426, 172. 10	
		0. 625 GILT 350731	4, 030, 000. 00	2, 779, 837. 58	
		0. 625 GILT 501022	2, 890, 000. 00	1, 175, 738. 70	
		0. 875 GILT 291022	2, 900, 000. 00	2, 485, 916. 54	
		0. 875 GILT 330731	5, 140, 000. 00	3, 910, 255. 00	
		0. 875 GILT 460131	2, 930, 000. 00	1, 466, 758. 00	
		1 GILT 320131	5, 880, 000. 00	4, 745, 936. 16	
		1. 125 GILT 390131	4, 450, 000. 00	2, 908, 696. 66	
		1. 125 GILT 731022	1, 750, 000. 00	645, 050. 00	
		1. 25 GILT 270722	2, 530, 000. 00	2, 328, 080. 70	
		1. 25 GILT 411022	4, 250, 000. 00	2, 625, 348. 25	
		1. 25 GILT 510731	4, 930, 000. 00	2, 422, 109. 00	
		1. 5 GILT 260722	3, 630, 000. 00	3, 436, 143. 48	
		1. 5 GILT 470722	3, 160, 000. 00	1, 792, 668. 00	
		1. 5 GILT 530731	3, 920, 000. 00	2, 008, 216. 00	
		1. 625 GILT 281022	3, 470, 000. 00	3, 157, 353. 00	
		1. 625 GILT 541022	2, 470, 000. 00	1, 296, 503. 00	
		1. 625 GILT 711022	2, 530, 000. 00	1, 171, 896. 00	
		1. 75 GILT 370907	3, 340, 000. 00	2, 499, 322. 00	

	1. 75 GILT 490122	1, 780, 000. 00	1, 048, 598. 00	
	1. 75 GILT 570722	3, 230, 000. 00	1, 722, 881. 03	
	2 GILT 250907	2, 100, 000. 00	2, 036, 685. 00	
	2. 5 GILT 650722	2, 480, 000. 00	1, 580, 008. 00	
	3. 25 GILT 330131	5, 900, 000. 00	5, 571, 896. 28	
	3. 25 GILT 440122	4, 270, 000. 00	3, 565, 450. 00	
	3. 5 GILT 251022	6, 150, 000. 00	6, 056, 335. 50	
	3. 5 GILT 450122	3, 740, 000. 00	3, 219, 018. 00	
	3. 5 GILT 680722	2, 960, 000. 00	2, 433, 712. 00	
	3. 75 GILT 270307	2, 000, 000. 00	1, 971, 212. 14	
	3. 75 GILT 380129	4, 650, 000. 00	4, 384, 345. 96	
	3. 75 GILT 520722	2, 110, 000. 00	1, 841, 186. 00	
	3. 75 GILT 531022	4, 740, 000. 00	4, 112, 424. 00	
	4 GILT 311022	1, 800, 000. 00	1, 799, 889. 35	
	4 GILT 600122	2, 640, 000. 00	2, 405, 040. 00	
	4 GILT 631022	3, 080, 000. 00	2, 792, 636. 00	
	4. 125 GILT 270129	6, 900, 000. 00	6, 868, 693. 32	
	4. 125 GILT 290722	1, 000, 000. 00	1, 004, 170. 00	
	4. 25 GILT 271207	2, 450, 000. 00	2, 466, 754. 57	
	4. 25 GILT 320607	4, 290, 000. 00	4, 379, 017. 50	
	4. 25 GILT 360307	2, 910, 000. 00	2, 928, 344. 64	
	4. 25 GILT 390907	2, 430, 000. 00	2, 392, 821. 00	
	4. 25 GILT 401207	2, 420, 000. 00	2, 367, 486. 00	
	4. 25 GILT 461207	2, 930, 000. 00	2, 802, 252. 00	
	4. 25 GILT 491207	2, 470, 000. 00	2, 352, 922. 00	
	4. 25 GILT 551207	2, 770, 000. 00	2, 629, 007. 00	
	4. 375 GILT 540731	1, 780, 000. 00	1, 720, 192. 00	
	4. 5 GILT 280607	6, 460, 000. 00	6, 555, 626. 73	
	4. 5 GILT 340907	2, 300, 000. 00	2, 374, 907. 31	
	4. 5 GILT 421207	3, 190, 000. 00	3, 191, 276. 00	
	4. 625 GILT 340131	4, 220, 000. 00	4, 401, 284. 44	
	4. 75 GILT 301207	3, 650, 000. 00	3, 821, 969. 38	
	4. 75 GILT 381207	2, 310, 000. 00	2, 411, 409. 00	
	4. 75 GILT 431022	2, 820, 000. 00	2, 898, 960. 00	
	6 GILT 281207	1, 890, 000. 00	2, 046, 454. 20	
イギリスポンド合計		205, 080, 000. 00	171, 118, 763. 40	

				(34,646,416,025)	
シンガポ ールドル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	700,000.00	667,257.50	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1,050,000.00	948,465.00	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	1,090,000.00	855,650.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00	736,098.00	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00	1,493,892.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,300,000.00	1,183,650.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,560,000.00	1,543,043.50	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	780,000.00	706,145.70	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00	783,600.00	
		2.625 SINGAPORGOV 320801	700,000.00	672,980.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	980,000.00	929,040.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,480,000.00	1,394,145.20	
		2.875 SINGAPORGOV 270901	1,000,000.00	989,700.00	
		2.875 SINGAPORGOV 280801	1,000,000.00	988,300.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	1,760,000.00	1,736,592.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	1,340,000.00	1,317,890.00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	910,000.00	900,445.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	2,630,000.00	2,676,025.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	2,700,000.00	2,717,010.00	
シンガポールドル合計			24,260,000.00	23,239,928.90	
				(2,741,846,811)	
マレーシ アリング ット	国債証券	2.632 MALAYSIAGOV 310415	6,280,000.00	5,850,707.48	
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000.00	2,997,617.52	
		3.519 MALAYSIAGOV 280420	3,500,000.00	3,489,961.79	
		3.582 MALAYSIAGOV 320715	2,370,000.00	2,328,193.03	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,813,289.64	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	3,980,000.00	3,841,294.85	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3,410,000.00	3,403,691.60	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	2,400,000.00	2,397,074.28	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3,600,000.00	3,640,887.72	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	4,400,000.00	4,443,174.12	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	5,640,000.00	5,705,421.18	
		3.9 MALAYSIAGOVT 261130	2,900,000.00	2,931,796.47	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	2,960,000.00	2,987,819.55	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	1,740,000.00	1,753,650.30	

		4. 054 MALAYSIAGOV 390418	660, 000. 00	663, 960. 00	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	5, 250, 000. 00	5, 123, 914. 21	
		4. 232MALAYSIAGOV 310630	2, 550, 000. 00	2, 618, 182. 92	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	2, 600, 000. 00	2, 672, 259. 46	
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	1, 940, 000. 00	1, 972, 699. 86	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	2, 400, 000. 00	2, 490, 015. 36	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	4, 240, 000. 00	4, 410, 499. 72	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	1, 500, 000. 00	1, 556, 862. 30	
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	3, 750, 000. 00	3, 978, 514. 50	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	6, 000, 000. 00	6, 453, 096. 00	
		4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1, 650, 000. 00	1, 778, 835. 30	
		4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4, 440, 000. 00	4, 783, 120. 09	
		4. 893 MALAYSIAGOV 380608	3, 360, 000. 00	3, 680, 016. 48	
		4. 921 MALAYSIAGOV 480706	2, 720, 000. 00	3, 012, 508. 52	
		4. 935 MALAYSIAGOV 430930	1, 550, 000. 00	1, 711, 038. 95	
マレーシアリングitt合計			93, 590, 000. 00	95, 490, 103. 20 (3, 234, 584, 010)	
ニュージー ランド ドル	国債証券	0. 25 NZ GOVT 280515	2, 000, 000. 00	1, 701, 343. 50	
		1. 5 NZ GOVT 310515	1, 870, 000. 00	1, 543, 229. 99	
		1. 75 NZ GOVT 410515	600, 000. 00	384, 854. 31	
		2 NZ GOVT 320515	2, 300, 000. 00	1, 918, 090. 72	
		2. 75 NZ GOVT 370415	1, 450, 000. 00	1, 173, 219. 04	
		2. 75 NZ GOVT 510515	1, 180, 000. 00	801, 747. 61	
		3 NZ GOVT 290420	1, 700, 000. 00	1, 595, 519. 83	
		3. 5 NZ GOVT 330414	1, 900, 000. 00	1, 756, 880. 84	
		4. 25 NZ GOVT 340515	620, 000. 00	603, 611. 84	
		4. 5 NZ GOVT 270415	1, 800, 000. 00	1, 796, 259. 45	
		4. 5 NZ GOVT 300515	1, 000, 000. 00	1, 003, 163. 00	
		4. 5 NZ GOVT 350515	1, 200, 000. 00	1, 185, 108. 22	
5 NZ GOVT 540515	620, 000. 00	625, 649. 44			
ニュージーランドドル合計			18, 240, 000. 00	16, 088, 677. 79 (1, 571, 059, 386)	
スウェー デンクロ ーネ	国債証券	0. 125 SWD GOVT 310512	9, 450, 000. 00	8, 221, 645. 53	
		0. 75 SWD GOVT 280512	17, 500, 000. 00	16, 534, 130. 37	
		0. 75 SWD GOVT 291112	12, 200, 000. 00	11, 403, 531. 29	
		1 SWD GOVT 261112	8, 960, 000. 00	8, 664, 928. 56	

		1. 75 SWD GOVT 331111	11, 500, 000. 00	11, 070, 587. 58	
		2. 25 SWD GOVT 320601	6, 750, 000. 00	6, 771, 039. 07	
		3. 5 SWD GOVT 390330	6, 470, 000. 00	7, 413, 390. 70	
スウェーデンクローネ合計			72, 830, 000. 00	70, 079, 253. 10 (1, 066, 606, 232)	
ノルウェークローネ	国債証券	1. 25 NORWE GOVT 310917	4, 700, 000. 00	4, 007, 862. 72	
		1. 375 NORWE GOVT 300819	15, 770, 000. 00	13, 857, 830. 25	
		1. 5 NORWE GOVT 260219	6, 040, 000. 00	5, 803, 129. 92	
		1. 75 NORWE GOVT 270217	5, 120, 000. 00	4, 869, 632. 00	
		1. 75 NORWE GOVT 290906	4, 600, 000. 00	4, 204, 392. 18	
		2 NORWE GOVT 280426	6, 900, 000. 00	6, 507, 997. 20	
		2. 125 NORWE GOVT 320518	10, 500, 000. 00	9, 457, 796. 25	
		3 NORWE GOVT 330815	8, 700, 000. 00	8, 309, 967. 42	
		3. 5 NORWE GOVT 421006	4, 000, 000. 00	4, 021, 700. 00	
		3. 625 NORWE GOVT 340413	4, 100, 000. 00	4, 120, 585. 28	
ノルウェークローネ合計			70, 430, 000. 00	65, 160, 893. 22 (985, 884, 314)	
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	14, 550, 000. 00	12, 282, 478. 38	
		0. 25 DMK GOVT 521115	9, 730, 000. 00	5, 219, 147. 67	
		0. 5 DMK GOVT 271115	8, 100, 000. 00	7, 584, 694. 20	
		0. 5 DMK GOVT 291115	10, 550, 000. 00	9, 569, 333. 92	
		1. 75 DMK GOVT 251115	7, 490, 000. 00	7, 376, 075. 22	
		2. 25 DMK GOVT 331115	6, 800, 000. 00	6, 692, 240. 32	
		4. 5 DMK GOVT 391115	18, 500, 000. 00	22, 816, 989. 80	
デンマーククローネ合計			75, 720, 000. 00	71, 540, 959. 51 (1, 642, 580, 430)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	12, 350, 000. 00	12, 384, 086. 00	
		5. 5 MEXICAN BONOS 270304	52, 000, 000. 00	46, 229, 040. 00	
		5. 75 MEXICAN BONO 260305	65, 500, 000. 00	60, 531, 545. 97	
		7 MEXICAN BONOS 260903	42, 000, 000. 00	38, 968, 860. 00	
		7. 5 MEXICAN BONOS 270603	63, 950, 000. 00	59, 351, 995. 00	
		7. 5 MEXICAN BONOS 330526	60, 200, 000. 00	51, 470, 398. 00	
		7. 75 MEXICAN BONO 310529	68, 050, 000. 00	60, 373, 279. 50	
		7. 75 MEXICAN BONO 341123	23, 400, 000. 00	20, 083, 284. 00	
		7. 75 MEXICAN BONO 421113	57, 940, 000. 00	46, 593, 609. 80	
		8 MEXICAN BONOS 350524	5, 000, 000. 00	4, 359, 000. 00	

		8 MEXICAN BONOS 471107	47, 100, 000. 00	38, 362, 008. 00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	46, 270, 000. 00	37, 207, 095. 10	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290301	23, 420, 000. 00	21, 942, 432. 20	
		8. 5 MEXICAN BONOS 290531	48, 650, 000. 00	45, 658, 511. 50	
		8. 5 MEXICAN BONOS 381118	39, 700, 000. 00	35, 051, 924. 00	
メキシコペソ合計			655, 530, 000. 00	578, 567, 069. 07 (5, 145, 775, 512)	
イスラエル シェケル	国債証券	0. 5 ISRAEL FIXED 260227	5, 300, 000. 00	4, 987, 035. 00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	6, 620, 000. 00	5, 442, 302. 00	
		1. 3 ISRAEL FIXED 320430	4, 800, 000. 00	3, 742, 080. 00	
		1. 5 ISRAEL FIXED 370531	4, 900, 000. 00	3, 286, 675. 00	
		2 ISRAEL FIXED BO 270331	7, 000, 000. 00	6, 603, 100. 00	
		2. 25 ISRAEL FIXED 280928	3, 080, 000. 00	2, 864, 862. 00	
		2. 8 ISRAEL FIXED 521129	3, 300, 000. 00	2, 118, 765. 00	
		3. 75 ISRAEL FIXED 290228	4, 600, 000. 00	4, 505, 010. 00	
		3. 75 ISRAEL FIXED 470331	4, 680, 000. 00	3, 770, 910. 00	
		4 ISRAEL FIXED BO 350330	1, 700, 000. 00	1, 592, 305. 00	
		5. 5 ISRAEL FIXED 420131	3, 130, 000. 00	3, 320, 617. 00	
		6. 25 ISRAEL FIXED 261030	5, 000, 000. 00	5, 411, 500. 00	
イスラエルシェケル合計			54, 110, 000. 00	47, 645, 161. 00 (2, 038, 822, 200)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0. 25 POLAND 261025	8, 000, 000. 00	7, 156, 420. 00	
		1. 25 POLAND 301025	9, 190, 000. 00	7, 123, 628. 50	
		1. 75 POLAND 320425	9, 900, 000. 00	7, 516, 107. 22	
		2. 5 POLAND 260725	7, 840, 000. 00	7, 444, 205. 44	
		2. 5 POLAND 270725	6, 110, 000. 00	5, 636, 300. 86	
		2. 75 POLAND 280425	5, 760, 000. 00	5, 252, 584. 32	
		2. 75 POLAND 291025	7, 900, 000. 00	6, 918, 786. 42	
		3. 25 POLAND 250725	8, 700, 000. 00	8, 547, 843. 52	
		3. 75 POLAND 270525	4, 000, 000. 00	3, 840, 408. 00	
		5. 75 POLAND 290425	10, 600, 000. 00	10, 713, 329. 90	
		6 POLAND 331025	7, 720, 000. 00	7, 900, 794. 68	
		7. 5 POLAND 280725	8, 120, 000. 00	8, 728, 745. 84	
ポーランドズロチ合計			93, 840, 000. 00	86, 779, 154. 70 (3, 462, 462, 238)	
中国元	国債証券	1. 99 CHINA GOVT 260315	35, 000, 000. 00	35, 165, 550. 00	

2 CHINA GOVT 250615	42,000,000.00	42,143,430.00	
2.04 CHINA GOVT 270225	62,000,000.00	62,306,435.00	
2.05 CHINA GOVT 290415	12,000,000.00	12,018,000.00	
2.18 CHINA GOVT 250825	34,000,000.00	34,203,000.40	
2.18 CHINA GOVT 260815	39,000,000.00	39,321,679.80	
2.22 CHINA GOVT 250925	50,000,000.00	50,351,750.00	
2.28 CHINA GOVT 251125	34,000,000.00	34,279,670.40	
2.28 CHINA GOVT 310325	48,000,000.00	48,373,920.00	
2.3 CHINA GOVT 260515	54,000,000.00	54,568,193.40	
2.33 CHINA GOVT 251215	45,000,000.00	45,429,606.00	
2.35 CHINA GOVT 340225	26,000,000.00	26,206,154.00	
2.37 CHINA GOVT 270120	28,000,000.00	28,362,611.20	
2.37 CHINA GOVT 290115	58,000,000.00	58,915,437.20	
2.39 CHINA GOVT 261115	88,000,000.00	89,148,831.20	
2.4 CHINA GOVT 280715	63,000,000.00	63,963,011.70	
2.44 CHINA GOVT 271015	35,000,000.00	35,560,521.50	
2.46 CHINA GOVT 260215	86,000,000.00	87,001,263.60	
2.48 CHINA GOVT 270415	28,000,000.00	28,473,891.60	
2.48 CHINA GOVT 280925	18,000,000.00	18,341,908.20	
2.49 CHINA GOVT 440525	6,000,000.00	6,106,320.00	
2.5 CHINA GOVT 270725	61,000,000.00	62,097,926.80	
2.52 CHINA GOVT 330825	74,000,000.00	75,537,542.40	
2.54 CHINA GOVT 301225	65,000,000.00	66,569,951.50	
2.55 CHINA GOVT 281015	50,000,000.00	51,111,400.00	
2.6 CHINA GOVT 300915	52,000,000.00	53,396,777.20	
2.6 CHINA GOVT 320901	37,000,000.00	38,009,530.20	
2.62 CHINA GOVT 280415	71,000,000.00	72,641,299.90	
2.62 CHINA GOVT 290925	29,000,000.00	29,791,088.10	
2.62 CHINA GOVT 300625	60,000,000.00	61,653,246.00	
2.64 CHINA GOVT 280115	41,000,000.00	41,953,799.40	
2.67 CHINA GOVT 330525	52,000,000.00	53,613,825.20	
2.67 CHINA GOVT 331125	49,000,000.00	50,662,251.50	
2.68 CHINA GOVT 300521	55,000,000.00	56,707,458.50	
2.69 CHINA GOVT 260812	34,000,000.00	34,648,703.00	
2.69 CHINA GOVT 320815	48,000,000.00	49,621,516.80	
2.74 CHINA GOVT 260804	24,000,000.00	24,496,404.00	

2.75 CHINA GOVT 290615	30,000,000.00	31,008,762.00	
2.75 CHINA GOVT 320217	30,000,000.00	31,162,080.00	
2.76 CHINA GOVT 320515	37,000,000.00	38,435,292.90	
2.79 CHINA GOVT 291215	31,000,000.00	32,104,272.70	
2.8 CHINA GOVT 290324	62,000,000.00	64,154,066.00	
2.8 CHINA GOVT 300325	45,000,000.00	46,653,592.50	
2.8 CHINA GOVT 321115	29,000,000.00	30,234,411.10	
2.85 CHINA GOVT 270604	32,000,000.00	32,913,516.80	
2.88 CHINA GOVT 330225	36,000,000.00	37,803,412.80	
2.89 CHINA GOVT 311118	27,000,000.00	28,335,004.20	
2.9 CHINA GOVT 260505	24,000,000.00	24,531,988.80	
2.91 CHINA GOVT 281014	32,000,000.00	33,207,772.80	
2.99 CHINA GOVT 251015	39,000,000.00	39,697,936.20	
3 CHINA GOVT 531015	25,000,000.00	27,838,280.00	
3.01 CHINA GOVT 280513	39,000,000.00	40,598,106.90	
3.02 CHINA GOVT 251022	36,000,000.00	36,665,982.00	
3.02 CHINA GOVT 310527	39,000,000.00	41,213,296.80	
3.03 CHINA GOVT 260311	28,000,000.00	28,649,037.20	
3.12 CHINA GOVT 261205	37,000,000.00	38,249,419.70	
3.12 CHINA GOVT 521025	21,000,000.00	23,651,924.10	
3.13 CHINA GOVT 291121	24,000,000.00	25,355,671.20	
3.19 CHINA GOVT 530415	19,000,000.00	21,700,000.70	
3.22 CHINA GOVT 251206	18,000,000.00	18,426,850.20	
3.25 CHINA GOVT 260606	28,000,000.00	28,862,666.00	
3.25 CHINA GOVT 281122	25,000,000.00	26,416,552.50	
3.27 CHINA GOVT 301119	35,000,000.00	37,582,846.00	
3.28 CHINA GOVT 271203	24,000,000.00	25,190,832.00	
3.29 CHINA GOVT 290523	29,000,000.00	30,858,227.20	
3.32 CHINA GOVT 520415	21,000,000.00	24,453,044.70	
3.39 CHINA GOVT 500316	43,000,000.00	50,259,862.00	
3.52 CHINA GOVT 270504	7,000,000.00	7,371,459.90	
3.53 CHINA GOVT 511018	31,000,000.00	37,319,489.50	
3.54 CHINA GOVT 280816	13,000,000.00	13,918,099.00	
3.59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,417,640.30	
3.6 CHINA GOVT 250906	8,000,000.00	8,213,268.00	
3.61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,220,935.00	

		3. 69 CHINA GOVT 280517	15, 000, 000. 00	16, 113, 468. 00	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	23, 000, 000. 00	28, 471, 495. 30	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	39, 000, 000. 00	48, 802, 685. 10	
		3. 86 CHINA GOVT 490722	33, 000, 000. 00	41, 413, 960. 50	
		4. 08 CHINA GOVT 481022	29, 000, 000. 00	37, 404, 403. 00	
中国元合計			2, 853, 000, 000. 00	2, 975, 635, 517. 30 (65, 386, 614, 857)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 281020	1, 790, 000. 00	1, 586, 869. 01	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	3, 100, 000. 00	2, 645, 614. 40	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	2, 720, 000. 00	2, 251, 254. 24	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	1, 170, 000. 00	700, 903. 12	
		0 BEL GOVT 271022	1, 800, 000. 00	1, 641, 114. 00	
		0 BEL GOVT 311022	2, 300, 000. 00	1, 868, 379. 12	
		0 BUND 260815	5, 930, 000. 00	5, 603, 099. 85	
		0 BUND 271115	3, 100, 000. 00	2, 851, 042. 87	
		0 BUND 281115	5, 500, 000. 00	4, 955, 960. 62	
		0 BUND 290815	4, 550, 000. 00	4, 034, 842. 17	
		0 BUND 300215	4, 820, 000. 00	4, 227, 135. 18	
		0 BUND 300815	6, 660, 000. 00	5, 782, 945. 66	
		0 BUND 300815	1, 550, 000. 00	1, 346, 772. 13	
		0 BUND 310215	5, 140, 000. 00	4, 413, 671. 74	
		0 BUND 310815	5, 400, 000. 00	4, 584, 920. 38	
		0 BUND 310815	1, 900, 000. 00	1, 614, 001. 55	
		0 BUND 320215	4, 690, 000. 00	3, 931, 644. 58	
		0 BUND 350515	3, 630, 000. 00	2, 782, 266. 13	
		0 BUND 360515	4, 270, 000. 00	3, 180, 607. 71	
		0 BUND 500815	7, 470, 000. 00	3, 842, 457. 20	
		0 BUND 500815	1, 560, 000. 00	805, 807. 86	
		0 BUND 520815	5, 150, 000. 00	2, 528, 199. 91	
		0 FINNISH GOVT 260915	1, 800, 000. 00	1, 687, 164. 75	
		0 FINNISH GOVT 300915	750, 000. 00	630, 301. 87	
		0 IRISH GOVT 311018	1, 900, 000. 00	1, 558, 919. 60	
		0 ITALY GOVT 260401	3, 300, 000. 00	3, 112, 376. 85	
		0 ITALY GOVT 260801	5, 000, 000. 00	4, 667, 080. 50	
		0 NETH GOVT 260115	2, 200, 000. 00	2, 102, 994. 30	
		0 NETH GOVT 270115	1, 950, 000. 00	1, 819, 859. 18	

0 NETH GOVT 290115	2, 380, 000. 00	2, 114, 725. 20	
0 NETH GOVT 300715	2, 650, 000. 00	2, 265, 695. 67	
0 NETH GOVT 310715	2, 540, 000. 00	2, 114, 696. 22	
0 NETH GOVT 380115	2, 280, 000. 00	1, 550, 278. 33	
0 NETH GOVT 520115	3, 690, 000. 00	1, 745, 584. 27	
0 O. A. T 260225	7, 790, 000. 00	7, 397, 887. 30	
0 O. A. T 270225	8, 240, 000. 00	7, 613, 800. 20	
0 O. A. T 291125	8, 130, 000. 00	6, 957, 940. 57	
0 O. A. T 301125	8, 840, 000. 00	7, 334, 227. 54	
0 O. A. T 311125	11, 400, 000. 00	9, 161, 932. 05	
0 O. A. T 320525	6, 030, 000. 00	4, 766, 880. 82	
0 OBL 251010	4, 000, 000. 00	3, 850, 206. 00	
0 OBL 251010	1, 000, 000. 00	962, 740. 62	
0 OBL 260410	6, 910, 000. 00	6, 577, 933. 04	
0 OBL 261009	2, 900, 000. 00	2, 729, 726. 64	
0 OBL 270416	3, 830, 000. 00	3, 565, 890. 47	
0 SPAIN GOVT 250531	2, 500, 000. 00	2, 422, 875. 30	
0 SPAIN GOVT 260131	3, 000, 000. 00	2, 855, 277. 00	
0 SPAIN GOVT 270131	9, 400, 000. 00	8, 696, 090. 40	
0 SPAIN GOVT 280131	5, 320, 000. 00	4, 788, 383. 04	
0. 1 BEL GOVT 300622	3, 020, 000. 00	2, 573, 968. 65	
0. 1 SPAIN GOVT 310430	4, 360, 000. 00	3, 583, 118. 85	
0. 125 FINNISH GOV 310915	1, 070, 000. 00	880, 294. 35	
0. 125 FINNISH GOV 360415	1, 120, 000. 00	794, 659. 04	
0. 125 FINNISH GOV 520415	750, 000. 00	340, 984. 35	
0. 2 IRISH GOVT 270515	500, 000. 00	465, 027. 31	
0. 2 IRISH GOVT 301018	2, 130, 000. 00	1, 826, 534. 76	
0. 25 AUSTRIA GOVT 361020	1, 490, 000. 00	1, 058, 668. 84	
0. 25 BUND 280815	4, 640, 000. 00	4, 250, 278. 27	
0. 25 BUND 290215	4, 850, 000. 00	4, 402, 126. 75	
0. 25 FINNISH GOVT 400915	540, 000. 00	341, 118. 54	
0. 25 ITALY GOVT 280315	4, 760, 000. 00	4, 253, 399. 14	
0. 25 NETH GOVT 250715	3, 290, 000. 00	3, 192, 841. 12	
0. 25 NETH GOVT 290715	2, 950, 000. 00	2, 625, 199. 10	
0. 25 O. A. T 261125	7, 360, 000. 00	6, 888, 207. 44	
0. 35 BEL GOVT 320622	2, 940, 000. 00	2, 405, 066. 61	

0. 35 IRISH GOVT 321018	800, 000. 00	658, 090. 60	
0. 4 BEL GOVT 400622	1, 660, 000. 00	1, 061, 934. 15	
0. 4 IRISH GOVT 350515	1, 020, 000. 00	783, 849. 60	
0. 45 ITALY GOVT 290215	2, 300, 000. 00	2, 013, 733. 95	
0. 5 AUSTRIA GOVT 270420	2, 100, 000. 00	1, 965, 392. 62	
0. 5 AUSTRIA GOVT 290220	2, 050, 000. 00	1, 845, 579. 12	
0. 5 BUND 260215	6, 660, 000. 00	6, 412, 829. 08	
0. 5 BUND 270815	5, 120, 000. 00	4, 812, 761. 60	
0. 5 BUND 280215	4, 280, 000. 00	3, 992, 129. 34	
0. 5 FINNISH GOVT 260415	1, 670, 000. 00	1, 596, 518. 53	
0. 5 FINNISH GOVT 270915	700, 000. 00	650, 935. 18	
0. 5 FINNISH GOVT 280915	1, 480, 000. 00	1, 344, 091. 82	
0. 5 FINNISH GOVT 290915	1, 350, 000. 00	1, 200, 176. 72	
0. 5 FINNISH GOVT 430415	780, 000. 00	486, 002. 86	
0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 450, 000. 00	2, 341, 567. 77	
0. 5 ITALY GOVT 280715	2, 400, 000. 00	2, 145, 055. 20	
0. 5 NETH GOVT 260715	3, 970, 000. 00	3, 790, 377. 35	
0. 5 NETH GOVT 320715	2, 300, 000. 00	1, 941, 764. 21	
0. 5 NETH GOVT 400115	2, 630, 000. 00	1, 855, 944. 02	
0. 5 O. A. T 260525	10, 240, 000. 00	9, 753, 738. 64	
0. 5 O. A. T 290525	10, 330, 000. 00	9, 194, 887. 95	
0. 5 O. A. T 400525	4, 680, 000. 00	3, 024, 187. 82	
0. 5 O. A. T 440625	3, 890, 000. 00	2, 245, 799. 10	
0. 5 O. A. T 720525	2, 310, 000. 00	844, 754. 24	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	4, 580, 000. 00	3, 981, 664. 76	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	4, 340, 000. 00	3, 620, 731. 80	
0. 55 IRISH GOVT 410422	600, 000. 00	401, 277. 00	
0. 6 ITALY GOVT 310801	3, 100, 000. 00	2, 524, 868. 62	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	3, 680, 000. 00	3, 256, 087. 00	
0. 65 BEL GOVT 710622	1, 090, 000. 00	450, 111. 29	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	680, 000. 00	298, 456. 32	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	3, 800, 000. 00	3, 174, 667. 25	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	2, 480, 000. 00	2, 357, 900. 49	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	2, 940, 000. 00	2, 728, 925. 64	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	1, 570, 000. 00	891, 569. 24	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	1, 050, 000. 00	915, 207. 56	

0.75 NETH GOVT 270715	4,170,000.00	3,938,081.28	
0.75 NETH GOVT 280715	3,020,000.00	2,804,879.36	
0.75 O.A.T 280225	11,000,000.00	10,169,212.56	
0.75 O.A.T 280525	9,750,000.00	8,969,817.18	
0.75 O.A.T 281125	10,340,000.00	9,417,335.95	
0.75 O.A.T 520525	5,560,000.00	2,849,555.60	
0.75 O.A.T 530525	5,390,000.00	2,698,328.32	
0.8 BEL GOVT 250622	4,170,000.00	4,068,285.15	
0.8 BEL GOVT 270622	2,880,000.00	2,713,233.60	
0.8 BEL GOVT 280622	2,740,000.00	2,538,774.40	
0.8 SPAIN GOVT 270730	4,670,000.00	4,371,281.11	
0.8 SPAIN GOVT 290730	5,430,000.00	4,879,950.49	
0.85 AUSTRIA GOVT 200630	830,000.00	367,982.57	
0.85 ITALY GOVT 270115	3,060,000.00	2,879,039.25	
0.85 SPAIN GOVT 370730	2,470,000.00	1,789,471.77	
0.875 FINNISH GOV 250915	630,000.00	612,648.54	
0.9 AUSTRIA GOVT 320220	2,120,000.00	1,831,025.45	
0.9 BEL GOVT 290622	3,090,000.00	2,822,876.45	
0.9 IRISH GOVT 280515	1,640,000.00	1,533,115.72	
0.9 ITALY GOVT 310401	4,230,000.00	3,558,250.62	
0.95 ITALY GOVT 270915	4,000,000.00	3,715,900.00	
0.95 ITALY GOVT 300801	2,940,000.00	2,528,139.81	
0.95 ITALY GOVT 311201	4,330,000.00	3,585,460.70	
0.95 ITALY GOVT 320601	2,800,000.00	2,284,466.80	
0.95 ITALY GOVT 370301	3,020,000.00	2,104,747.47	
1 BEL GOVT 260622	2,760,000.00	2,654,519.70	
1 BEL GOVT 310622	3,430,000.00	3,030,712.84	
1 BUND 250815	5,580,000.00	5,450,901.12	
1 BUND 380515	3,810,000.00	3,113,214.81	
1 IRISH GOVT 260515	1,850,000.00	1,785,666.25	
1 O.A.T 251125	6,580,000.00	6,379,191.56	
1 O.A.T 270525	7,540,000.00	7,125,854.19	
1 SPAIN GOVT 420730	2,070,000.00	1,347,712.83	
1 SPAIN GOVT 501031	3,650,000.00	1,980,143.25	
1.1 IRISH GOVT 290515	1,610,000.00	1,495,264.86	
1.1 ITALY GOVT 270401	3,300,000.00	3,109,904.65	

1. 125 FINNISH GOV 340415	730, 000. 00	615, 992. 52	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	2, 710, 000. 00	2, 641, 823. 17	
1. 2 ITALY GOVT 250815	2, 100, 000. 00	2, 047, 012. 80	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	3, 400, 000. 00	2, 382, 794. 80	
1. 25 BEL GOVT 330422	1, 770, 000. 00	1, 542, 261. 18	
1. 25 BUND 480815	6, 260, 000. 00	4, 746, 629. 34	
1. 25 ITALY GOVT 261201	4, 080, 000. 00	3, 888, 657. 09	
1. 25 O. A. T 340525	9, 110, 000. 00	7, 662, 165. 92	
1. 25 O. A. T 360525	7, 890, 000. 00	6, 345, 066. 59	
1. 25 O. A. T 380525	4, 320, 000. 00	3, 314, 753. 28	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	4, 930, 000. 00	4, 435, 819. 26	
1. 3 IRISH GOVT 330515	860, 000. 00	760, 803. 51	
1. 3 OBL 271015	5, 750, 000. 00	5, 533, 325. 62	
1. 3 OBL 271015	800, 000. 00	770, 050. 00	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	4, 750, 000. 00	4, 566, 638. 12	
1. 35 IRISH GOVT 310318	1, 070, 000. 00	982, 403. 11	
1. 35 ITALY GOVT 300401	3, 610, 000. 00	3, 211, 798. 95	
1. 375 FINNISH GOV 270415	800, 000. 00	768, 060. 84	
1. 375 FINNISH GOV 470415	990, 000. 00	704, 958. 05	
1. 4 BEL GOVT 530622	2, 040, 000. 00	1, 265, 113. 14	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	4, 660, 000. 00	4, 401, 230. 20	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	4, 240, 000. 00	3, 991, 189. 38	
1. 45 BEL GOVT 370622	1, 220, 000. 00	995, 117. 40	
1. 45 ITALY GOVT 360301	2, 440, 000. 00	1, 869, 607. 30	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	4, 330, 000. 00	4, 123, 812. 80	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	4, 280, 000. 00	3, 996, 658. 65	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	1, 300, 000. 00	634, 546. 25	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1, 810, 000. 00	1, 314, 600. 21	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	460, 000. 00	271, 478. 89	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	750, 000. 00	672, 911. 62	
1. 5 IRISH GOVT 500515	1, 460, 000. 00	1, 035, 586. 76	
1. 5 ITALY GOVT 250601	3, 300, 000. 00	3, 240, 785. 62	
1. 5 ITALY GOVT 450430	2, 880, 000. 00	1, 802, 620. 80	
1. 5 O. A. T 310525	10, 790, 000. 00	9, 817, 574. 77	
1. 5 O. A. T 500525	6, 180, 000. 00	4, 065, 597. 97	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	4, 290, 000. 00	4, 117, 059. 37	

1. 6 BEL GOVT 470622	1, 800, 000. 00	1, 276, 365. 60	
1. 6 ITALY GOVT 260601	4, 120, 000. 00	3, 987, 696. 50	
1. 65 ITALY GOVT 301201	3, 870, 000. 00	3, 449, 020. 70	
1. 65 ITALY GOVT 320301	4, 450, 000. 00	3, 867, 919. 53	
1. 7 BEL GOVT 500622	1, 840, 000. 00	1, 282, 417. 44	
1. 7 BUND 320815	5, 530, 000. 00	5, 265, 569. 22	
1. 7 IRISH GOVT 370515	1, 190, 000. 00	1, 025, 798. 14	
1. 7 ITALY GOVT 510901	2, 900, 000. 00	1, 739, 304. 00	
1. 75 O. A. T 390625	5, 550, 000. 00	4, 509, 313. 95	
1. 75 O. A. T 660525	2, 970, 000. 00	1, 885, 479. 25	
1. 8 BUND 530815	4, 780, 000. 00	4, 000, 052. 18	
1. 8 BUND 530815	1, 000, 000. 00	838, 017. 00	
1. 8 ITALY GOVT 410301	2, 950, 000. 00	2, 105, 536. 68	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	1, 130, 000. 00	867, 190. 25	
1. 85 ITALY GOVT 250701	4, 650, 000. 00	4, 576, 225. 42	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	3, 200, 000. 00	2, 760, 764. 80	
1. 9 BEL GOVT 380622	1, 360, 000. 00	1, 153, 381. 32	
1. 9 SPAIN GOVT 521031	3, 170, 000. 00	2, 118, 782. 03	
1. 95 SPAIN GOVT 260430	3, 520, 000. 00	3, 447, 535. 94	
1. 95 SPAIN GOVT 300730	3, 790, 000. 00	3, 576, 357. 70	
2 AUSTRIA GOVT 260715	1, 000, 000. 00	980, 512. 50	
2 IRISH GOVT 450218	1, 970, 000. 00	1, 636, 932. 10	
2 ITALY GOVT 251201	3, 530, 000. 00	3, 464, 039. 93	
2 ITALY GOVT 280201	3, 880, 000. 00	3, 709, 241. 20	
2 NETH GOVT 540115	2, 030, 000. 00	1, 692, 756. 10	
2 O. A. T 321125	7, 450, 000. 00	6, 874, 537. 78	
2 O. A. T 480525	4, 970, 000. 00	3, 749, 605. 41	
2. 05 ITALY GOVT 270801	2, 650, 000. 00	2, 554, 292. 94	
2. 1 AUSTRIA GOVT 170920	950, 000. 00	700, 911. 44	
2. 1 BUND 291115	4, 460, 000. 00	4, 390, 660. 38	
2. 1 ITALY GOVT 260715	2, 350, 000. 00	2, 293, 644. 06	
2. 1 OBL 290412	4, 560, 000. 00	4, 492, 610. 03	
2. 15 BEL GOVT 660622	1, 530, 000. 00	1, 116, 974. 80	
2. 15 ITALY GOVT 520901	1, 550, 000. 00	1, 012, 549. 12	
2. 15 ITALY GOVT 720301	1, 410, 000. 00	845, 979. 55	
2. 15 SPAIN GOVT 251031	8, 000, 000. 00	7, 889, 612. 64	

2. 2 BUND 340215	5, 050, 000. 00	4, 956, 792. 15	
2. 2 ITALY GOVT 270601	3, 380, 000. 00	3, 278, 878. 30	
2. 2 OBL 280413	4, 250, 000. 00	4, 206, 363. 12	
2. 25 BEL GOVT 570622	1, 300, 000. 00	983, 867. 30	
2. 25 ITALY GOVT 360901	2, 720, 000. 00	2, 264, 454. 40	
2. 3 BUND 330215	6, 190, 000. 00	6, 153, 596. 61	
2. 3 BUND 330215	1, 670, 000. 00	1, 660, 583. 70	
2. 35 SPAIN GOVT 330730	4, 090, 000. 00	3, 820, 970. 02	
2. 4 AUSTRIA GOVT 340523	1, 690, 000. 00	1, 604, 500. 36	
2. 4 BUND 301115	2, 580, 000. 00	2, 580, 696. 60	
2. 4 IRISH GOVT 300515	1, 490, 000. 00	1, 465, 415. 00	
2. 4 OBL 281019	4, 820, 000. 00	4, 808, 389. 81	
2. 45 ITALY GOVT 330901	3, 420, 000. 00	3, 076, 820. 10	
2. 45 ITALY GOVT 500901	2, 750, 000. 00	1, 961, 190. 00	
2. 5 BUND 440704	5, 360, 000. 00	5, 242, 937. 60	
2. 5 BUND 460815	5, 660, 000. 00	5, 535, 451. 70	
2. 5 BUND 540815	2, 360, 000. 00	2, 304, 537. 29	
2. 5 ITALY GOVT 251115	2, 330, 000. 00	2, 303, 600. 51	
2. 5 ITALY GOVT 321201	3, 950, 000. 00	3, 610, 857. 93	
2. 5 NETH GOVT 300115	1, 900, 000. 00	1, 886, 082. 50	
2. 5 NETH GOVT 330115	2, 750, 000. 00	2, 714, 036. 87	
2. 5 NETH GOVT 330715	1, 910, 000. 00	1, 877, 821. 27	
2. 5 NETH GOVT 340715	1, 050, 000. 00	1, 026, 378. 53	
2. 5 O. A. T 260924	8, 300, 000. 00	8, 196, 714. 80	
2. 5 O. A. T 270924	2, 800, 000. 00	2, 758, 008. 40	
2. 5 O. A. T 300525	11, 270, 000. 00	11, 005, 799. 08	
2. 5 O. A. T 430525	3, 030, 000. 00	2, 610, 840. 40	
2. 5 SCHATS 260319	2, 500, 000. 00	2, 484, 181. 25	
2. 5 SPAIN GOVT 270531	1, 400, 000. 00	1, 379, 635. 25	
2. 55 SPAIN GOVT 321031	4, 360, 000. 00	4, 173, 719. 00	
2. 6 BUND 330815	4, 910, 000. 00	4, 992, 831. 70	
2. 6 IRISH GOVT 341018	850, 000. 00	829, 530. 93	
2. 625 FINNISH GOV 420704	940, 000. 00	866, 689. 81	
2. 65 ITALY GOVT 271201	2, 800, 000. 00	2, 741, 506. 60	
2. 7 BEL GOVT 291022	800, 000. 00	795, 620. 40	
2. 7 ITALY GOVT 470301	3, 300, 000. 00	2, 555, 380. 44	

2. 7 SPAIN GOVT 481031	3, 670, 000. 00	3, 045, 017. 05	
2. 75 BEL GOVT 390422	950, 000. 00	890, 215. 55	
2. 75 FINNISH GOVT 280704	1, 110, 000. 00	1, 109, 142. 33	
2. 75 FINNISH GOVT 380415	680, 000. 00	646, 995. 52	
2. 75 NETH GOVT 470115	3, 320, 000. 00	3, 267, 120. 70	
2. 75 O. A. T 271025	10, 320, 000. 00	10, 241, 717. 63	
2. 75 O. A. T 290225	7, 900, 000. 00	7, 832, 077. 77	
2. 75 O. A. T 300225	1, 950, 000. 00	1, 928, 425. 15	
2. 8 ITALY GOVT 281201	3, 680, 000. 00	3, 599, 224. 03	
2. 8 ITALY GOVT 290615	3, 200, 000. 00	3, 110, 592. 00	
2. 8 ITALY GOVT 670301	1, 510, 000. 00	1, 088, 009. 51	
2. 8 SCHATS 250612	3, 470, 000. 00	3, 456, 839. 15	
2. 8 SPAIN GOVT 260531	3, 500, 000. 00	3, 479, 210. 00	
2. 85 BEL GOVT 341022	1, 850, 000. 00	1, 816, 513. 15	
2. 875 FINNISH GOV 290415	600, 000. 00	601, 207. 92	
2. 9 AUSTRIA GOVT 290523	700, 000. 00	703, 172. 75	
2. 9 AUSTRIA GOVT 330220	2, 710, 000. 00	2, 700, 880. 85	
2. 9 AUSTRIA GOVT 340220	1, 470, 000. 00	1, 459, 317. 14	
2. 9 SCHATS 260618	2, 500, 000. 00	2, 505, 397. 25	
2. 9 SPAIN GOVT 461031	3, 540, 000. 00	3, 087, 588. 00	
2. 95 FINNISH GOVT 550415	670, 000. 00	636, 031. 00	
2. 95 ITALY GOVT 270215	830, 000. 00	822, 102. 64	
2. 95 ITALY GOVT 380901	2, 730, 000. 00	2, 389, 024. 36	
3 BEL GOVT 330622	2, 750, 000. 00	2, 757, 157. 42	
3 BEL GOVT 340622	2, 050, 000. 00	2, 045, 150. 72	
3 FINNISH GOVT 330915	1, 720, 000. 00	1, 723, 608. 56	
3 FINNISH GOVT 340915	700, 000. 00	698, 910. 66	
3 IRISH GOVT 431018	690, 000. 00	677, 762. 16	
3 ITALY GOVT 290801	5, 420, 000. 00	5, 316, 450. 90	
3 O. A. T 330525	6, 130, 000. 00	6, 086, 884. 64	
3 O. A. T 490625	1, 080, 000. 00	986, 115. 60	
3 O. A. T 540525	4, 370, 000. 00	3, 887, 787. 98	
3. 1 ITALY GOVT 400301	2, 310, 000. 00	2, 020, 336. 39	
3. 1 SCHATS 251212	4, 000, 000. 00	4, 005, 856. 00	
3. 15 AUSTRIA GOVT 440620	1, 250, 000. 00	1, 237, 103. 12	
3. 15 AUSTRIA GOVT 531020	1, 070, 000. 00	1, 049, 118. 95	

3. 15 SPAIN GOVT 330430	4, 400, 000. 00	4, 388, 346. 60	
3. 2 AUSTRIA GOVT 390715	400, 000. 00	400, 151. 00	
3. 2 ITALY GOVT 260128	4, 450, 000. 00	4, 434, 184. 70	
3. 25 BUND 420704	3, 640, 000. 00	3, 956, 043. 00	
3. 25 ITALY GOVT 380301	2, 220, 000. 00	2, 018, 646. 00	
3. 25 ITALY GOVT 460901	2, 740, 000. 00	2, 340, 480. 60	
3. 25 NETH GOVT 440115	1, 330, 000. 00	1, 399, 532. 40	
3. 25 O. A. T 450525	5, 600, 000. 00	5, 396, 312. 32	
3. 25 O. A. T 550525	2, 080, 000. 00	1, 932, 460. 91	
3. 25 SPAIN GOVT 340430	3, 710, 000. 00	3, 702, 449. 40	
3. 3 BEL GOVT 540622	1, 690, 000. 00	1, 609, 339. 68	
3. 35 ITALY GOVT 290701	1, 400, 000. 00	1, 394, 295. 00	
3. 35 ITALY GOVT 350301	3, 110, 000. 00	2, 955, 274. 39	
3. 4 ITALY GOVT 280401	3, 000, 000. 00	3, 006, 441. 00	
3. 45 AUSTRIA GOVT 301020	910, 000. 00	941, 086. 69	
3. 45 BEL GOVT 430622	770, 000. 00	773, 424. 96	
3. 45 ITALY GOVT 480301	3, 470, 000. 00	3, 038, 976. 82	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	2, 460, 000. 00	2, 359, 688. 58	
3. 45 SPAIN GOVT 660730	2, 800, 000. 00	2, 535, 639. 61	
3. 5 BEL GOVT 550622	1, 180, 000. 00	1, 160, 981. 09	
3. 5 ITALY GOVT 260115	2, 500, 000. 00	2, 503, 272. 50	
3. 5 ITALY GOVT 300301	4, 470, 000. 00	4, 481, 583. 11	
3. 5 ITALY GOVT 310215	2, 040, 000. 00	2, 028, 956. 05	
3. 5 O. A. T 260425	6, 690, 000. 00	6, 734, 697. 22	
3. 5 O. A. T 331125	8, 080, 000. 00	8, 320, 859. 93	
3. 5 SPAIN GOVT 290531	3, 380, 000. 00	3, 461, 610. 10	
3. 55 SPAIN GOVT 331031	4, 120, 000. 00	4, 223, 587. 09	
3. 6 ITALY GOVT 250929	2, 000, 000. 00	2, 003, 010. 00	
3. 7 ITALY GOVT 300615	2, 350, 000. 00	2, 371, 012. 52	
3. 75 BEL GOVT 450622	1, 620, 000. 00	1, 694, 368. 53	
3. 75 NETH GOVT 420115	3, 240, 000. 00	3, 620, 017. 33	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	1, 050, 000. 00	1, 179, 325. 87	
3. 8 ITALY GOVT 260415	2, 700, 000. 00	2, 720, 120. 40	
3. 8 ITALY GOVT 280801	3, 090, 000. 00	3, 140, 197. 05	
3. 85 ITALY GOVT 260915	2, 800, 000. 00	2, 830, 251. 20	
3. 85 ITALY GOVT 291215	3, 890, 000. 00	3, 962, 543. 83	

3. 85 ITALY GOVT 340701	1, 620, 000. 00	1, 615, 939. 47	
3. 85 ITALY GOVT 490901	2, 450, 000. 00	2, 269, 796. 37	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	2, 390, 000. 00	2, 468, 164. 95	
4 BEL GOVT 320328	1, 620, 000. 00	1, 739, 939. 13	
4 BUND 370104	4, 830, 000. 00	5, 580, 707. 58	
4 FINNISH GOVT 250704	240, 000. 00	241, 841. 88	
4 ITALY GOVT 301115	3, 840, 000. 00	3, 933, 920. 64	
4 ITALY GOVT 311030	1, 650, 000. 00	1, 692, 454. 50	
4 ITALY GOVT 350430	2, 150, 000. 00	2, 168, 052. 47	
4 ITALY GOVT 370201	5, 850, 000. 00	5, 857, 839. 00	
4 NETH GOVT 370115	3, 160, 000. 00	3, 539, 809. 24	
4 O. A. T 381025	4, 510, 000. 00	4, 834, 390. 77	
4 O. A. T 550425	3, 330, 000. 00	3, 574, 028. 71	
4 O. A. T 600425	3, 670, 000. 00	3, 980, 555. 40	
4 SPAIN GOVT 541031	1, 000, 000. 00	1, 013, 261. 60	
4. 05 ITALY GOVT 371030	2, 200, 000. 00	2, 193, 810. 85	
4. 1 ITALY GOVT 290201	3, 530, 000. 00	3, 634, 796. 87	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	2, 540, 000. 00	2, 811, 470. 62	
4. 15 ITALY GOVT 391001	1, 830, 000. 00	1, 818, 379. 50	
4. 2 ITALY GOVT 340301	3, 430, 000. 00	3, 526, 424. 16	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	4, 260, 000. 00	4, 588, 778. 28	
4. 25 BEL GOVT 410328	2, 940, 000. 00	3, 271, 315. 65	
4. 25 BUND 390704	3, 810, 000. 00	4, 580, 822. 43	
4. 35 ITALY GOVT 331101	3, 710, 000. 00	3, 863, 983. 55	
4. 4 ITALY GOVT 330501	3, 800, 000. 00	3, 982, 590. 00	
4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 940, 000. 00	1, 970, 467. 70	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 610, 000. 00	1, 648, 996. 61	
4. 5 ITALY GOVT 260301	3, 740, 000. 00	3, 808, 367. 20	
4. 5 ITALY GOVT 531001	2, 470, 000. 00	2, 502, 357. 00	
4. 5 O. A. T 410425	7, 070, 000. 00	8, 018, 581. 90	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	2, 890, 000. 00	2, 930, 221. 57	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	3, 450, 000. 00	3, 905, 923. 71	
4. 75 BUND 280704	2, 340, 000. 00	2, 543, 818. 68	
4. 75 BUND 340704	4, 890, 000. 00	5, 888, 255. 35	
4. 75 BUND 400704	3, 610, 000. 00	4, 611, 061. 65	
4. 75 ITALY GOVT 280901	3, 930, 000. 00	4, 141, 764. 90	

	4. 75 ITALY GOVT 440901	3, 480, 000. 00	3, 687, 223. 56	
	4. 75 O. A. T 350425	5, 130, 000. 00	5, 847, 148. 35	
	4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1, 370, 000. 00	1, 409, 696. 43	
	4. 9 SPAIN GOVT 400730	4, 370, 000. 00	5, 032, 273. 50	
	5 BEL GOVT 350328	3, 280, 000. 00	3, 842, 073. 92	
	5 ITALY GOVT 340801	4, 650, 000. 00	5, 087, 342. 73	
	5 ITALY GOVT 390801	5, 170, 000. 00	5, 626, 842. 90	
	5 ITALY GOVT 400901	3, 950, 000. 00	4, 295, 723. 75	
	5. 15 SPAIN GOVT 281031	3, 250, 000. 00	3, 539, 746. 27	
	5. 15 SPAIN GOVT 441031	2, 640, 000. 00	3, 167, 162. 32	
	5. 25 ITALY GOVT 291101	4, 660, 000. 00	5, 077, 279. 70	
	5. 5 BEL GOVT 280328	4, 910, 000. 00	5, 375, 922. 17	
	5. 5 BUND 310104	3, 650, 000. 00	4, 319, 975. 75	
	5. 5 NETH GOVT 280115	2, 180, 000. 00	2, 388, 019. 52	
	5. 5 O. A. T 290425	6, 800, 000. 00	7, 560, 104. 00	
	5. 625 BUND 280104	3, 460, 000. 00	3, 820, 483. 56	
	5. 75 ITALY GOVT 330201	4, 920, 000. 00	5, 630, 635. 45	
	5. 75 O. A. T 321025	6, 200, 000. 00	7, 403, 386. 51	
	5. 75 SPAIN GOVT 320730	4, 990, 000. 00	5, 924, 628. 99	
	5. 9 SPAIN GOVT 260730	4, 650, 000. 00	4, 910, 083. 80	
	6 ITALY GOVT 310501	5, 600, 000. 00	6, 432, 405. 84	
	6 O. A. T 251025	760, 000. 00	786, 496. 64	
	6 SPAIN GOVT 290131	4, 230, 000. 00	4, 783, 635. 93	
	6. 25 AUSTRIA GOVT 270715	1, 630, 000. 00	1, 786, 007. 30	
	6. 25 BUND 300104	1, 700, 000. 00	2, 033, 477. 95	
	6. 5 BUND 270704	2, 680, 000. 00	2, 981, 404. 31	
	6. 5 ITALY GOVT 271101	4, 970, 000. 00	5, 472, 665. 80	
	7. 25 ITALY GOVT 261101	2, 300, 000. 00	2, 503, 469. 50	
ユーロ合計		1, 283, 250, 000. 00	1, 188, 975, 195. 94 (203, 659, 561, 312)	
合計			654, 894, 548, 669 (654, 894, 548, 669)	

(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 271 銘柄	100.00%	47.00%
カナダドル	国債証券 38 銘柄	100.00%	2.00%
オーストラリアドル	国債証券 26 銘柄	100.00%	1.29%
イギリスポンド	国債証券 61 銘柄	100.00%	5.29%
シンガポールドル	国債証券 19 銘柄	100.00%	0.42%
マレーシアリンギット	国債証券 29 銘柄	100.00%	0.49%
ニュージーランドドル	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.24%
スウェーデンクローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.16%
ノルウェークローネ	国債証券 10 銘柄	100.00%	0.15%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.25%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.00%	0.79%
イスラエルシェケル	国債証券 12 銘柄	100.00%	0.31%
ポーランドズロチ	国債証券 12 銘柄	100.00%	0.53%
中国元	国債証券 78 銘柄	100.00%	9.98%
ユーロ	国債証券 381 銘柄	100.00%	31.10%

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、「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 284 条、第 307 条の規定により、「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(2024 年 6 月 26 日から 2024 年 12 月 25 日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により中間監査を受けております。

三菱UF J アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたて 4 資産均等バランスの 2024 年 6 月 26 日から 2024 年 12 月 25 日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、つみたて 4 資産均等バランスの 2024 年 12 月 25 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（2024 年 6 月 26 日から 2024 年 12 月 25 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UF J アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表

示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

【つみたて4資産均等バランス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 7 期 [2024 年 6 月 25 日現在]	第 8 期中間計算期間末 [2024 年 12 月 25 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	319,060,216	406,503,653
親投資信託受益証券	26,949,800,912	32,707,783,498
未収利息	553	2,376
流動資産合計	27,268,861,681	33,114,289,527
資産合計	27,268,861,681	33,114,289,527
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,452,027	41,952,245
未払受託者報酬	2,590,394	3,261,032
未払委託者報酬	25,903,874	32,610,252
その他未払費用	466,210	586,927
流動負債合計	49,412,505	78,410,456
負債合計	49,412,505	78,410,456
純資産の部		
元本等		
元本	15,962,654,043	19,069,730,086
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	11,256,795,133	13,966,148,985
(分配準備積立金)	5,633,576,409	5,401,776,346
元本等合計	27,219,449,176	33,035,879,071
純資産合計	27,219,449,176	33,035,879,071
負債純資産合計	27,268,861,681	33,114,289,527

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 7 期中間計算期間 自 2023 年 6 月 27 日 至 2023 年 12 月 26 日	第 8 期中間計算期間 自 2024 年 6 月 26 日 至 2024 年 12 月 25 日
営業収益		
受取利息	1,338	304,240
有価証券売買等損益	645,676,320	627,609,158
営業収益合計	645,677,658	627,913,398
営業費用		
支払利息	42,275	-
受託者報酬	2,039,730	3,261,032
委託者報酬	20,397,187	32,610,252
その他費用	367,084	586,927
営業費用合計	22,846,276	36,458,211

営業利益又は営業損失（△）	622, 831, 382	591, 455, 187
経常利益又は経常損失（△）	622, 831, 382	591, 455, 187
中間純利益又は中間純損失（△）	622, 831, 382	591, 455, 187
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（△）	11, 468, 964	△13, 767, 558
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5, 339, 116, 538	11, 256, 795, 133
剰余金増加額又は欠損金減少額	1, 128, 962, 862	2, 628, 258, 570
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1, 128, 962, 862	2, 628, 258, 570
剰余金減少額又は欠損金増加額	282, 851, 735	524, 127, 463
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	282, 851, 735	524, 127, 463
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6, 796, 590, 083	13, 966, 148, 985

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	第 7 期 [2024 年 6 月 25 日現在]	第 8 期中間計算期間末 [2024 年 12 月 25 日現在]
1. 期首元本額	11, 646, 044, 400 円	15, 962, 654, 043 円
期中追加設定元本額	5, 661, 382, 614 円	3, 853, 874, 459 円
期中一部解約元本額	1, 344, 772, 971 円	746, 798, 416 円
2. 受益権の総数	15, 962, 654, 043 口	19, 069, 730, 086 口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 7 期中間計算期間 自 2023 年 6 月 27 日 至 2023 年 12 月 26 日	第 8 期中間計算期間 自 2024 年 6 月 26 日 至 2024 年 12 月 25 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）

区分	第 7 期 [2024 年 6 月 25 日現在]	第 8 期中間計算期間末 [2024 年 12 月 25 日現在]
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあり ません。	同左
2. 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針 に係る事項に関する注記）に記載してお ります。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はあり ません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン 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)
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7期 [2024年6月25日現在]	第8期中間計算期間末 [2024年12月25日現在]
1口当たり純資産額	1.7052円	1.7324円
(1万口当たり純資産額)	(17,052円)	(17,324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)

[2024年12月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,700,883,120
株式	1,588,326,446,870
派生商品評価勘定	13,467,000
未収入金	92,030,319
未収配当金	138,538,125
未収利息	68,394
前払金	13,610,000
その他未収収益	3,682,774
差入委託証拠金	354,422,301
流動資産合計	1,600,643,148,903
資産合計	1,600,643,148,903
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,363,350
未払金	5,907,993
未払解約金	335,938,112

未払利息	1, 025, 468
受入担保金	4, 431, 890, 218
流動負債合計	4, 785, 125, 141
負債合計	4, 785, 125, 141
純資産の部	
元本等	
元本	470, 410, 524, 595
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1, 125, 447, 499, 167
元本等合計	1, 595, 858, 023, 762
純資産合計	1, 595, 858, 023, 762
負債純資産合計	1, 600, 643, 148, 903

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024 年 12 月 25 日現在]
1. 期首	2024 年 6 月 26 日
期首元本額	450, 277, 870, 938 円
期中追加設定元本額	84, 293, 591, 974 円
期中一部解約元本額	64, 160, 938, 317 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, 367, 154, 607 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	780, 208, 555 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3, 844, 665, 017 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	4, 076, 950, 386 円
三菱UFJ トピックスオープン（確定拠出年金）	3, 784, 616, 717 円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	5, 662, 176, 824 円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	33, 538, 292, 621 円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	42, 984, 135, 588 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	81, 167, 104 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	231, 560, 047 円
ファンド・マネジャー（国内株式）	273, 681, 427 円
eMAXIS TOPIXインデックス	8, 077, 622, 091 円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2, 003, 647, 465 円
eMAXIS バランス（波乗り型）	182, 034, 128 円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	2, 997, 516, 755 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	809, 621, 366 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	1, 150, 648, 788 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	1, 196, 229, 958 円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）	72, 293, 549, 974 円
国内株式セレクション（ラップ向け）	6, 739, 886, 476 円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	11, 760, 891, 404 円
つみたて日本株式（TOPIX）	13, 039, 438, 314 円

つみたて8資産均等バランス	6,008,149,881 円
つみたて4資産均等バランス	2,428,687,163 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,554,704 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	5,802,428 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	11,334,476 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	705,170,318 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	1,024,442,943 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	739,114,917 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	575,296,518 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,923,753,323 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	4,928,293,572 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1,931,288,850 円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	5,817,475,967 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	735,324,890 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	162,593,532 円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	24,522,430,329 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	375,133,848 円
ラップ向けインデックスf 国内株式	4,310,279,451 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	127,469,867 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	4,182,109,872 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	2,911,822,846 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	75,631,730 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	2,502,652,792 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	95,801,788 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	21,947,474 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	27,466,759 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	16,725,458 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) コンサバティブコース	7,664,912 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) スタンダードコース	63,664,540 円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	9,945,136 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	454,236,344 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,465,130,244 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	157,621,961 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	776,768,355 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	145,955,399 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	15,671,264 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	116,763,185 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	936,147,288 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	164,562,331 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	207,576,896 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	893,578,274 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	727,523,728 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	1,377,700,086 円
三菱UFJ トピックスオープン	891,157,692 円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,888,720,553 円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	38,786,437 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)	3,148,871,080 円

家限定)	
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,124,201 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,250,814,702 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	52,836,938 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,100,902,829 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)	56,925,872,302 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	175,964,046 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	115,082 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	120,954 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	175,476,712 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	297,192,511 円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,723,473,304 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)	1,571,067,637 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)	377,224,433 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)	332,744,819 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	106,034,045 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)	455,232,757 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)	90,724,618 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)	4,542,621,385 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)	273,091,005 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)	65,072,177 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)	276,288 円
日米コアバランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	100,510,563 円
日本株式インデックスファンドS	5,078,403,049 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	13,619,838 円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	9,798,010,251 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)	35,419,113 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)	82,846,981 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)	34,940,101 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)	34,951,319 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)	34,935,203 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)	35,058,940 円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	312,124,302 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)	34,874,281 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)	35,762,664 円
MUKAM 日米コアバランス (除く米国株) 2022-03 (適	549,675,869 円

格機関投資家限定)	
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	37,565,083 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)	38,774,804 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)	39,461,293 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)	39,241,585 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)	39,102,095 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	39,096,327 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)	39,100,255 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)	39,088,327 円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,334,215,610 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,522,514 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	6,048,553 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,434,838 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	5,538,945 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	405,960,011 円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	58,819,754 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	2,800,760 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	24,263,912 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,348,868 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	14,333,362 円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,554,191,535 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)	293,248,811 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)	1,282,247,931 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)	1,239,065,161 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)	1,241,415,644 円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	60,393,026,385 円
合計	470,410,524,595 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	4,235,542,600 円
3. 受益権の総数	470,410,524,595 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	[2024年12月25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

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

（有価証券に関する注記）
 該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
 取引の時価等に関する事項
 株式関連

[2024 年 12 月 25 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	7, 041, 125, 000	—	7, 044, 370, 000	3, 245, 000
合計		7, 041, 125, 000	—	7, 044, 370, 000	3, 245, 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）

	[2024 年 12 月 25 日現在]
1 口当たり純資産額	3. 3925 円
(1 万口当たり純資産額)	(33, 925 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）

[2024 年 12 月 25 日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	17, 793, 044, 166
コール・ローン	17, 062, 615, 620
株式	7, 260, 890, 806, 161
投資証券	130, 728, 605, 816
派生商品評価勘定	199, 060, 104
未収入金	50, 541, 870
未収配当金	4, 772, 365, 825
未収利息	99, 734
差入委託証拠金	155, 725, 013, 821

流動資産合計	7,587,222,153,117
資産合計	7,587,222,153,117
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,037,321,190
未払金	34,150,774
未払解約金	3,433,803,136
流動負債合計	5,505,275,100
負債合計	5,505,275,100
純資産の部	
元本等	
元本	947,720,369,588
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,633,996,508,429
元本等合計	7,581,716,878,017
純資産合計	7,581,716,878,017
負債純資産合計	7,587,222,153,117

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）

	[2024年12月25日現在]
1. 期首	2024年6月26日
期首元本額	810,464,613,732円
期中追加設定元本額	184,478,962,158円
期中一部解約元本額	47,223,206,302円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	159,032,535円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	857,879,322円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	882,960,342円
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,351,625,041円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	6,545,387,435円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,154,145,761円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	7,483,604,055円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,309,236,324円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	35,551,124円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	100,139,610円
ファンド・マネジャー（海外株式）	775,413円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,112,072,925円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	866,351,839円

eMAXIS バランス (波乗り型)	132, 183, 744 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1, 622, 953, 889 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	159, 610, 253 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	258, 680, 737 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	260, 370, 446 円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	111, 178, 024, 046 円
海外株式セレクション (ラップ向け)	2, 313, 079, 266 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	5, 163, 812, 622 円
つみたて先進国株式	41, 568, 364, 986 円
つみたて8資産均等バランス	2, 626, 455, 038 円
つみたて4資産均等バランス	1, 043, 775, 597 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1, 987, 193 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3, 428, 191 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7, 906, 939 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	152, 865, 614 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	216, 025, 156 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	163, 850, 162 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	62, 294, 539 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	499, 959, 447 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1, 516, 735, 245 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	71, 851, 932, 257 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	832, 609, 506 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	5, 404, 097, 447 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	543, 762, 151, 500 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	154, 824, 507 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	39, 615, 208 円
つみたて全世界株式	6, 291, 297, 459 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	83, 032, 986 円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2, 636, 160, 870 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	72, 071, 085 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	1, 548, 734, 046 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	64, 809, 281 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	9, 586, 508 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	11, 998, 599 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	3, 684, 475 円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	12, 386, 138 円
eMAXIS Slim 先進国株式 (含む日本) <オール先進国>	196, 106, 638 円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	34, 013, 312, 307 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	7, 373, 585, 397 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	349, 455, 900 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	797, 775, 954 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	86, 955, 168 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	599, 383, 196 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	100, 820, 078 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	404, 664, 116 円

eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	78,833,019 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	115,648,915 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	531,465,006 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	449,796,554 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	967,331,811 円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	880,547,441 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	3,863,179 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,336,683,471 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	22,868,543 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	481,851,629 円
MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	8,486,881,163 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	52,016 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	379,772,084 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)	3,675,778,734 円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	5,266,264 円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	37,748,297 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)	1,225,153,056 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)	294,561,207 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)	155,375,162 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	57,410,561 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)	1,046,265,963 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)	62,202,733 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)	3,606,439,867 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)	127,535,146 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)	1,535,154,574 円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) 2 (適格機関投資家転売制限付)	50,752,143 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)	191,532 円
海外株式インデックスファンドS	13,113,844,699 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)	593,146,270 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)	345,080,797 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	5,348,467 円
全世界株式 (除く日本) インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	158,416,819 円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	4,776,531,798 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,976,052,387 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	551,064 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	1,316,540 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	359,239 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,513,856 円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	20,788,012 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	601,363 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	5,176,114 円

三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	589,442 円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	6,270,204 円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	7,598,996,176 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）	63,575,922 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）	277,965,343 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）	308,434,310 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）	338,205,234 円
合計	947,720,369,588 円
2. 受益権の総数	947,720,369,588 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	[2024 年 12 月 25 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

[2024 年 12 月 25 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	211,958,442,754	—	210,089,131,778	△1,869,310,976
合計		211,958,442,754	—	210,089,131,778	△1,869,310,976

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[2024 年 12 月 25 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	26,292,010,752	—	26,320,012,650	28,001,898
	カナダドル	1,045,840,325	—	1,046,702,764	862,439
	オーストラリアドル	640,612,504	—	640,720,683	108,179
	イギリスポンド	1,088,888,892	—	1,089,436,496	547,604
	スイスフラン	788,717,057	—	787,941,309	△775,748
	香港ドル	130,379,228	—	130,488,156	108,928
	シンガポールドル	123,851,608	—	123,932,096	80,488
	ニュージーランドドル	31,361,579	—	31,359,461	△2,118
	スウェーデンクローネ	221,210,198	—	221,196,711	△13,487
	ノルウェークローネ	34,925,889	—	34,920,590	△5,299
	デンマーククローネ	70,707,320	—	70,774,537	67,217
	イスラエルシェケル	30,409,117	—	30,406,086	△3,031
	ユーロ	2,892,782,463	—	2,894,855,283	2,072,820
合計		33,391,696,932	—	33,422,746,822	31,049,890

（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）

	[2024 年 12 月 25 日現在]
1口当たり純資産額	8.0000 円
(1万口当たり純資産額)	(80,000 円)

貸借対照表

(単位：円)

[2024 年 12 月 25 日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,624,086,609
国債証券	829,322,739,420
地方債証券	52,443,014,580
特殊債券	41,226,012,089
社債券	61,500,007,000
未収入金	6,820,786,000
未収利息	1,267,576,749
前払金	2,640,000
前払費用	68,493,755
差入委託証拠金	34,615,975
流動資産合計	999,309,972,177
資産合計	999,309,972,177
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,702,440
未払金	8,034,571,000
未払解約金	579,921,404
流動負債合計	8,616,194,844
負債合計	8,616,194,844
純資産の部	
元本等	
元本	793,981,219,339
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	196,712,557,994
元本等合計	990,693,777,333
純資産合計	990,693,777,333
負債純資産合計	999,309,972,177

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)

	[2024 年 12 月 25 日現在]
1. 期首	2024 年 6 月 26 日
期首元本額	754,784,148,877 円
期中追加設定元本額	97,318,257,895 円
期中一部解約元本額	58,121,187,433 円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	8,206,062,837 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	13,058,463,212 円

三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	3,699,240,868 円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	59,553,542,063 円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	113,913,332,718 円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	39,001,866,161 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	213,619,223 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	205,420,154 円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,574,563,497 円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,207,576,724 円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	4,995,944,874 円
eMAXIS バランス（波乗り型）	88,498,423 円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	20,998,543,381 円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド（確定拠出年金）	44,130,149,882 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	12,956,158,740 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	7,006,883,815 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	3,171,081,153 円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	20,983,901,312 円
国内債券セレクション（ラップ向け）	6,080,614,313 円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	29,107,500,165 円
つみたて8資産均等バランス	14,915,333,914 円
つみたて4資産均等バランス	6,301,940,673 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	24,153,121 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	17,382,364 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	590,606 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	7,877,667,222 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	3,800,453,650 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	1,566,871,023 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	8,572,021,312 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	8,624,956,460 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	5,883,829,928 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	1,197,178,361 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	1,545,811,094 円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	1,146,892,686 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	590,419,620 円
ラップ向けインデックスf 国内債券	6,979,441,843 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	2,189,846,462 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	403,734,640 円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	16,147,015 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金）	26,223,061 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）コンサバティブコース	18,960,215 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）スタンダードコース	189,694 円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	2,416,390 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	51,223,157 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	85,641,319 円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	81,580,532 円

eMAXIS バランス (4資産均等型)	2,441,489,074 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	2,427,402,123 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	1,408,387,049 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	2,673,931,948 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	165,307,273 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	72,014,093 円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	4,751,893,662 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	28,433,967 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	8,768,558,179 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	572,222,917 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,489,093,078 円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	184,994,618,944 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	467,583,118 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	918,661 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	317,920 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,282,179,728 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,439,013,024 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)	2,543,494,307 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	742,801,756 円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	44,078,047,455 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	2,087,493,664 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,185,036 円
日本債券インデックスファンドS	6,987,011,393 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	35,627,290 円
国内債券インデックスオープンV (適格機関投資家限定)	18,279,631 円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	24,503,259,248 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)	554,334,205 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)	546,840,063 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)	547,010,780 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)	546,757,835 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)	548,694,334 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)	545,804,051 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)	559,816,343 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)	587,761,901 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)	606,830,601 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)	622,785,795 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)	627,454,324 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)	628,202,232 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)	628,183,105 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)	628,165,479 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)	628,207,051 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	19,423,790 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	23,045,575 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,559,065 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	10,161,746 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	18,831,053 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	49,247,486 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	9,695,717 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	32,328,165 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,424,667,813 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,288,971,610 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,878,920,641 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)	3,081,223,166 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)	2,278,860,998 円
合計	793,981,219,339 円
2. 受益権の総数	793,981,219,339 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	[2024 年 12 月 25 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2024 年 12 月 25 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	3,415,200,000	—	3,413,520,000	△1,680,000
合計		3,415,200,000	—	3,413,520,000	△1,680,000

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	[2024年12月25日現在]
1口当たり純資産額	1.2478円
(1万口当たり純資産額)	(12,478円)

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年12月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	5,191,532,457
コール・ローン	3,421,962,001
国債証券	676,179,623,334
派生商品評価勘定	152,747,246
未収入金	573,798,437
未収利息	5,401,802,186
前払費用	473,528,875
流動資産合計	691,394,994,536
資産合計	691,394,994,536
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	192,640
未払金	3,488,210
未払解約金	819,432,974
流動負債合計	823,113,824
負債合計	823,113,824
純資産の部	
元本等	
元本	249,652,859,640
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	440,919,021,072
元本等合計	690,571,880,712
純資産合計	690,571,880,712

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)

	[2024年12月25日現在]
1. 期首	2024年6月26日
期首元本額	238,956,530,761円
期中追加設定元本額	24,105,894,691円
期中一部解約元本額	13,409,565,812円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	283,791,006円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	720,412,468円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	504,199,437円
三菱UFJ 外国債券オープン	766,118,206円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,059,546,278円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,284,401,137円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	5,315,879,902円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	496,258,620円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	95,848,354円
ファンド・マネジャー(海外債券)	542,053,774円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,668,388,555円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,477,358,767円
eMAXIS バランス(波乗り型)	200,682,512円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,158,453,066円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	454,633,303円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	285,311,722円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	196,449,278円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	56,681,745,702円
海外債券セレクション(ラップ向け)	3,668,896,349円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	14,502,287,715円
つみたて8資産均等バランス	7,420,603,850円
つみたて4資産均等バランス	2,984,236,272円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	5,692,936円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4,160,922円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	809,868円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	273,481,574円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	193,287,168円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	111,273,075円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	889,338,253円

三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1,427,471,542 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	2,405,863,004 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国債券)	3,020,444,207 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	100,152,662 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	188,513,108 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	51,948,739 円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	3,492,035,734 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	56,120,566 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	26,775,448 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	33,510,814 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	2,276,260 円
eMAXIS/PayPay証券 全世界バランス	12,816,781 円
三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金)	3,274,326,938 円
三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	15,287,765,347 円
ワールド・インカムオープン	909,228,592 円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15,261,239,258 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	373,701,833 円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	2,610,358,069 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,162,830,552 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	606,714,936 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	331,253,839 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	644,790,289 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	265,530,166 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	99,030,925 円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	788,510,986 円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	8,747,316 円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	1,572,113,904 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	11,003,571 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,330,831,795 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,033,625,378 円
MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	46,329,729,402 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	431,270,965 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	213,344 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	97,777 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	1,122,615,054 円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	27,721,384 円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	49,948,063 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)	474,365,860 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	40,979,096 円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	5,759,424,630 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)	389,307,503 円
外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	95,986,988 円
海外債券インデックスファンドS	7,818,304,593 円
グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)	16,991,422 円
MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)	12,357,414,449 円

インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,559,160 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	2,511,317 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	510,155 円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	863,642 円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	4,489,245 円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	3,420,352 円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	7,475,836 円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	3,324,619 円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	8,965,968 円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,726,692,546 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）	182,274,933 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）	528,628,730 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）	439,425,578 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）	193,214,401 円
合計	249,652,859,640 円
2. 受益権の総数	249,652,859,640 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	[2024 年 12 月 25 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せん。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024 年 12 月 25 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	2,989,430,000	—	3,142,084,000	152,654,000
	売建				

	アメリカドル	239, 225, 949	—	239, 147, 665	78, 284
	カナダドル	10, 942, 500	—	10, 945, 120	△2, 620
	オーストラリアドル	7, 855, 568	—	7, 842, 016	13, 552
	イギリスポンド	23, 664, 384	—	23, 691, 276	△26, 892
	ポーランドズロチ	6, 527, 677	—	6, 527, 337	340
	中国元	41, 985, 870	—	42, 051, 365	△65, 495
	ユーロ	162, 054, 804	—	162, 151, 367	△96, 563
	合計	3, 481, 686, 752	—	3, 634, 440, 146	152, 554, 606

(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)

	[2024年12月25日現在]
1口当たり純資産額	2.7661円
(1万口当たり純資産額)	(27,661円)

2 【ファンドの現況】

【つみたて4資産均等バランス】

【純資産額計算書】

2024年12月30日現在

(単位：円)

I 資産総額	33, 191, 679, 098
II 負債総額	1, 119, 260
III 純資産総額 (I - II)	33, 190, 559, 838
IV 発行済口数	19, 070, 038, 398口
V 1口当たり純資産価額 (III / IV)	1.7405
(10,000口当たり)	(17,405)

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2024 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

I 資産総額	1, 637, 235, 864, 405
II 負債総額	9, 169, 506, 769
III 純資産総額 (I - II)	1, 628, 066, 357, 636
IV 発行済口数	470, 505, 759, 741 口
V 1 口当たり純資産価額 (III/IV)	3. 4602
(10, 000 口当たり)	(34, 602)

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

I 資産総額	7, 672, 166, 906, 465
II 負債総額	92, 361, 985, 953
III 純資産総額 (I - II)	7, 579, 804, 920, 512
IV 発行済口数	950, 180, 744, 398 口
V 1 口当たり純資産価額 (III/IV)	7. 9772
(10, 000 口当たり)	(79, 772)

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

I 資産総額	1, 007, 548, 079, 895
II 負債総額	17, 118, 246, 032
III 純資産総額 (I - II)	990, 429, 833, 863
IV 発行済口数	795, 444, 102, 063 口
V 1 口当たり純資産価額 (III/IV)	1. 2451
(10, 000 口当たり)	(12, 451)

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

I 資産総額	693, 183, 040, 437
--------	--------------------

Ⅱ 負債総額	74, 821, 162
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	693, 108, 219, 275
Ⅳ 発行済口数	249, 613, 719, 270口
Ⅴ 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2. 7767
(10, 000口当たり)	(27, 767)

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た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

2024年12月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

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

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024 年 12 月 30 日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	809	40,305,480
追加型公社債投資信託	16	1,556,148
単位型株式投資信託	86	389,252
単位型公社債投資信託	45	113,323
合 計	956	42,364,203

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

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

また、当社の中間財務諸表は、財務諸表等規則第 282 条及び第 306 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、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、従来、千円未満の端数を切り捨てて表示しておりましたが、当中間会計期間より百万円未満の端数を切り捨てて表示することに変更しました。

(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 39 期事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 40 期事業年度に係る中間会計期間（自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024 年 6 月 7 日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山	田	信	之
--------------------	-------	---	---	---	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	田	嶋	大	士
--------------------	-------	---	---	---	---

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJアセットマネジメント株式会社の 2023 年 4 月 1 日から 2024 年 3 月 31 日までの第 39 期事業年度の財務諸表、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アセットマネジメント株式会社の 2024 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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024 年 12 月 3 日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	鶴	見	将	史
--------------------	-------	---	---	---	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	田	嶋	大	士
--------------------	-------	---	---	---	---

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJアセットマネジメント株式会社の 2024 年 4 月 1 日から 2025 年 3 月 31 日までの第 40 期事業年度の中間会計期間（2024 年 4 月 1 日から 2024 年 9 月 30 日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJアセットマネジメント株式会社の 2024 年 9 月 30 日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024 年 4 月 1 日から 2024 年 9 月 30 日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成す

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)		第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	51,733,041	※2	58,206,340
有価証券		1,579,691		15,283
前払費用		770,747		679,199
未収入金		81,854		138,388
未収委託者報酬		16,753,855		21,064,747
未収収益	※2	688,142	※2	1,485,701
金銭の信託		10,400,000		10,500,500
その他		745,576		371,400
流動資産合計		82,752,908		92,461,561
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	181,551	※1	2,936,036
器具備品	※1	730,357	※1	1,531,857
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		1,111,177		45,140
有形固定資産合計		2,651,520		5,141,467
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,183,644		5,008,987
ソフトウェア仮勘定		1,907,739		1,587,548
無形固定資産合計		6,107,206		6,612,357
投資その他の資産				
投資有価証券		12,022,365		13,788,071
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	807,066	※1	1,788,120
長期差入保証金		689,492		689,867
前払年金費用		118,832		47,573
繰延税金資産		1,675,132		1,088,836
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		15,494,056		17,583,636
固定資産合計		24,252,782		29,337,461
資産合計		107,005,691		121,799,022

(単位：千円)

	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	507,559	807,451
未払金		
未払収益分配金	114,094	105,550
未払償還金	7,418	43,553
未払手数料	※2 6,139,595	※2 7,523,485
その他未払金	※2 955,697	※2 885,002
未払費用	※2 5,778,896	※2 8,611,140
未払消費税等	439,657	623,219
未払法人税等	2,375,281	2,235,007
賞与引当金	849,840	1,182,242
役員賞与引当金	154,872	175,992
その他	5,517	12,303
流動負債合計	17,328,431	22,204,949
固定負債		
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
役員退職慰労引当金	75,667	30,105
時効後支払損引当金	254,296	250,350
資産除去債務	-	1,428,586
その他	-	29,109
固定負債合計	1,663,846	3,346,253
負債合計	18,992,277	25,551,202
(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	33,267,700	40,236,787
利益剰余金合計	40,608,289	47,577,377
株主資本合計	87,341,133	94,310,221

(単位：千円)

	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 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	672, 279	1, 937, 598
評価・換算差額等合計	672, 279	1, 937, 598
純資産合計	88, 013, 413	96, 247, 820
負債純資産合計	107, 005, 691	121, 799, 022

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
営業収益		
委託者報酬	84,121,445	98,635,342
投資顧問料	2,750,601	3,117,320
その他営業収益	10,412	148,442
営業収益合計	86,882,459	101,901,104
営業費用		
支払手数料	※4 31,461,274	※4 34,494,219
広告宣伝費	798,894	593,586
公告費	375	1,017
調査費		
調査費	2,849,042	3,537,103
委託調査費	19,236,505	27,296,058
事務委託費	1,751,807	1,861,577
営業雑経費		
通信費	113,480	137,737
印刷費	367,379	390,143
協会費	58,128	68,869
諸会費	18,447	20,108
事務機器関連費	2,238,382	2,531,009
その他営業雑経費	-	139,012
営業費用合計	58,893,717	71,070,444
一般管理費		
給料		
役員報酬	416,461	400,592
給料・手当	6,565,766	7,202,711
賞与引当金繰入	849,840	1,182,242
役員賞与引当金繰入	154,872	175,992
福利厚生費	1,279,885	1,424,215
交際費	8,942	10,054
旅費交通費	75,274	108,782
租税公課	403,955	397,138
不動産賃借料	719,707	728,550
退職給付費用	388,176	381,449
固定資産減価償却費	2,418,341	2,469,755
諸経費	444,313	490,104
一般管理費合計	13,725,534	14,971,590
営業利益	14,263,207	15,859,070

(単位：千円)

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
営業外収益		
受取配当金	47,353	54,618
受取利息	※4 10,279	※4 12,836
投資有価証券償還益	609,102	204,527
収益分配金等時効完成分	94,351	17,722
受取賃貸料	※4 65,808	※4 162,111
その他	36,894	44,734
営業外収益合計	863,788	496,550
営業外費用		
投資有価証券償還損	32,995	234,700
時効後支払損引当金繰入	31,951	-
事務過誤費	2,680	10,822
賃貸関連費用	14,262	108,773
その他	32,394	25,903
営業外費用合計	114,284	380,199
経常利益	15,012,711	15,975,421
特別利益		
投資有価証券売却益	387,113	464,927
固定資産売却益	-	※1 16,229
資産除去債務履行差額	-	87,050
特別利益合計	387,113	568,207
特別損失		
投資有価証券売却損	15,828	57,011
投資有価証券評価損	104,554	31,651
固定資産除却損	※3 32,791	※3 20,246
固定資産売却損	-	※2 65,427
減損損失	※5 315,350	-
企業結合関連費用	-	※6 1,187,136
特別損失合計	468,524	1,361,473
税引前当期純利益	14,931,300	15,182,154
法人税、住民税及び事業税	※4 4,860,444	※4 4,542,085
法人税等調整額	△271,471	102,468
法人税等合計	4,588,973	4,644,553
当期純利益	10,342,327	10,537,601

(3) 【株主資本等変動計算書】

第38期（自2022年4月1日至2023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
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

	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				
企業結合による増加				
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	33, 267, 700	40, 608, 289	87, 341, 133
当期変動額					
企業結合による増加			1, 602, 526	1, 602, 526	1, 602, 526
剰余金の配当			△5, 171, 039	△5, 171, 039	△5, 171, 039
当期純利益			10, 537, 601	10, 537, 601	10, 537, 601
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	6, 969, 087	6, 969, 087	6, 969, 087
当期末残高	342, 589	6, 998, 000	40, 236, 787	47, 577, 377	94, 310, 221

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	672, 279	672, 279	88, 013, 413
当期変動額			
企業結合による増加			1, 602, 526
剰余金の配当			△5, 171, 039
当期純利益			10, 537, 601
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1, 265, 319	1, 265, 319	1, 265, 319
当期変動額合計	1, 265, 319	1, 265, 319	8, 234, 406
当期末残高	1, 937, 598	1, 937, 598	96, 247, 820

[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	3年～50年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 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。

(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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
建物	1,006,606 千円	498,805 千円
器具備品	1,985,072 千円	1,643,689 千円
投資不動産	163,978 千円	211,090 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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
預金	40,165,058 千円	39,776,992 千円
未収収益	15,046 千円	12,312 千円
未払手数料	790,279 千円	886,173 千円
その他未払金	77,007 千円	105,407 千円
未払費用	277,358 千円	599,493 千円

(損益計算書関係)

※1. 固定資産売却益の内訳

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
器具備品	-	16,229 千円
計	-	16,229 千円

※2. 固定資産売却損の内訳

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
器具備品	-	65,427 千円
計	-	65,427 千円

※3. 固定資産除却損の内訳

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
建物	1,047 千円	15,825 千円
器具備品	29,762 千円	3,986 千円
ソフトウェア	1,981 千円	434 千円
計	32,791 千円	20,246 千円

※4. 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 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
支払手数料	4,893,312 千円	5,006,309 千円
受取利息	10,236 千円	12,747 千円
受取賃貸料	68,168 千円	152,876 千円
法人税、住民税及び事業税	3,947,200 千円	132,303 千円

※5. 減損損失

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

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。

ホームページのリニューアルに伴い、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。

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

当事業年度については、該当事項はありません。

※6. 企業結合関連費用

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

前事業年度については、該当事項はありません。

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などであります。

(株主資本等変動計算書関係)

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において、次のとおり決議しております。

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

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 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

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

- ① 配当金の総額 5,171,039 千円
- ② 1 株当たり配当額 24,440 円
- ③ 基準日 2023 年 3 月 31 日
- ④ 効力発生日 2023 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

2024 年 6 月 26 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 45,747,620 千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1 株当たり配当額 216,218 円
- ④ 基準日 2024 年 3 月 31 日
- ⑤ 効力発生日 2024 年 6 月 27 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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
1 年内	962,809 千円	681,212 千円
1 年超	1,532,728 千円	851,515 千円
合計	2,495,537 千円	1,532,728 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 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（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 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	—

第 39 期(2024 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	15,283	15,283	—
(2) 金銭の信託	10,500,500	10,500,500	—
(3) 投資有価証券	13,788,071	13,788,071	—
資産計	24,303,855	24,303,855	—

(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 39 期(2024 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	58,206,340	—	—	—
金銭の信託	10,500,500	—	—	—
未収委託者報酬	21,064,747	—	—	—
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	15,283	5,351,373	347,505	11,696
合計	89,786,871	5,351,373	347,505	11,696

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 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。

第 39 期 (2024 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	—	15,283	—	15,283
金銭の信託	—	10,500,500	—	10,500,500
投資有価証券	2,014,968	11,773,103	—	13,788,071
資産計	2,014,968	22,288,887	—	24,303,855

(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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在) 及び第 39 期 (2024 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 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。

第 39 期 (2024 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	17,364,277	14,269,984	3,094,293
	小計	17,364,277	14,269,984	3,094,293
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	6,939,577	7,241,136	△301,559
	小計	6,939,577	7,241,136	△301,559
合計		24,303,855	21,511,121	2,792,733

(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 10,500,500 千円、取得原価は 10,500,000 千円)を含めております。

3. 売却したその他有価証券

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

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 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	3,750,272	464,927	57,011
合計	3,750,272	464,927	57,011

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 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。

当事業年度において、有価証券について 31,651 千円（その他有価証券のその他 31,651 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 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
退職給付債務の期首残高	3,723,521 千円	3,582,778 千円
勤務費用	196,190	182,947
利息費用	25,925	39,626
数理計算上の差異の 発生額	△186,130	△79,379
退職給付の支払額	△176,727	△300,286
過去勤務費用の発生額	—	—
企業結合による影響額	—	226,499
退職給付債務の期末残高	3,582,778	3,652,185

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
年金資産の期首残高	2,583,927 千円	2,425,752 千円
期待運用収益	46,453	43,626
数理計算上の差異の 発生額	△103,934	227,699
事業主からの拠出額	—	—
退職給付の支払額	△100,694	△204,536
年金資産の期末残高	2,425,752	2,492,542

(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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,468,195 千円	2,250,427 千円
年金資産	△2,425,752	△2,492,542
	42,442	△242,114
非積立型制度の退職給付債務	1,114,583	1,401,758
未積立退職給付債務	1,157,025	1,159,643
未認識数理計算上の差異	281,343	558,841
未認識過去勤務費用	△223,319	△157,957
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,215,049	1,560,527
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
前払年金費用	△118,832	△47,573
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,215,049	1,560,527

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
勤務費用	196,190 千円	182,947 千円
利息費用	25,925	39,626
期待運用収益	△46,453	△43,626
数理計算上の差異の 費用処理額	△6,532	△29,581
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
退職給付制度の統合に係る 調整額	-	34,505
その他	1,600	2,196
確定給付制度に係る 退職給付費用	236,091	251,429

(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。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

(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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
債券	63.6 %	62.0 %
株式	34.2	35.9
その他	2.2	2.1
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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
割引率	0.066～1.13%	1.39～1.41%
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 152,084 千円、当事業年度 164,524 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 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
繰延税金資産		
減損損失	499,742千円	389,750千円
投資有価証券評価損	47,876	30,021
未払事業税	169,997	126,161
賞与引当金	260,221	362,002
役員賞与引当金	29,828	33,564
役員退職慰労引当金	23,169	9,218
退職給付引当金	408,434	492,400
減価償却超過額	227,100	199,986
差入保証金	52,869	—
資産除去債務	—	16,900
時効後支払損引当金	77,865	76,657
その他	212,315	227,182
繰延税金資産 小計	2,009,420	1,963,847
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	2,009,420	1,963,847
繰延税金負債		
前払年金費用	△36,386	△14,567
その他有価証券評価差額金	△296,702	△855,135
その他	△1,199	△5,308
繰延税金負債 合計	△334,288	△875,010
繰延税金資産の純額	1,675,132	1,088,836

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 38 期（2023 年 3 月 31 日現在）及び第 39 期（2024 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、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。

（企業結合等関係）

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

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

1. 取引の概要

(1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱UFJ不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

(2) 企業結合日

2023 年 10 月 1 日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

分割会社：三菱UFJ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱UFJアセットマネジメント株式会社

(5) 企業結合を行った主な理由

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

2. 会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から 15 年と見積り、割引率は 1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	第 39 期 (2024 年 3 月 31 日現在)
期首残高	—	—
有形固定資産の取得に伴う増加	—	1,420,750 千円
時の経過による調整額	—	7,835 千円
期末残高	—	1,428,586 千円

(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 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日) 及び第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 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 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日) 及び第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 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 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 1)	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㈱	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				

第 39 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 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%	グループ通算制度	グループ通算 制度に伴う通 算税効果額 (注 4)	132,303 千円	その他未払金	105,407 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行㈱	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)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円
						投資の助言	投資助言料 (注 3)	463,831 千円	未払費用	260,800 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。
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. グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。
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 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

第 39 期（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 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)	4,354,007 千円	未払手数料	1,028,586 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)	7,493,449 千円	未払手数料	1,449,414 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おります。

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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	415,979.76 円	454,898.22 円
1株当たり当期純利益金額	48,881.17 円	49,804.10 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、記載しておりません。

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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
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）	10,342,327	10,537,601
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表
(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 40 期中間会計期間 (2024 年 9 月 30 日現在)			
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金			28,443
有価証券			7
前払費用			812
未収入金			145
未収委託者報酬			23,384
未収収益			1,003
金銭の信託			1,999
その他			324
流動資産合計			56,120
固定資産			
有形固定資産			
建物	※1		2,853
器具備品	※1		1,306
土地			628
建設仮勘定			193
有形固定資産合計			4,981
無形固定資産			
ソフトウェア			3,983
ソフトウェア仮勘定			1,356
無形固定資産合計			5,340
投資その他の資産			
投資有価証券			12,099
関係会社株式			159
投資不動産	※1		1,750
長期差入保証金			690
前払年金費用			14
繰延税金資産			1,692
その他			45
貸倒引当金			△23
投資その他の資産合計			16,428
固定資産合計			26,750
資産合計			82,871

(単位：百万円)

第 40 期中間会計期間
(2024 年 9 月 30 日現在)

(負債の部)

流動負債

預り金	943
未払金	
未払収益分配金	114
未払償還金	151
未払手数料	8,340
その他未払金	679
未払費用	8,675
未払消費税等	※2 845
未払法人税等	2,907
賞与引当金	1,176
役員賞与引当金	115
その他	9
流動負債合計	23,958

固定負債

退職給付引当金	1,644
役員退職慰労引当金	25
時効後支払損引当金	249
資産除去債務	1,436
その他	29
固定負債合計	3,384

負債合計

27,343

(純資産の部)

株主資本

資本金	2,000
資本剰余金	
資本準備金	3,572
その他資本剰余金	41,160
資本剰余金合計	44,732

利益剰余金

利益準備金	342
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,910
利益剰余金合計	7,253

株主資本合計

53,986

(単位：百万円)

第 40 期中間会計期間
(2024 年 9 月 30 日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1, 542
評価・換算差額等合計	1, 542
純資産合計	55, 528
負債純資産合計	82, 871

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第 40 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)	
営業収益	
委託者報酬	56,145
投資顧問料	1,713
その他営業収益	2
営業収益合計	57,862
営業費用	
支払手数料	19,522
広告宣伝費	203
公告費	0
調査費	
調査費	2,206
委託調査費	15,946
事務委託費	1,042
営業雑経費	
通信費	80
印刷費	215
協会費	41
諸会費	11
事務機器関連費	1,405
営業費用合計	40,676
一般管理費	
給料	
役員報酬	232
給料・手当	3,459
賞与引当金繰入	1,089
役員賞与引当金繰入	115
福利厚生費	725
交際費	4
旅費交通費	60
租税公課	281
不動産賃借料	325
退職給付費用	189
固定資産減価償却費	※1 1,218
諸経費	524
一般管理費合計	8,224
営業利益	8,960

(単位：百万円)

第 40 期中間会計期間

(自 2024 年 4 月 1 日

至 2024 年 9 月 30 日)

営業外収益		
受取配当金		49
受取利息		4
投資有価証券償還益		22
収益分配金等時効完成分		3
受取賃貸料		112
その他		3
営業外収益合計		195
営業外費用		
投資有価証券償却損		6
時効後支払損引当金繰入		19
事務過誤費		7
賃貸関連費用	※1	94
その他		10
営業外費用合計		137
経常利益		9,017
特別利益		
投資有価証券売却益		497
特別利益合計		497
特別損失		
投資有価証券売却損		58
固定資産除却損		18
固定資産売却損		3
減損損失	※2	1,306
事業譲渡関連損失		285
特別損失合計		1,672
税引前中間純利益		7,842
法人税、住民税及び事業税		2,847
法人税等調整額		△428
法人税等合計		2,418
中間純利益		5,423

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 40 期中間会計期間（自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日）

（単位：百万円）

	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	3,572	41,160	44,732
当中間期変動額				
剰余金の配当				
中間純利益				
別途積立金の取崩				
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)				
当中間期変動額合計	—	—	—	—
当中間期末残高	2,000	3,572	41,160	44,732

	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	6, 998	40, 236	47, 577	94, 310
当中間期変動額					
剰余金の配当			△45, 747	△45, 747	△45, 747
中間純利益			5, 423	5, 423	5, 423
別途積立金の取崩		△6, 998	6, 998	—	—
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)					
当中間期変動額合計	—	△6, 998	△33, 326	△40, 324	△40, 324
当中間期末残高	342	—	6, 910	7, 253	53, 986

	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	1,937	1,937	96,247
当中間期変動額			
剰余金の配当			△45,747
中間純利益			5,423
別途積立金の取崩			—
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	△395	△395	△395
当中間期変動額合計	△395	△395	△40,719
当中間期末残高	1,542	1,542	55,528

〔重要な会計方針〕

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

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

5. 収益および費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 投資顧問料

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

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

第 40 期中間会計期間 (2024 年 9 月 30 日現在)	
建物	590 百万円
器具備品	1,894 百万円
投資不動産	249 百万円

※2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

第 40 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)	
有形固定資産	331 百万円
無形固定資産	886 百万円
投資不動産	38 百万円

※2 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
東京都港区 (本社)	インターネット直販サービス	ソフトウェア	1,306 百万円

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。

現行のソフトウェア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おりません。

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 40 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

2024 年 6 月 26 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 | 45,747 百万円 |
| ② 配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③ 1 株当たり配当額 | 216,218 円 |
| ④ 基準日 | 2024 年 3 月 31 日 |
| ⑤ 効力発生日 | 2024 年 6 月 27 日 |

(リース取引関係)

第 40 期中間会計期間(2024 年 9 月 30 日現在)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1 年以内	681 百万円
1 年超	510 百万円
合 計	1,192 百万円

(金融商品関係)

第 40 期中間会計期間(2024 年 9 月 30 日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2024 年 9 月 30 日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(注 2) 参照）。

	中間貸借対照表 計上額（百万円）	時価（百万円）	差額（百万円）
(1) 有価証券	7	7	—
(2) 金銭の信託	1,999	1,999	—
(3) 投資有価証券	12,099	12,099	—
資産計	14,106	14,106	—

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

(注 2) 市場価格のない株式等

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159 百万円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

区分	時価（百万円）			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
有価証券	—	7	—	7
金銭の信託	—	1,999	—	1,999
投資有価証券	2,686	9,412	—	12,099
資産計	2,686	11,419	—	14,106

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

金銭の信託

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

（有価証券関係）

第40期中間会計期間（2024年9月30日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159 百万円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表 計上額が取得原価を 超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	10,113	7,534	2,578
	小 計	10,113	7,534	2,578
中間貸借対照表 計上額が取得原価を 超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	3,993	4,349	△355
	小 計	3,993	4,349	△355
合 計		14,106	11,883	2,222

（注）「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」（中間貸借対照表計上額 1,999 百万円、取得価額 2,000 百万円）を含めております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減

第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
期首残高	1,428 百万円
有形固定資産の取得に伴う増加	—
時の経過による調整額	7 百万円
中間期末残高	1,436 百万円

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

1 株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 40 期中間会計期間 (2024 年 9 月 30 日現在)
1 株当たり純資産額	262,445.12 円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額 (百万円)	55,528
普通株式に係る中間期末の純資産額 (百万円)	55,528
1 株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数 (株)	211,581

1 株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 40 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)
1 株当たり中間純利益金額	25,633.62 円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額 (百万円)	5,423
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	—
普通株式に係る中間純利益金額 (百万円)	5,423
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581

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

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

約款

追加型証券投資信託

つみたて4資産均等バランス

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

つみたて4資産均等バランス

運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の各対象インデックスを25%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券および外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む先進国の株式および公社債に直接投資することがあります。

（2）投資態度

- ① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券および外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として対象インデックスに採用されている日本を含む先進国の株式および公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を合成ベンチマークの変動率に連動させることを目的とした運用を行います。
- ② 国内株式、先進国株式、国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ25%とします。
- ③ 合成ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式および公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。
- ④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ⑤ 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（3）投資制限

- ① 株式への実質投資割合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 スワップ取引を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を行うことができます。
- ⑨ 外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑩ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑪ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ③収益の分配にあてなか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
『つみたて4資産均等バランス』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

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

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

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

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

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金1,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

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

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

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

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

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

(当初の受益者)

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

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については1,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

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

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

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

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第27条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以

下「外貨建価値証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

- ③ 第29条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

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

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

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

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

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

(受益権の設定に係る受託者の通知)

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

(受益権の申込単位および価額)

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

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

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ⑥ 前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第38条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

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

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

（受益権の譲渡の対抗要件）

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

（投資の対象とする資産の種類等）

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

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

- ② デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。
- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対

する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(投資の対象とする有価証券等)

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

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

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

- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

8. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

10. 外国法人の社員権で前号の権利の性質を有するもの

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

12. 外国の法令に基づく権利であって、前号の権利に類するもの

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

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

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

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

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第30条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条、第27条、第29条、第33条から第35条に掲

げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

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

（運用の基本方針）

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

（投資する株式等の範囲）

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

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式について、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52条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替えは委託者と受託者の協議にて定めます。

（信用取引の指図範囲）

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

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2. 株式分割により取得する株券
 - 3. 有償増資により取得する株券
 - 4. 売出しにより取得する株券

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

（先物取引等の運用指図）

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

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

（スワップ取引の運用指図）

第23条 委託者は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第25条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（この信託約款において、新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの

受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

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

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

(公社債の借入れ)

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第28条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

(外国為替予約取引の指図)

第29条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(信託業務の委託等)

第30条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

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

(混蔵寄託)

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

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第32条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

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

(有価証券売却等の指図)

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

(再投資の指図)

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

(資金の借入れ)

第35条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

(損益の帰属)

第36条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に

帰属します。

(受託者による資金立替え)

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

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第38条 この信託の計算期間は、毎年6月26日から翌年6月25日までとすることを原則とします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から2018年6月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第39条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

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

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

(信託事務の諸費用および監査報酬)

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

② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

(信託報酬等)

第41条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第38条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の22の率を乗じて得た額とします。

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

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

(収益の分配)

第42条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を

控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責）

第43条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第44条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第46条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第44条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第44条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、振替口座簿に

- 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ます。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、振替口座簿に）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

- ④ 一部解約金は、第46条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5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ます。

- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(収益分配金および償還金の時効)

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

(信託契約の一部解約)

第46条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- 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られないものとします。
- 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があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- 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10億口を下回るものとなった場合には、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47条第2項から第5項の規定にしたがいます。

(信託契約の解約)

第47条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

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

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第48条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第52条の規定にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第49条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第52条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第50条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

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

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

（信託約款の変更等）

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

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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 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であっても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

（反対者の買取請求権）

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

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

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第54条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

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

（公告）

第55条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

- ② 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

（質権口記載または記録の受益権の取扱い）

第56条 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57条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（附則）

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契

約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第44条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

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

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

信託契約締結日 2017年8月16日

(付表)

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

