

投資信託説明書 (請求目論見書)

使用開始日 2024.10.26

eMAXIS バランス(波乗り型)

追加型投信／内外／資産複合

ファンドは、NISAの成長投資枠の対象です。
※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。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

この目論見書により行う「eMAXIS バランス(波乗り型)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年4月25日に関東財務局長に提出しており、2024年4月26日に効力が生じております。

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

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

目次

| | |
|---------------------|-----|
| 第一部【証券情報】 | 1 |
| (1)【ファンドの名称】 | 1 |
| (2)【内国投資信託受益証券の形態等】 | 1 |
| (3)【発行(売出)価額の総額】 | 1 |
| (4)【発行(売出)価格】 | 1 |
| (5)【申込手数料】 | 1 |
| (6)【申込単位】 | 1 |
| (7)【申込期間】 | 1 |
| (8)【申込取扱場所】 | 1 |
| (9)【払込期日】 | 2 |
| (10)【払込取扱場所】 | 2 |
| (11)【振替機関に関する事項】 | 2 |
| (12)【その他】 | 2 |
| 第二部【ファンド情報】 | 3 |
| 第1【ファンドの状況】 | 3 |
| 第2【管理及び運営】 | 58 |
| 第3【ファンドの経理状況】 | 64 |
| 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】 | 376 |
| 第三部【委託会社等の情報】 | 377 |
| 第1【委託会社等の概況】 | 377 |
| 約款 | 408 |

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

eMAXIS バランス（波乗り型）（「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.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4月26日から2025年4月25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、下記にてご確認ください。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
 信託金の限度額は、1,000億円です。

*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 | MR F | |
| 追加型 | | 不動産投信 | | 特殊型 () |
| | 内外 | その他資産 () | E T F | |
| | | 資産複合 | | |

属性区分表

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

| | | | | | |
|-----|--|--|--|--|--|
| () | | | | | |
|-----|--|--|--|--|--|

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

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

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

商品分類の定義

| | | |
|---------|-----------------------|--|
| 単位型・追加型 | 単位型 | 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。 |
| | 追加型 | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。 |
| 投資対象地域 | 国内 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 海外 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 内外 | 信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資対象資産 | 株式 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 債券 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 不動産投信（リート） | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | その他資産 | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| | 資産複合 | 信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 独立区分 | MMF（マネー・マネージメント・ファンド） | 一般社団法人投資信託協会が定める「MR F及びMMFの運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。 |
| | MR F（マネー・リザーブ・ファンド） | 一般社団法人投資信託協会が定める「MR F及びMMFの運営に関する規則」に規定するMR Fをいいます。 |
| | ETF | 投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。 |
| 補足分類 | インデックス型 | 信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。 |
| | 特殊型 | 信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。 |

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

属性区分の定義

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

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

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

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

ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色

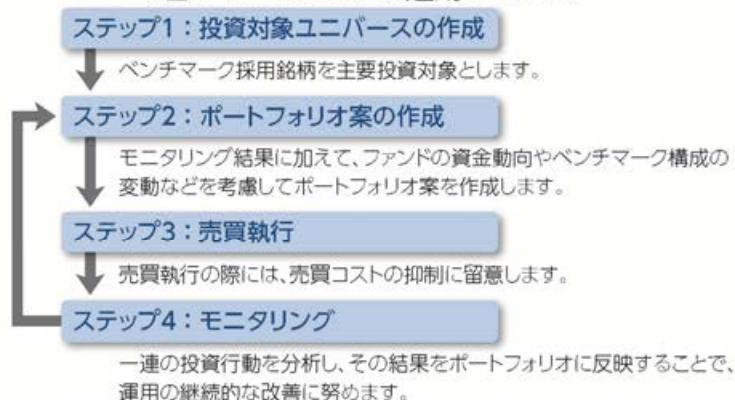
各マザーファンド等を通じて、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。)、公社債および不動産投資信託証券(リート)に実質的な投資を行います。

- 組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等を活用する場合があります。
- DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。
- ❗ 資金動向および取引コスト等を勘案し、上場投資信託証券に直接投資することがあります。

<各マザーファンドの主要投資対象と運用目標>

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

<各マザーファンドの運用プロセス>

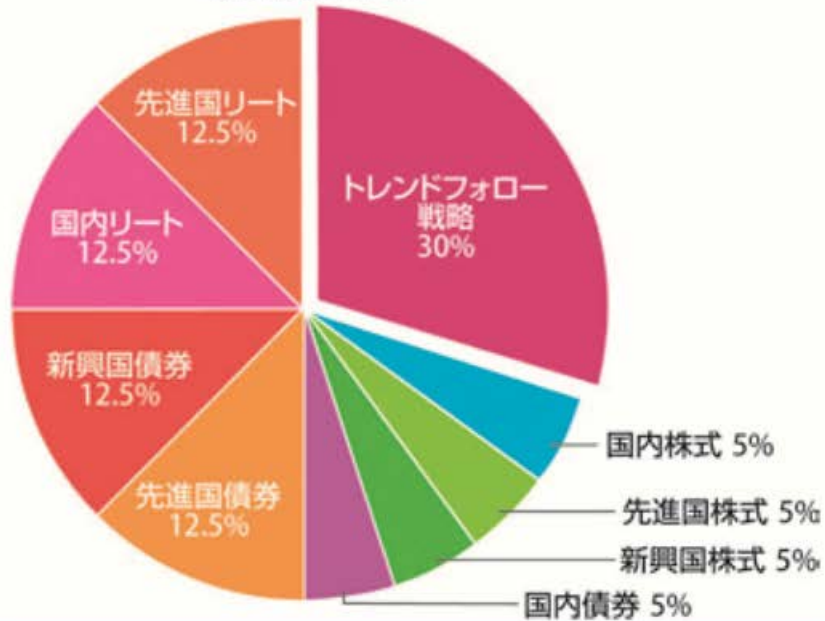


- ❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。
- 📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
(https://www.am.mufj.jp/investment_policy/fm.html)

特色 **2**

国内株式、先進国株式、新興国株式および国内債券への投資にあたっては、トレンドフォロー戦略を活用し、機動的に資金を配分します。

<基本投資割合>



トレンドフォロー戦略

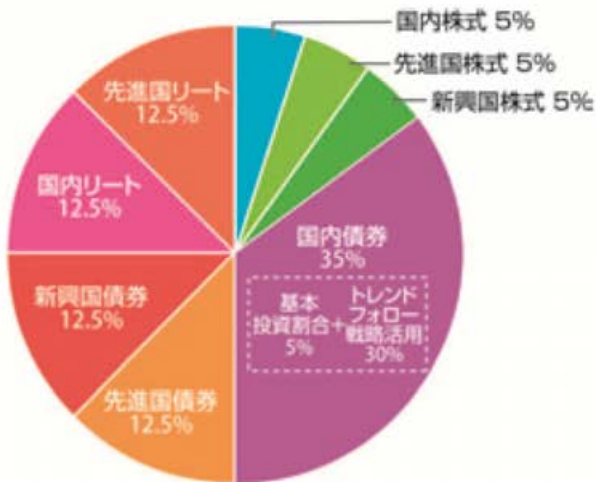
<戦略の目的>

この戦略の目的は、「直近に良好な運用成績を記録した資産は、一定期間好調なパフォーマンスが継続する」という仮定を基に、過去の運用成績が良い資産の投資比率を上げていくことです。言い換えれば、**市場動向の「波に乗る」戦略**と言えます。

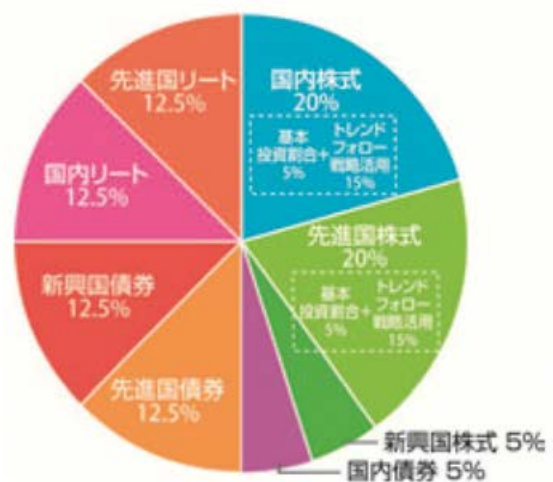
1 上記は当戦略の目的であり、将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。例えば、市場のトレンドが反転を繰り返すような場合には、当戦略の効果が出ない、あるいは逆効果となることがあります。

(トレンドフォロー戦略 資産配分例)

I. 過去の国内債券の運用成績が好調だった場合



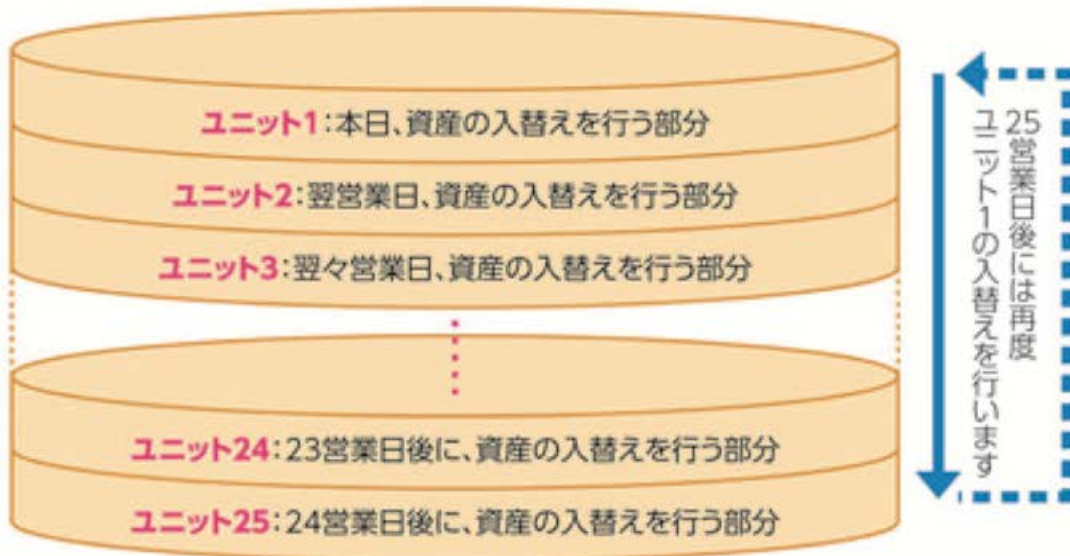
II. 過去の国内株式と先進国株式の運用成績が好調だった場合



<戦略のプロセス>

①トレンドフォロー戦略の活用部分を25ユニットに均等分割し、毎営業日1ユニットずつ資産の入替えを行います。

イメージ①



②資産の入替えにあたっては、トレンドフォロー戦略の対象とする4資産の過去25営業日間騰落率を測定し、最も良い運用成績を記録した資産を選定します。

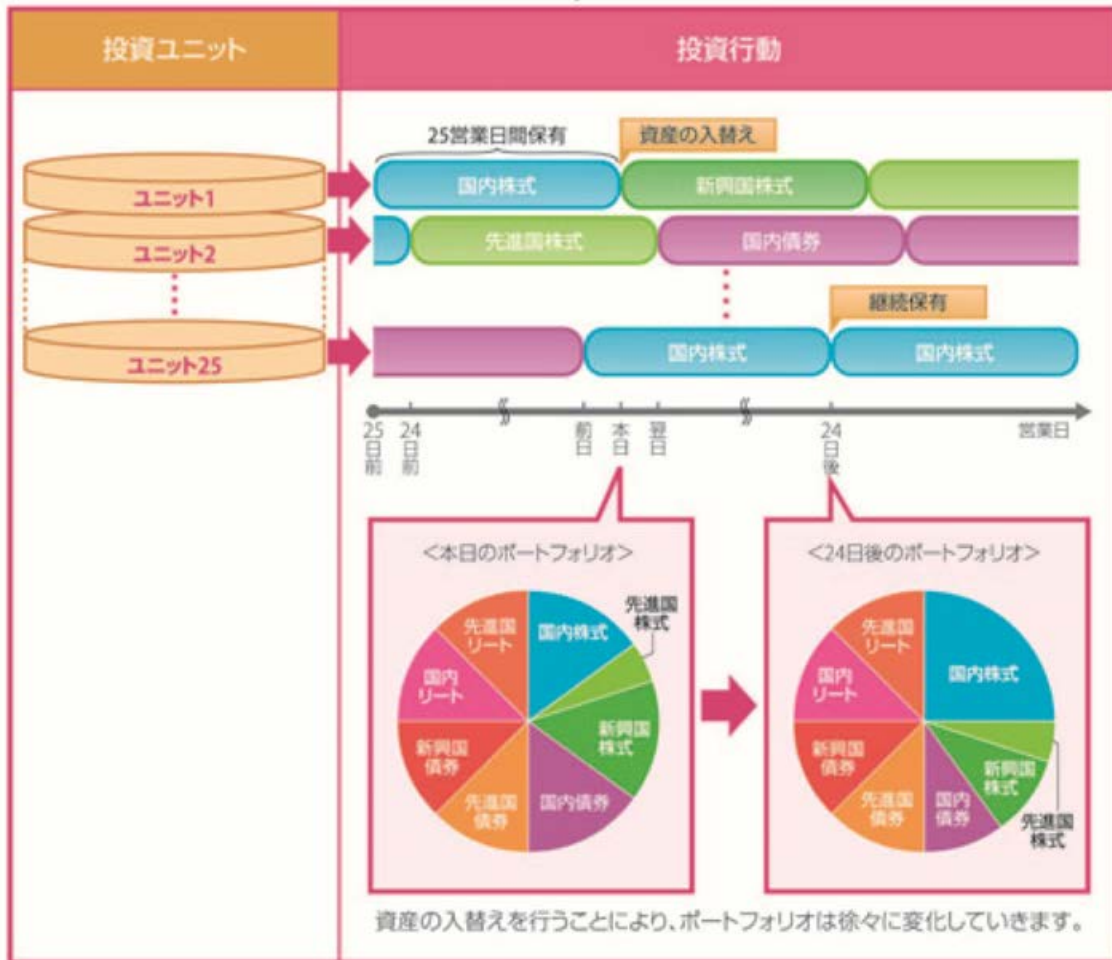
イメージ②

| 日付 (営業日) | 過去25営業日間騰落率 | 測定結果 |
|------------------|--|----------------|
| ユニット1 (本日) | 新興国株式 : 10% 先進国株式 : 5% 国内株式 : 1% 国内債券 : 0% | → ・新興国株式を選定 |
| ユニット2 (翌日) | 国内債券 : -1% 先進国株式 : -2% 国内株式 : -5% 新興国株式 : -10% | → ・国内債券を選定 |
| | ⋮ | |
| ユニット25 (24日後) | 国内株式 : 15% 先進国株式 : 7% 国内債券 : 1% 新興国株式 : -5% | → ・国内株式を選定 |

③選定した資産は買付け後25営業日間保有します。また、保有期間の終了した資産は売却し、同様の選定方法を用いて資産の入替えを行います。

❶ 保有期間の終了した資産と新たに選定された資産が同一の場合は、25営業日間継続保有します。

イメージ③



❶ 上記はトレンドフォロー戦略の基本的なプロセスとイメージを示したものであり、実際の運用においては資産の時価変動の影響によって生じる組入比率の変化の調節と合わせて資産の入替えを行います。

❷ 各市場の休業日や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。

❸ 本戦略は、各資産の過去の騰落率をもとに投資判断を行います。将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

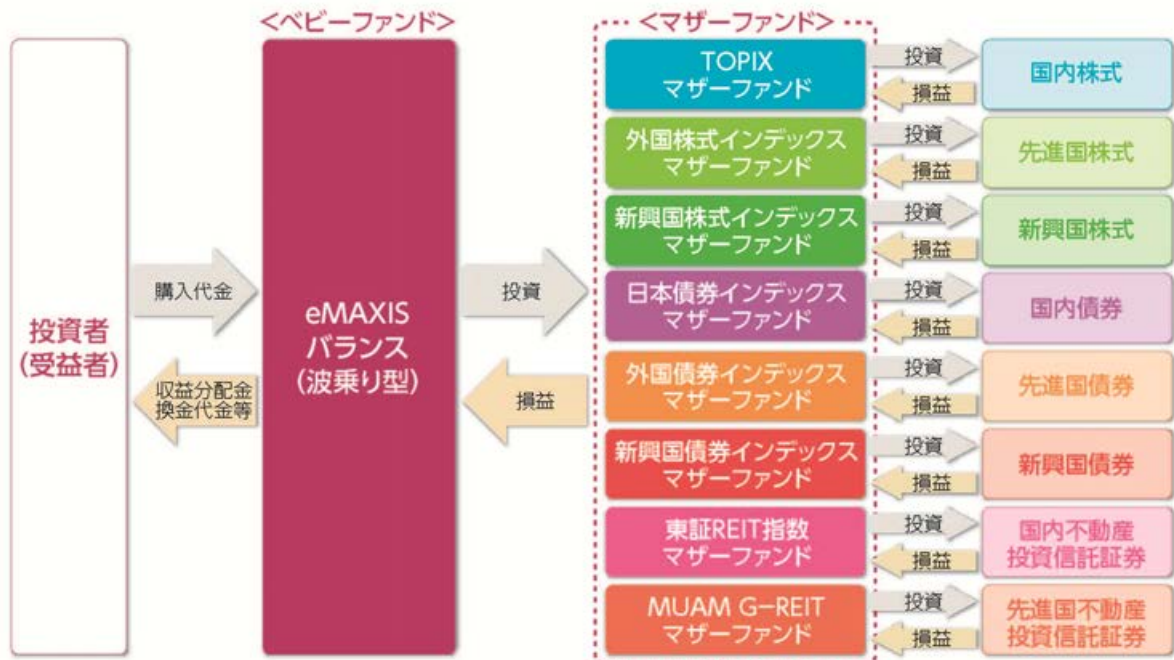
特色 3

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。

■ファンドの仕組み

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



■主な投資制限

| | |
|--------|--|
| 株式 | 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。 |
| 外貨建資産 | 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 |
| デリバティブ | デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 |

■分配方針

- 年1回の決算時(1月26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。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。



指数について

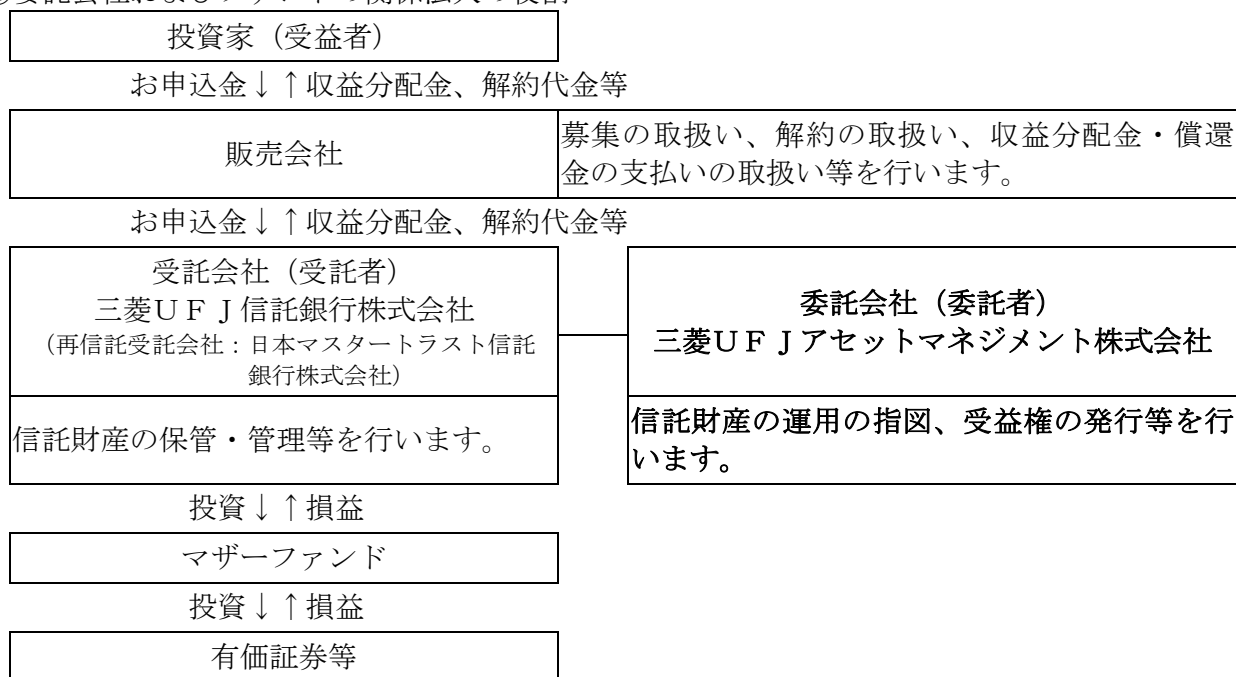
- ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)(以下「TOPIX」といいます。)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI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

(2) 【ファンドの沿革】

2011年10月31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7月末現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
1985年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱UFJ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更
- 大株主の状況

| 株主名 | 住所 | 所有株式数 | 所有比率 |
|---------------|-------------------|----------|--------|
| 株式会社三菱UFJフィナン | 東京都千代田区丸の内二丁目7番1号 | 211,581株 | 100.0% |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-R E I Tマザーファンド受益証券等への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。このほか、日本を含む世界各国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

各投資対象資産への実質的な基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して以下の比率とします。なお、国内株式、先進国株式、新興国株式および国内債券への実質的な投資にあたっては、市況動向等を勘案し、以下の範囲内で機動的に資金を配分します。

| | |
|--------------|-----------|
| 国内株式 | ・・・ 5～35% |
| 先進国株式 | ・・・ 5～35% |
| 新興国株式 | ・・・ 5～35% |
| 国内債券 | ・・・ 5～35% |
| 先進国債券 | ・・・ 12.5% |
| 新興国債券 | ・・・ 12.5% |
| 国内不動産投資信託証券 | ・・・ 12.5% |
| 先進国不動産投資信託証券 | ・・・ 12.5% |

組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等を活用する場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAM G-R E I Tマザーファンド（「マザーファン

6. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当するものを除きます。）
 7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
 8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの
- ④その他の投資対象
信託約款に定める次に掲げるもの。
- ・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

TOPIXマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑤外貨建資産への投資は行いません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

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

外国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

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

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

(投資制限)

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

新興国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動した投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

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

日本債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

⑦外貨建資産への投資は行いません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

⑨スワップ取引を行うことができます。

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

外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

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

新興国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

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

⑬外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

東証REIT指数マザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資は行いません。

②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

③外貨建資産への投資は行いません。

④不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

MUAM G-REITマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

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

②投資態度

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

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への直接投資は行いません。

②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

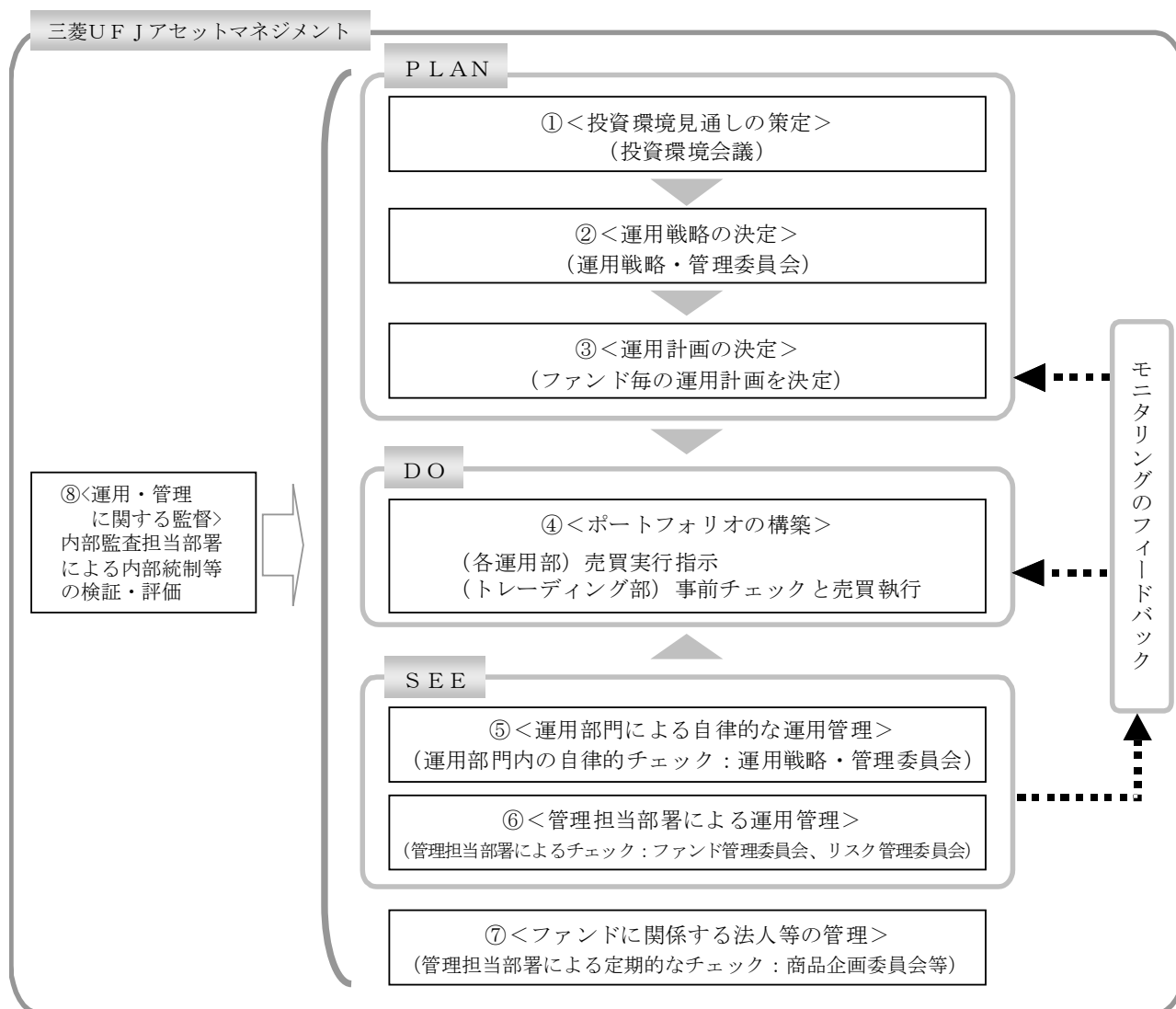
③外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

④不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

⑥外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(3) 【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤運用部門による自律的な運用管理

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

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(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は是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（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株式

- a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の60を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

②新株引受権証券および新株予約権証券

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

③投資信託証券

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

乗じて得た額とします。

④同一銘柄の転換社債等

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

⑤スワップ取引

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

⑥信用取引

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

⑦外国為替予約取引

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

⑧有価証券の借入れ

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

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

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

⑨資金の借入れ

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

⑩投資する株式等の範囲

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

⑪金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

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

⑫有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下⑫において同じ。）および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑬有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または⑧の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑭特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑮デリバティブ取引等

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

⑯信用リスクの分散規制

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

①価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債、不動産投資信託証券の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

保有不動産等の価値は、不動産市況、社会情勢等のマクロ的な要因の他、不動産の質や収益増減等の個別の要因によって変動しますが、災害等による保有不動産の滅失、劣化または毀損があった場合には、その影響を大きく受けることがあります。なお、保有不動産等から得られる収益は、賃料水準、稼働率、借入金利等の要因により変動します。

また、不動産投資信託証券は、株式と同様に上場市場で取引が行われ市場の需給を受けて価格が決

定しますが、利回りに着目して取引される傾向もあるため、公社債と同様に、金利の影響を受けることがあります。よって、金利の上昇局面では、不動産投資信託証券に対する投資価値が相対的に低下し、不動産投資信託証券の市場価格が下落する場合があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

②為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債、不動産投資信託証券は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

③信用リスク

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

④流動性リスク

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

また、不動産投資信託証券は、株式と比べ市場規模が小さく、また、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

⑤カントリーリスク

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

※留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、当ファンドが損失を被る可能性があります。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりの方が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- 不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

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

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。

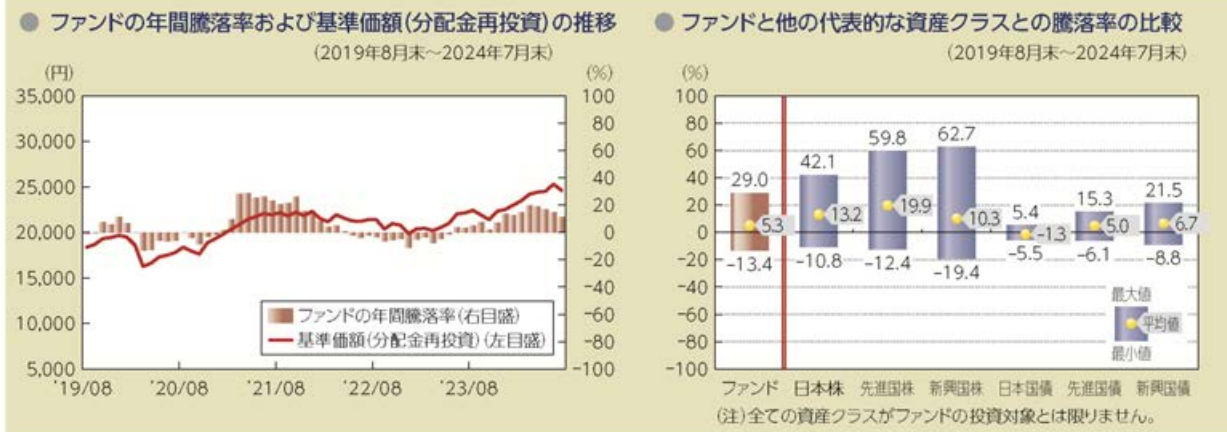
③内部監査担当部署

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

(1) 【申込手数料】

ありません。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.15%）が差し引かれます。

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

(3) 【信託報酬等】

- 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.55%（税抜0.5%）以内の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- 信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- 信託報酬率ならびに配分（委託会社および販売会社、受託会社）は、ファンドの純資産総額に応じて以下の通りとなります。

| ファンドの純資産総額に応じて | 信託報酬率 (税込 年率) | 配分（税抜 年率） | | |
|-------------------------|------------------|-----------|-----------------|-------|
| | | 合計 | 委託会社および 販売会社 | 受託会社 |
| 500億円未満の部分 | 0.55% | 0.5% | 0.44% | 0.06% |
| 500億円以上 1,000億円未満の部分 | 0.528% | 0.48% | 0.43% | 0.05% |
| 1,000億円以上の部分 | 0.506% | 0.46% | 0.42% | 0.04% |

委託会社および販売会社への配分（税抜）は、次の通りです。

| 各販売会社における取扱純資産総額に応じて | 委託会社 | 販売会社 |
|----------------------|---|-------|
| 50億円未満の部分 | 信託報酬率から 販売会社および 受託会社の配分率を 差し引いた率 | 0.22% |
| 50億円以上100億円未満の部分 | | 0.23% |
| 100億円以上の部分 | | 0.24% |

※上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

| 支払先 | 対価として提供する役務の内容 |
|------|---|
| 委託会社 | 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 | 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 | 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 |

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

1. 収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」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7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1月27日～2024年1月26日)における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

| 総経費率(①+②) | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|-----------|------------|-----------|
| 0.58% | 0.55% | 0.03% |

(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】

【eMAXIS バランス (波乗り型)】

(1) 【投資状況】

2024年7月31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 | 4,368,321,758 | 95.39 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 211,261,493 | 4.61 |
| 純資産総額 | | 4,579,583,251 | 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7月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|-----------|-----------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド | 126,725,544 | 7.3271 | 928,530,734 | 7.1279 | 903,287,005 | 19.72 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 東証REIT指数マザーファンド | 168,257,618 | 3.5077 | 590,197,247 | 3.4481 | 580,169,092 | 12.67 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | MUAM G-R E I Tマザーファンド | 199,967,552 | 2.5623 | 512,377,798 | 2.8722 | 574,346,802 | 12.54 |
| 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 | 210,812,863 | 2.5806 | 544,030,414 | 2.7022 | 569,658,518 | 12.44 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国債券インデックスマザーファンド | 311,159,404 | 1.7757 | 552,532,916 | 1.8229 | 567,212,477 | 12.39 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド | 157,977,830 | 3.3331 | 526,569,718 | 3.4317 | 542,132,519 | 11.84 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 新興国株式インデックスマザーファンド | 117,989,000 | 4.0604 | 479,087,083 | 3.9166 | 462,115,717 | 10.09 |
| 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 | 136,239,045 | 1.2640 | 172,211,268 | 1.2434 | 169,399,628 | 3.70 |

(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7月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|-----------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 95.39 |
| 合計 | 95.39 |

(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7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4計算期間末日 (2015年1月26日) | 3,115,899,802 | 3,115,899,802 | 17,596 | 17,596 |
| 第5計算期間末日 (2016年1月26日) | 3,366,366,211 | 3,366,366,211 | 15,707 | 15,707 |
| 第6計算期間末日 (2017年1月26日) | 3,677,292,631 | 3,677,292,631 | 17,175 | 17,175 |
| 第7計算期間末日 (2018年1月26日) | 3,956,221,321 | 3,956,221,321 | 19,125 | 19,125 |
| 第8計算期間末日 (2019年1月28日) | 3,900,450,188 | 3,900,450,188 | 18,162 | 18,162 |
| 第9計算期間末日 (2020年1月27日) | 4,155,730,755 | 4,155,730,755 | 19,737 | 19,737 |
| 第10計算期間末日 (2021年1月26日) | 3,934,345,672 | 3,934,345,672 | 19,937 | 19,937 |
| 第11計算期間末日 (2022年1月26日) | 4,255,343,847 | 4,255,343,847 | 21,340 | 21,340 |
| 第12計算期間末日 (2023年1月26日) | 4,202,194,809 | 4,202,194,809 | 20,309 | 20,309 |
| 第13計算期間末日 (2024年1月26日) | 4,301,356,415 | 4,301,356,415 | 22,904 | 22,904 |
| 2023年7月末日 | 4,502,466,954 | — | 22,146 | — |
| 8月末日 | 4,552,398,257 | — | 22,426 | — |
| 9月末日 | 4,452,595,415 | — | 21,920 | — |
| 10月末日 | 4,339,405,665 | — | 21,405 | — |
| 11月末日 | 4,443,670,022 | — | 22,321 | — |
| 12月末日 | 4,340,575,959 | — | 22,529 | — |
| 2024年1月末日 | 4,303,726,635 | — | 23,000 | — |
| 2月末日 | 4,356,295,004 | — | 23,483 | — |
| 3月末日 | 4,472,415,272 | — | 24,185 | — |
| 4月末日 | 4,526,845,241 | — | 24,430 | — |
| 5月末日 | 4,551,926,555 | — | 24,519 | — |
| 6月末日 | 4,696,041,509 | — | 25,309 | — |
| 7月末日 | 4,579,583,251 | — | 24,627 | — |

② 【分配の推移】

| | 1万口当たりの分配金 |
|--------|------------|
| 第4計算期間 | 0円 |
| 第5計算期間 | 0円 |
| 第6計算期間 | 0円 |
| 第7計算期間 | 0円 |
| 第8計算期間 | 0円 |

| | |
|----------|-----|
| 第9 計算期間 | 0 円 |
| 第10 計算期間 | 0 円 |
| 第11 計算期間 | 0 円 |
| 第12 計算期間 | 0 円 |
| 第13 計算期間 | 0 円 |

③【収益率の推移】

| | 収益率 (%) |
|------------|---------|
| 第4 計算期間 | 18.34 |
| 第5 計算期間 | △10.73 |
| 第6 計算期間 | 9.34 |
| 第7 計算期間 | 11.35 |
| 第8 計算期間 | △5.03 |
| 第9 計算期間 | 8.67 |
| 第10 計算期間 | 1.01 |
| 第11 計算期間 | 7.03 |
| 第12 計算期間 | △4.83 |
| 第13 計算期間 | 12.77 |
| 第14 中間計算期間 | 7.19 |

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

(4)【設定及び解約の実績】

| | 設定口数 | 解約口数 | 発行済口数 |
|------------|---------------|-------------|---------------|
| 第4 計算期間 | 1,351,868,569 | 664,011,220 | 1,770,787,779 |
| 第5 計算期間 | 987,724,940 | 615,313,510 | 2,143,199,209 |
| 第6 計算期間 | 506,445,414 | 508,603,996 | 2,141,040,627 |
| 第7 計算期間 | 540,370,928 | 612,788,964 | 2,068,622,591 |
| 第8 計算期間 | 433,314,738 | 354,321,606 | 2,147,615,723 |
| 第9 計算期間 | 521,543,297 | 563,604,497 | 2,105,554,523 |
| 第10 計算期間 | 442,151,559 | 574,331,159 | 1,973,374,923 |
| 第11 計算期間 | 368,860,702 | 348,170,671 | 1,994,064,954 |
| 第12 計算期間 | 284,091,628 | 209,028,612 | 2,069,127,970 |
| 第13 計算期間 | 264,340,736 | 455,441,390 | 1,878,027,316 |
| 第14 中間計算期間 | 117,973,914 | 137,075,110 | 1,858,926,120 |

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

2024年7月31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 | 1,536,336,509,930 | 99.12 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 13,622,656,740 | 0.88 |
| 純資産総額 | | 1,549,959,166,670 | 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7月31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 | 8,335,060,000 | 0.54 |

(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7月31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 | 20,750,600 | 3,782.48 | 78,488,729,488 | 2,949.00 | 61,193,519,400 | 3.95 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 23,412,500 | 1,583.79 | 37,080,483,375 | 1,750.00 | 40,971,875,000 | 2.64 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 2,733,600 | 13,070.01 | 35,728,179,336 | 13,530.00 | 36,985,608,000 | 2.39 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 9,474,000 | 2,805.94 | 26,583,475,560 | 3,288.00 | 31,150,512,000 | 2.01 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 2,692,200 | 9,043.68 | 24,347,395,296 | 10,915.00 | 29,385,363,000 | 1.90 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 390,500 | 70,259.54 | 27,436,350,370 | 65,890.00 | 25,730,045,000 | 1.66 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 826,100 | 38,421.20 | 31,739,753,320 | 31,020.00 | 25,625,622,000 | 1.65 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 2,890,000 | 6,634.79 | 19,174,543,100 | 8,658.00 | 25,021,620,000 | 1.61 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 7,930,300 | 3,524.73 | 27,952,166,319 | 3,144.00 | 24,932,863,200 | 1.61 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 3,506,300 | 6,698.83 | 23,488,107,629 | 6,748.00 | 23,660,512,400 | 1.53 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 3,753,500 | 4,759.85 | 17,866,096,975 | 6,022.00 | 22,603,577,000 | 1.46 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 6,186,800 | 3,576.29 | 22,125,790,972 | 3,530.00 | 21,839,404,000 | 1.41 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 2,776,200 | 6,629.19 | 18,403,957,278 | 7,783.00 | 21,607,164,600 | 1.39 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 3,410,500 | 4,879.32 | 16,640,920,860 | 6,148.00 | 20,967,754,000 | 1.35 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 2,464,400 | 8,290.97 | 20,432,266,468 | 8,388.00 | 20,671,387,200 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 116,452,000 | 180.67 | 21,039,382,840 | 160.40 | 18,678,900,800 | 1.21 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 5,189,200 | 3,056.43 | 15,860,426,556 | 3,448.00 | 17,892,361,600 | 1.15 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|------------|--------|-----------|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 1,931,200 | 9,181.28 | 17,730,887,936 | 9,162.00 | 17,693,654,400 | 1.14 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 9,248,800 | 1,864.84 | 17,247,532,192 | 1,647.00 | 15,232,773,600 | 0.98 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 3,464,900 | 4,341.51 | 15,042,897,999 | 4,302.00 | 14,905,999,800 | 0.96 |
| 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 768,500 | 19,021.75 | 14,618,214,875 | 18,940.00 | 14,555,390,000 | 0.94 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 2,879,500 | 4,501.44 | 12,961,896,480 | 4,520.00 | 13,015,340,000 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | 三菱重工業 | 機械 | 6,894,400 | 1,378.00 | 9,500,483,200 | 1,830.00 | 12,616,752,000 | 0.81 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 6,254,600 | 2,016.61 | 12,613,088,906 | 1,965.00 | 12,290,289,000 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 3,486,900 | 2,876.74 | 10,030,904,706 | 3,351.00 | 11,684,601,900 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 4,318,600 | 2,552.59 | 11,023,615,174 | 2,601.00 | 11,232,678,600 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 2,335,600 | 4,010.89 | 9,367,834,684 | 4,434.00 | 10,356,050,400 | 0.67 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 470,700 | 20,598.33 | 9,695,633,931 | 21,905.00 | 10,310,683,500 | 0.67 |
| 日本 | 株式 | 富士通 | 電気機器 | 3,627,900 | 2,507.55 | 9,097,140,645 | 2,732.50 | 9,913,236,750 | 0.64 |
| 日本 | 株式 | 丸紅 | 卸売業 | 3,425,700 | 2,685.26 | 9,198,895,182 | 2,860.50 | 9,799,214,850 | 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7月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|-----|----------|----------|
| 株式 | 水産・農林業 | 0.08 |
| | 鉱業 | 0.30 |
| | 建設業 | 2.12 |
| | 食料品 | 3.20 |
| | 繊維製品 | 0.37 |
| | パルプ・紙 | 0.15 |
| | 化学 | 5.69 |
| | 医薬品 | 4.77 |
| | 石油・石炭製品 | 0.53 |
| | ゴム製品 | 0.63 |
| | ガラス・土石製品 | 0.68 |
| | 鉄鋼 | 0.85 |
| | 非鉄金属 | 0.73 |
| | 金属製品 | 0.53 |
| | 機械 | 5.47 |
| | 電気機器 | 17.05 |
| | 輸送用機器 | 7.70 |
| | 精密機器 | 2.24 |
| | その他製品 | 2.41 |
| | 電気・ガス業 | 1.37 |
| 陸運業 | 2.28 | |
| 海運業 | 0.75 | |
| 空運業 | 0.35 | |

| | | |
|----|------------|-------|
| | 倉庫・運輸関連業 | 0.14 |
| | 情報・通信業 | 7.10 |
| | 卸売業 | 7.46 |
| | 小売業 | 4.00 |
| | 銀行業 | 8.27 |
| | 証券、商品先物取引業 | 0.94 |
| | 保険業 | 3.27 |
| | その他金融業 | 1.20 |
| | 不動産業 | 2.00 |
| | サービス業 | 4.52 |
| | 小計 | 99.12 |
| 合計 | | 99.12 |

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

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7月31日現在

| 資産の種類 | 取引所名 | 資産の名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|-------|---------------|----|-----|----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | TOPIX 24年09月限 | 買建 | 298 | 円 | 8,168,928,900 | 8,335,060,000 | 0.54 |

(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7月31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 | 4,366,611,567,552 | 72.60 |
| | イギリス | 235,465,192,467 | 3.91 |
| | カナダ | 186,182,828,449 | 3.10 |
| | フランス | 162,262,386,735 | 2.70 |
| | スイス | 158,700,372,543 | 2.64 |
| | ドイツ | 134,928,189,729 | 2.24 |
| | オーストラリア | 108,807,430,112 | 1.81 |
| | オランダ | 96,466,501,713 | 1.60 |
| | デンマーク | 58,385,164,215 | 0.97 |
| | スウェーデン | 50,001,516,967 | 0.83 |
| | スペイン | 41,317,932,920 | 0.69 |

| | | | |
|--------------------------|----------|-------------------|--------|
| | イタリア | 33,623,615,184 | 0.56 |
| | 香港 | 25,449,830,340 | 0.42 |
| | シンガポール | 17,393,446,743 | 0.29 |
| | フィンランド | 15,621,202,928 | 0.26 |
| | ベルギー | 12,674,614,573 | 0.21 |
| | ノルウェー | 9,118,892,367 | 0.15 |
| | イスラエル | 5,556,528,526 | 0.09 |
| | アイルランド | 4,482,667,620 | 0.07 |
| | オーストリア | 2,927,770,283 | 0.05 |
| | ルクセンブルク | 2,819,029,188 | 0.05 |
| | ニュージーランド | 2,758,352,327 | 0.05 |
| | ポルトガル | 2,566,398,840 | 0.04 |
| | パミュューダ | 842,756,825 | 0.01 |
| | 小計 | 5,734,964,189,146 | 95.35 |
| 投資証券 | アメリカ | 98,409,501,191 | 1.64 |
| | オーストラリア | 7,561,856,545 | 0.13 |
| | イギリス | 2,065,112,451 | 0.03 |
| | フランス | 1,997,112,823 | 0.03 |
| | シンガポール | 1,379,217,268 | 0.02 |
| | 香港 | 1,028,202,363 | 0.02 |
| | ベルギー | 411,824,931 | 0.01 |
| | カナダ | 311,772,865 | 0.01 |
| | 小計 | 113,164,600,437 | 1.88 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 166,525,076,288 | 2.77 |
| 純資産総額 | | 6,014,653,865,871 | 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7月31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 | 132,350,256,335 | 2.20 |
| | 買建 | カナダ | 5,906,894,532 | 0.10 |
| | 買建 | ドイツ | 19,272,224,479 | 0.32 |
| | 買建 | オーストラリア | 4,396,612,807 | 0.07 |
| | 買建 | イギリス | 7,023,975,489 | 0.12 |
| | 買建 | スイス | 4,549,017,902 | 0.08 |

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

2024年7月31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 | 9,013,925 | 28,242.15 | 254,572,643,246 | 33,353.87 | 300,649,300,668 | 5.00 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 4,337,279 | 63,488.53 | 275,367,483,608 | 64,469.92 | 279,624,050,967 | 4.65 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 15,361,349 | 14,114.50 | 216,817,794,666 | 15,812.60 | 242,902,885,631 | 4.04 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 5,753,253 | 28,559.38 | 164,309,381,058 | 27,699.87 | 159,364,373,985 | 2.65 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 4,730,117 | 25,717.67 | 121,647,597,352 | 25,959.00 | 122,789,143,152 | 2.04 |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 1,346,819 | 72,778.30 | 98,019,209,105 | 70,608.68 | 95,097,116,637 | 1.58 |
| 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 | 496,686 | 117,220.78 | 58,221,924,823 | 120,459.61 | 59,830,603,045 | 0.99 |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 1,761,871 | 26,148.77 | 46,070,769,258 | 33,936.19 | 59,791,193,945 | 0.99 |
| アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導体・半導体製造装置 | 2,705,900 | 20,586.26 | 55,704,382,032 | 21,878.18 | 59,200,191,074 | 0.98 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 1,765,170 | 30,351.04 | 53,574,762,078 | 32,803.56 | 57,903,866,360 | 0.96 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 金融サービス | 805,141 | 62,842.50 | 50,597,075,790 | 67,265.67 | 54,158,352,352 | 0.90 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 2,036,487 | 26,065.71 | 53,082,490,965 | 26,198.33 | 53,352,575,573 | 0.89 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 566,856 | 78,127.90 | 44,287,269,784 | 87,855.74 | 49,801,556,301 | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 2,756,880 | 17,932.80 | 49,438,587,940 | 18,013.83 | 49,661,980,883 | 0.83 |
| 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 | 2,006,707 | 19,647.81 | 39,427,408,897 | 19,810.43 | 39,753,748,621 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | 金融サービス | 972,085 | 42,681.05 | 41,489,609,858 | 40,106.96 | 38,987,378,100 | 0.65 |
| 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 | 1,480,734 | 22,822.62 | 33,794,233,964 | 24,593.14 | 36,415,906,265 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 家庭用品・パーソナル用品 | 1,445,927 | 25,423.65 | 36,760,755,366 | 24,649.54 | 35,641,446,991 | 0.59 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|-----------------------|------------------------|-----------|------------|----------------|------------|----------------|------|
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A | 金融サービス | 511,847 | 69,538.22 | 35,592,930,765 | 68,209.27 | 34,912,714,316 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 609,903 | 52,783.49 | 32,192,813,834 | 55,440.90 | 33,813,573,428 | 0.56 |
| アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORP | 生活必需品流通・小売り | 272,657 | 120,614.37 | 32,886,352,952 | 123,480.97 | 33,667,951,710 | 0.56 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導体・半導体製造装置 | 245,782 | 143,465.68 | 35,261,283,517 | 132,851.87 | 32,652,599,050 | 0.54 |
| 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 | 1,088,564 | 24,551.44 | 26,725,816,762 | 28,472.74 | 30,994,403,229 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | WALMART INC | 生活必需品流通・小売り | 2,722,992 | 9,300.66 | 25,325,631,859 | 10,547.32 | 28,720,277,784 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 4,369,560 | 5,887.42 | 25,725,476,757 | 6,292.72 | 27,496,431,586 | 0.46 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC. | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1,557,566 | 19,792.68 | 30,828,418,875 | 17,568.71 | 27,364,425,360 | 0.45 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 1,078,756 | 25,187.74 | 27,171,434,505 | 24,324.85 | 26,240,578,750 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ | 2,511,587 | 9,647.44 | 24,230,387,192 | 10,317.13 | 25,912,392,692 | 0.43 |
| アメリカ | 株式 | NETFLIX INC | メディア・娯楽 | 266,223 | 93,561.40 | 24,908,197,882 | 94,906.09 | 25,266,185,382 | 0.42 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 1,642,628 | 16,443.97 | 27,011,340,710 | 15,328.33 | 25,178,757,192 | 0.42 |

(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7月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|------------------|----------|
| 株式 | エネルギー | 4.39 |
| | 素材 | 3.58 |
| | 資本財 | 6.83 |
| | 商業・専門サービス | 1.57 |
| | 運輸 | 1.59 |
| | 自動車・自動車部品 | 1.62 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.27 |
| | 消費者サービス | 1.79 |
| | メディア・娯楽 | 6.18 |
| | 一般消費財・サービス流通・小売り | 4.71 |
| | 生活必需品流通・小売り | 1.71 |
| | 食品・飲料・タバコ | 3.11 |

| | | |
|------|------------------------|-------|
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.52 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 4.07 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.95 |
| | 銀行 | 5.63 |
| | 金融サービス | 6.58 |
| | 保険 | 3.00 |
| | ソフトウェア・サービス | 9.53 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.45 |
| | 電気通信サービス | 1.09 |
| | 公益事業 | 2.58 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 8.33 |
| | 不動産管理・開発 | 0.28 |
| | 小計 | 95.35 |
| 投資証券 | — | 1.88 |
| 合計 | | 97.23 |

(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7月31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 EMINI2409 | 買建 | 3,173 | アメリカドル | 887,453,700.8 | 135,283,442,150 | 868,212,125 | 132,350,256,335 | 2.20 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | SP/TSE602409 | 買建 | 196 | カナダドル | 52,367,759 | 5,762,024,523 | 53,684,400 | 5,906,894,532 | 0.10 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO ST 2409 | 買建 | 2,399 | ユーロ | 118,855,158.55 | 19,598,027,093 | 116,879,280 | 19,272,224,479 | 0.32 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 2409 | 買建 | 223 | オーストラリアドル | 43,777,838.25 | 4,362,461,581 | 44,120,550 | 4,396,612,807 | 0.07 |
| | イギリス | インターコンチネンタル取引所 | FTSE100 2409 | 買建 | 433 | イギリスポンド | 35,554,756.25 | 6,960,199,083 | 35,880,545 | 7,023,975,489 | 0.12 |
| | スイス | ユーレックス・チューリッヒ取引所 | SWISS IX2409 | 買建 | 214 | スイスフラン | 26,016,055.9 | 4,496,875,262 | 26,317,720 | 4,549,017,902 | 0.08 |

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

新興国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|--------------------------|---------------|-----------------|----------|
| 株式 | インド | 174,191,921,081 | 19.67 |
| | 台湾 | 161,475,425,527 | 18.24 |
| | 香港 | 157,949,913,002 | 17.84 |
| | 韓国 | 103,947,247,725 | 11.74 |
| | ブラジル | 37,284,988,425 | 4.21 |
| | サウジアラビア | 35,173,400,922 | 3.97 |
| | 中国 | 33,172,194,488 | 3.75 |
| | 南アフリカ | 26,328,064,708 | 2.97 |
| | アメリカ | 20,894,571,254 | 2.36 |
| | メキシコ | 17,370,835,274 | 1.96 |
| | インドネシア | 14,379,033,054 | 1.62 |
| | マレーシア | 12,227,172,361 | 1.38 |
| | タイ | 11,829,838,867 | 1.34 |
| | アラブ首長国連邦 | 9,983,678,609 | 1.13 |
| | ポーランド | 7,826,157,758 | 0.88 |
| | カタール | 6,944,989,062 | 0.78 |
| | クウェート | 6,719,983,001 | 0.76 |
| | トルコ | 6,591,501,503 | 0.74 |
| | フィリピン | 4,667,577,297 | 0.53 |
| | ギリシャ | 4,526,905,853 | 0.51 |
| | チリ | 3,601,899,489 | 0.41 |
| ハンガリー | 2,126,585,619 | 0.24 | |
| チェコ | 1,171,101,923 | 0.13 | |
| コロンビア | 893,916,196 | 0.10 | |
| 小計 | | 861,278,902,998 | 97.27 |
| 投資証券 | メキシコ | 947,383,975 | 0.11 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 23,244,302,243 | 2.62 |
| 純資産総額 | | 885,470,589,216 | 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7月31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 | 24,715,365,494 | 2.79 |

(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7月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価(円) | 簿価金額(円) | 評価単価(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|---------|----|------------------------------|--------------------|------------|-----------|----------------|-----------|----------------|---------|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 18,737,000 | 3,779.18 | 70,810,662,906 | 4,359.15 | 81,677,505,972 | 9.22 |
| 香港 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 5,034,300 | 7,252.22 | 36,509,886,639 | 6,898.73 | 34,730,306,645 | 3.92 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 3,638,140 | 8,775.87 | 31,927,861,982 | 8,950.50 | 32,563,172,070 | 3.68 |
| 香港 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 一般消費財・サービス流通・小売り | 11,875,700 | 1,516.66 | 18,011,497,557 | 1,486.66 | 17,655,151,913 | 1.99 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 2,323,730 | 5,186.21 | 12,051,359,699 | 5,538.12 | 12,869,116,501 | 1.45 |
| インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 3,985,940 | 2,059.31 | 8,208,320,875 | 2,213.29 | 8,822,055,093 | 1.00 |
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 419,762 | 20,266.10 | 8,506,940,923 | 20,873.45 | 8,761,881,119 | 0.99 |
| 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 9,556,272 | 800.03 | 7,645,332,680 | 908.93 | 8,685,986,131 | 0.98 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウェア・サービス | 2,494,977 | 2,626.35 | 6,552,691,059 | 3,435.18 | 8,570,706,318 | 0.97 |
| アメリカ | 株式 | PDD HOLDINGS INC | 一般消費財・サービス流通・小売り | 455,886 | 20,821.99 | 9,492,456,853 | 18,774.51 | 8,559,036,448 | 0.97 |
| 香港 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 消費者サービス | 3,896,420 | 2,310.61 | 9,003,143,002 | 2,075.86 | 8,088,438,007 | 0.91 |
| 香港 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 74,076,550 | 109.70 | 8,126,720,362 | 105.93 | 7,847,617,853 | 0.89 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・半導体製造装置 | 1,170,236 | 5,178.19 | 6,059,712,505 | 5,819.93 | 6,810,699,795 | 0.77 |
| インド | 株式 | HDFC BANK LIMITED | 銀行 | 2,100,874 | 2,651.54 | 5,570,567,104 | 2,956.45 | 6,211,142,593 | 0.70 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウェア・サービス | 679,483 | 7,123.61 | 4,840,374,605 | 7,988.59 | 5,428,111,439 | 0.61 |
| サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK | 銀行 | 1,478,604 | 3,221.95 | 4,763,992,170 | 3,459.50 | 5,115,230,538 | 0.58 |
| インド | 株式 | BHARTI AIRTEL LTD | 電気通信サービス | 1,696,401 | 2,393.51 | 4,060,363,455 | 2,690.74 | 4,564,574,875 | 0.52 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 632,998 | 7,173.52 | 4,540,829,423 | 6,961.50 | 4,406,615,577 | 0.50 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 2,610,029 | 1,737.97 | 4,536,169,766 | 1,634.25 | 4,265,440,833 | 0.48 |
| 香港 | 株式 | NETEASE INC | メディア | 1,508,895 | 2,966.83 | 4,476,643,351 | 2,782.12 | 4,197,936,011 | 0.47 |

| | | | ア・娯楽 | | | | | | |
|--------|----|------------------------------|--------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 香港 | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H | 銀行 | 62,449,000 | 72.64 | 4,536,416,569 | 67.11 | 4,191,227,166 | 0.47 |
| インドネシア | 株式 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 銀行 | 42,970,200 | 88.62 | 3,808,303,047 | 95.64 | 4,109,884,779 | 0.46 |
| 香港 | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 銀行 | 48,677,350 | 88.07 | 4,287,499,937 | 84.28 | 4,102,682,826 | 0.46 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | 一般消費財・サービス流通・小売り | 137,190 | 31,228.06 | 4,284,178,259 | 28,874.31 | 3,961,266,644 | 0.45 |
| インド | 株式 | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 自動車・自動車部品 | 702,072 | 4,089.66 | 2,871,237,973 | 5,347.44 | 3,754,290,002 | 0.42 |
| 香港 | 株式 | XIAOMI CORP-CLASS B | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 11,615,800 | 376.03 | 4,367,963,261 | 318.40 | 3,698,507,891 | 0.42 |
| インド | 株式 | AXIS BANK LTD | 銀行 | 1,712,951 | 2,068.30 | 3,542,898,809 | 2,141.09 | 3,667,599,386 | 0.41 |
| インド | 株式 | LARSEN & TOUBRO LTD | 資本財 | 523,254 | 6,039.37 | 3,160,125,518 | 6,925.90 | 3,624,009,849 | 0.41 |
| 香港 | 株式 | JD.COM INC-CLASS A | 一般消費財・サービス流通・小売り | 1,816,983 | 2,437.67 | 4,429,219,208 | 1,993.92 | 3,622,922,377 | 0.41 |
| ブラジル | 株式 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | エネルギー | 3,609,800 | 1,122.01 | 4,050,246,159 | 994.60 | 3,590,334,875 | 0.41 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年7月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|------------------------|----------|
| 株式 | エネルギー | 5.03 |
| | 素材 | 6.62 |
| | 資本財 | 4.84 |
| | 商業・専門サービス | 0.03 |
| | 運輸 | 1.86 |
| | 自動車・自動車部品 | 3.87 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.03 |
| | 消費者サービス | 2.25 |
| | メディア・娯楽 | 5.86 |
| | 一般消費財・サービス流通・小売り | 4.84 |
| | 生活必需品流通・小売り | 1.28 |
| | 食品・飲料・タバコ | 3.08 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.79 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 0.87 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.50 |
| | 銀行 | 16.46 |
| | 金融サービス | 2.69 |
| | 保険 | 2.67 |

| | | |
|------|--------------------|-------|
| | ソフトウェア・サービス | 2.59 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 8.86 |
| | 電気通信サービス | 2.60 |
| | 公益事業 | 2.93 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 12.36 |
| | 不動産管理・開発 | 1.34 |
| | 小計 | 97.27 |
| 投資証券 | — | 0.11 |
| 合計 | | 97.37 |

(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7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 取引所名 | 資産の名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 | 簿価金額(円) | 評価金額 | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|----------|------|-------------|--------------|----|-------|--------|---------------|----------------|-------------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ニューヨーク証券取引所 | MINI MS 2409 | 買建 | 3,024 | アメリカドル | 166,484,865.4 | 25,378,952,881 | 162,131,760 | 24,715,365,494 | 2.79 |

(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7月31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 | 795,961,579,060 | 83.23 |
| 地方債証券 | 日本 | 49,644,773,592 | 5.19 |
| 特殊債券 | 日本 | 39,550,285,386 | 4.14 |
| 社債券 | 日本 | 58,910,064,000 | 6.16 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 12,267,079,046 | 1.28 |
| 純資産総額 | | 956,333,781,084 | 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7月31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 | 3,282,560,000 | 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30銘柄

2024年7月31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149回利付国債(5年) | 12,670,000,000 | 99.22 | 12,571,334,900 | 99.07 | 12,553,309,300 | 0.005000 | 2026/9/20 | 1.31 |
| 日本 | 国債証券 | 第359回利付国債(10年) | 11,290,000,000 | 97.08 | 10,960,643,400 | 96.55 | 10,900,946,600 | 0.100000 | 2030/6/20 | 1.14 |
| 日本 | 国債証券 | 第365回利付国債(10年) | 10,970,000,000 | 95.39 | 10,464,398,200 | 94.85 | 10,405,374,100 | 0.100000 | 2031/12/20 | 1.09 |
| 日本 | 国債証券 | 第368回利付国債(10年) | 10,130,000,000 | 95.20 | 9,644,627,100 | 94.62 | 9,585,107,300 | 0.200000 | 2032/9/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第370回利付国債(10年) | 9,860,000,000 | 97.09 | 9,573,841,800 | 96.44 | 9,509,772,800 | 0.500000 | 2033/3/20 | 0.99 |
| 日本 | 国債証券 | 第373回利付国債(10年) | 9,780,000,000 | 97.03 | 9,489,694,800 | 96.40 | 9,428,115,600 | 0.600000 | 2033/12/20 | 0.99 |
| 日本 | 国債証券 | 第356回利付国債(10年) | 9,580,000,000 | 97.53 | 9,343,716,000 | 97.14 | 9,306,491,000 | 0.100000 | 2029/9/20 | 0.97 |
| 日本 | 国債証券 | 第163回利付国債(5年) | 9,330,000,000 | 99.60 | 9,293,548,500 | 99.21 | 9,256,479,600 | 0.400000 | 2028/9/20 | 0.97 |
| 日本 | 国債証券 | 第363回利付国債(10年) | 9,520,000,000 | 95.97 | 9,137,000,000 | 95.49 | 9,091,028,800 | 0.100000 | 2031/6/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第371回利付国債(10年) | 9,510,000,000 | 96.00 | 9,129,633,600 | 95.29 | 9,062,839,800 | 0.400000 | 2033/6/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第369回利付国債(10年) | 9,370,000,000 | 97.27 | 9,114,329,000 | 96.69 | 9,060,040,400 | 0.500000 | 2032/12/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第361回利付国債(10年) | 9,360,000,000 | 96.48 | 9,030,528,000 | 96.06 | 8,991,871,200 | 0.100000 | 2030/12/20 | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第358回利付国債(10年) | 9,240,000,000 | 97.29 | 8,990,506,500 | 96.77 | 8,941,917,600 | 0.100000 | 2030/3/20 | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第158回利付国債(5年) | 9,040,000,000 | 98.73 | 8,925,741,400 | 98.41 | 8,896,625,600 | 0.100000 | 2028/3/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第372回利付国債(10年) | 8,570,000,000 | 99.12 | 8,495,293,500 | 98.44 | 8,437,079,300 | 0.800000 | 2033/9/20 | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第168回利付国債(5年) | 8,300,000,000 | 99.80 | 8,284,110,000 | 99.86 | 8,288,712,000 | 0.600000 | 2029/3/20 | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第367回利付国債(10年) | 8,390,000,000 | 95.54 | 8,016,141,600 | 94.95 | 7,966,388,900 | 0.200000 | 2032/6/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第156回利付国債(5年) | 8,050,000,000 | 99.23 | 7,988,498,000 | 98.91 | 7,962,899,000 | 0.200000 | 2027/12/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第150回利付国債(5年) | 7,430,000,000 | 99.05 | 7,359,777,000 | 98.93 | 7,351,019,100 | 0.005000 | 2026/12/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第148回利付国債(5年) | 7,200,000,000 | 99.30 | 7,149,976,000 | 99.20 | 7,142,760,000 | 0.005000 | 2026/6/20 | 0.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第362回利付国債(10年) | 7,440,000,000 | 96.28 | 7,163,641,200 | 95.80 | 7,127,668,800 | 0.100000 | 2031/3/20 | 0.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第153回利付国債(5年) | 7,220,000,000 | 98.85 | 7,137,496,000 | 98.63 | 7,121,374,800 | 0.005000 | 2027/6/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第366回利付国債(10年) | 7,210,000,000 | 95.72 | 6,901,879,700 | 95.27 | 6,869,111,200 | 0.200000 | 2032/3/20 | 0.72 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------|---------------|----------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第460回利付国債(2年) | 6,700,000,000 | 99.90 | 6,693,722,000 | 99.81 | 6,687,739,000 | 0.300000 | 2026/5/1 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第457回利付国債(2年) | 6,510,000,000 | 99.66 | 6,488,217,400 | 99.61 | 6,484,676,100 | 0.100000 | 2026/2/1 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第350回利付国債(10年) | 6,530,000,000 | 98.73 | 6,447,134,300 | 98.41 | 6,426,434,200 | 0.100000 | 2028/3/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第360回利付国債(10年) | 6,640,000,000 | 96.84 | 6,430,594,400 | 96.32 | 6,396,112,800 | 0.100000 | 2030/9/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第145回利付国債(5年) | 6,410,000,000 | 99.87 | 6,401,731,100 | 99.76 | 6,394,744,200 | 0.100000 | 2025/9/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第458回利付国債(2年) | 6,400,000,000 | 99.82 | 6,388,544,000 | 99.72 | 6,382,336,000 | 0.200000 | 2026/3/1 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第345回利付国債(10年) | 6,340,000,000 | 99.35 | 6,299,107,000 | 99.16 | 6,286,807,400 | 0.100000 | 2026/12/20 | 0.66 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年7月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|-------|----------|
| 国債証券 | 83.23 |
| 地方債証券 | 5.19 |
| 特殊債券 | 4.14 |
| 社債券 | 6.16 |
| 合計 | 98.72 |

(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7月31日現在

| 資産の種類 | 取引所名 | 資産の名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|-------|---------------|----|----|----|---------------|---------------|----------|
| 債券先物取引 | 大阪取引所 | 長期国債先物24年09月限 | 買建 | 23 | 円 | 3,298,801,505 | 3,282,560,000 | 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7月31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 | 301,472,073,180 | 46.05 |
| | 中国 | 65,912,051,632 | 10.07 |
| | フランス | 49,227,851,314 | 7.52 |
| | イタリア | 45,896,925,032 | 7.01 |
| | ドイツ | 38,954,600,194 | 5.95 |

| | | | |
|--------------------------|----------|-----------------|--------|
| | イギリス | 34,020,034,204 | 5.20 |
| | スペイン | 31,221,979,195 | 4.77 |
| | カナダ | 12,580,639,008 | 1.92 |
| | ベルギー | 10,576,947,038 | 1.62 |
| | オランダ | 9,619,952,275 | 1.47 |
| | オーストラリア | 8,066,160,933 | 1.23 |
| | オーストリア | 7,502,965,629 | 1.15 |
| | メキシコ | 4,860,639,138 | 0.74 |
| | ポーランド | 3,516,151,366 | 0.54 |
| | フィンランド | 3,512,068,087 | 0.54 |
| | マレーシア | 3,235,368,326 | 0.49 |
| | アイルランド | 3,160,231,761 | 0.48 |
| | シンガポール | 2,558,194,056 | 0.39 |
| | イスラエル | 2,044,710,980 | 0.31 |
| | デンマーク | 1,600,187,295 | 0.24 |
| | ニュージーランド | 1,550,969,037 | 0.24 |
| | スウェーデン | 1,007,199,509 | 0.15 |
| | ノルウェー | 988,398,818 | 0.15 |
| | 小計 | 643,086,298,007 | 98.22 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 11,635,393,189 | 1.78 |
| 純資産総額 | | 654,721,691,196 | 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7月31日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|------|------|------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| アメリカ | 国債証券 | 4 T-NOTE 340215 | 25,750,000 | 14,640.68 | 3,769,975,834 | 15,071.31 | 3,880,863,390 | 4.000000 | 2034/2/15 | 0.59 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.5 T-NOTE 331115 | 19,430,000 | 15,228.51 | 2,958,901,019 | 15,662.01 | 3,043,130,317 | 4.500000 | 2033/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.625 T-NOTE 260228 | 19,800,000 | 15,166.88 | 3,003,043,595 | 15,266.33 | 3,022,733,343 | 4.625000 | 2026/2/28 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.875 T-NOTE 301115 | 22,310,000 | 12,171.38 | 2,715,435,156 | 12,580.46 | 2,806,702,481 | 0.875000 | 2030/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.875 T-NOTE 330815 | 18,320,000 | 14,513.65 | 2,658,902,056 | 14,940.01 | 2,737,010,407 | 3.875000 | 2033/8/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.375 T-NOTE 270515 | 18,570,000 | 14,281.53 | 2,652,080,505 | 14,515.14 | 2,695,462,658 | 2.375000 | 2027/5/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.5 T-NOTE 330215 | 17,690,000 | 14,137.32 | 2,500,892,130 | 14,557.72 | 2,575,261,070 | 3.500000 | 2033/2/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.375 T-NOTE 311115 | 20,320,000 | 12,239.26 | 2,487,018,566 | 12,652.22 | 2,570,931,568 | 1.375000 | 2031/11/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.25 T-NOTE 310815 | 19,990,000 | 12,214.85 | 2,441,748,600 | 12,623.04 | 2,523,346,566 | 1.250000 | 2031/8/15 | 0.39 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|---------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|----------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | 4.125 T-NOTE 321115 | 16,070,000 | 14,833.12 | 2,383,683,449 | 15,263.35 | 2,452,820,780 | 4.125000 | 2032/11/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.375 T-NOTE 330515 | 16,800,000 | 13,970.68 | 2,347,075,798 | 14,399.32 | 2,419,087,021 | 3.375000 | 2033/5/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.75 T-NOTE 320815 | 17,340,000 | 13,410.25 | 2,325,338,036 | 13,835.71 | 2,399,113,229 | 2.750000 | 2032/8/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.875 T-NOTE 320515 | 17,030,000 | 13,581.45 | 2,312,921,147 | 14,004.82 | 2,385,022,474 | 2.875000 | 2032/5/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.625 T-NOTE 310515 | 17,540,000 | 12,651.66 | 2,219,102,293 | 13,050.59 | 2,289,073,631 | 1.625000 | 2031/5/15 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.875 T-NOTE 320215 | 16,860,000 | 12,643.88 | 2,131,759,119 | 13,060.41 | 2,201,986,146 | 1.875000 | 2032/2/15 | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.625 T-NOTE 290430 | 14,050,000 | 15,429.34 | 2,167,822,967 | 15,618.25 | 2,194,364,417 | 4.625000 | 2029/4/30 | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.125 T-NOTE 310215 | 17,120,000 | 12,311.91 | 2,107,799,313 | 12,712.96 | 2,176,458,754 | 1.125000 | 2031/2/15 | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.625 T-NOTE 300815 | 17,350,000 | 12,045.73 | 2,089,935,420 | 12,463.16 | 2,162,358,408 | 0.625000 | 2030/8/15 | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.125 T-NOTE 281115 | 14,380,000 | 14,370.10 | 2,066,421,018 | 14,673.54 | 2,110,055,175 | 3.125000 | 2028/11/15 | 0.32 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.25 T-NOTE 251231 | 13,580,000 | 15,071.31 | 2,046,684,457 | 15,173.43 | 2,060,552,730 | 4.250000 | 2025/12/31 | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.25 T-NOTE 260131 | 13,390,000 | 15,098.65 | 2,021,710,395 | 15,177.30 | 2,032,241,474 | 4.250000 | 2026/1/31 | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.125 T-NOTE 280831 | 14,930,000 | 13,218.33 | 1,973,497,696 | 13,560.31 | 2,024,554,593 | 1.125000 | 2028/8/31 | 0.31 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.5 T-NOTE 270415 | 13,000,000 | 15,170.16 | 1,972,121,044 | 15,351.77 | 1,995,731,375 | 4.500000 | 2027/4/15 | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.25 T-BOND 540215 | 13,340,000 | 14,275.31 | 1,904,327,055 | 14,853.37 | 1,981,439,890 | 4.250000 | 2054/2/15 | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.75 T-NOTE 260331 | 13,590,000 | 14,123.03 | 1,919,319,779 | 14,337.99 | 1,948,533,432 | 0.750000 | 2026/3/31 | 0.30 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.5 T-NOTE 270131 | 13,540,000 | 14,006.91 | 1,896,536,119 | 14,261.47 | 1,931,003,937 | 1.500000 | 2027/1/31 | 0.29 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.5 T-NOTE 270515 | 12,500,000 | 15,226.46 | 1,903,308,675 | 15,360.11 | 1,920,014,555 | 4.500000 | 2027/5/15 | 0.29 |
| 中国 | 国債証券 | 2.39 CHINA GOVT 261115 | 88,000,000 | 2,126.65 | 1,871,456,955 | 2,137.48 | 1,880,988,525 | 2.390000 | 2026/11/15 | 0.29 |
| アメリカ | 国債証券 | 4 T-NOTE 270115 | 12,300,000 | 14,970.67 | 1,841,393,616 | 15,149.91 | 1,863,439,650 | 4.000000 | 2027/1/15 | 0.28 |
| アメリカ | 国債証券 | 4.125 T-NOTE 310331 | 12,100,000 | 14,905.76 | 1,803,598,053 | 15,294.61 | 1,850,648,390 | 4.125000 | 2031/3/31 | 0.28 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年7月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 98.22 |
| 合計 | 98.22 |

(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。

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|--------------------------|---------|-----------------|----------|
| 国債証券 | マレーシア | 9,885,314,214 | 9.87 |
| | インドネシア | 9,784,361,903 | 9.77 |
| | 中国 | 9,644,557,700 | 9.63 |
| | メキシコ | 9,372,739,330 | 9.36 |
| | タイ | 9,357,524,499 | 9.35 |
| | ブラジル | 8,491,295,128 | 8.48 |
| | 南アフリカ | 8,471,792,609 | 8.46 |
| | ポーランド | 7,712,193,762 | 7.70 |
| | チェコ | 5,932,761,413 | 5.93 |
| | コロンビア | 4,198,435,279 | 4.19 |
| | ルーマニア | 3,840,666,175 | 3.84 |
| | ハンガリー | 2,914,590,541 | 2.91 |
| | ペルー | 1,897,929,118 | 1.90 |
| | チリ | 1,760,515,300 | 1.76 |
| | トルコ | 1,453,492,488 | 1.45 |
| | インド | 844,766,155 | 0.84 |
| | セルビア | 353,111,624 | 0.35 |
| | ウルグアイ | 173,816,550 | 0.17 |
| | ドミニカ共和国 | 135,695,317 | 0.14 |
| | 小計 | 96,225,559,105 | 96.12 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 3,888,726,747 | 3.88 |
| 純資産総額 | | 100,114,285,852 | 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7月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|------|------|-----------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| ブラジル | 国債証券 | BRAZIL-LTN 260701 | 65,800,000 | 2,166.08 | 1,425,282,024 | 2,190.46 | 1,441,327,559 | — | 2026/7/1 | 1.44 |
| ブラジル | 国債証券 | 10(IN) BRAZIL NTN 290101 | 50,900,000 | 2,679.25 | 1,363,739,028 | 2,562.09 | 1,304,107,872 | 10.000000 | 2029/1/1 | 1.30 |
| ブラジル | 国債証券 | BRAZIL-LTN 260101 | 54,700,000 | 2,273.38 | 1,243,543,885 | 2,319.19 | 1,268,599,665 | — | 2026/1/1 | 1.27 |
| ブラジル | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NT | 44,870,000 | 2,725.52 | 1,222,942,461 | 2,636.86 | 1,183,161,211 | 10.000000 | 2027/1/1 | 1.18 |

| | | | | | | | | | | | |
|-------|------|--------------------------|-------------|----------|---------------|----------|---------------|-----------|------------|------|--|
| | | 270101 | | | | | | | | | |
| 南アフリカ | 国債証券 | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 166,000,000 | 606.74 | 1,007,198,901 | 643.05 | 1,067,467,648 | 8.750000 | 2048/2/28 | 1.07 | |
| 南アフリカ | 国債証券 | 8 SOUTH AFRICA 300131 | 132,200,000 | 767.35 | 1,014,448,201 | 780.47 | 1,031,792,445 | 8.000000 | 2030/1/31 | 1.03 | |
| 南アフリカ | 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 118,600,000 | 866.25 | 1,027,384,178 | 869.44 | 1,031,155,840 | 10.500000 | 2026/12/21 | 1.03 | |
| メキシコ | 国債証券 | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 135,200,000 | 748.23 | 1,011,609,974 | 752.96 | 1,018,009,254 | 5.750000 | 2026/3/5 | 1.02 | |
| ブラジル | 国債証券 | BRAZIL-LTN 250701 | 40,800,000 | 2,387.30 | 974,020,529 | 2,462.23 | 1,004,591,303 | — | 2025/7/1 | 1.00 | |
| メキシコ | 国債証券 | 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 134,200,000 | 724.34 | 972,073,126 | 727.35 | 976,110,860 | 5.500000 | 2027/3/4 | 0.97 | |
| メキシコ | 国債証券 | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 133,500,000 | 743.71 | 992,863,659 | 729.81 | 974,306,839 | 7.750000 | 2031/5/29 | 0.97 | |
| 南アフリカ | 国債証券 | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 129,200,000 | 725.80 | 937,734,257 | 744.05 | 961,322,419 | 8.250000 | 2032/3/31 | 0.96 | |
| 南アフリカ | 国債証券 | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 131,500,000 | 699.04 | 919,243,170 | 723.13 | 950,919,632 | 8.875000 | 2035/2/28 | 0.95 | |
| 南アフリカ | 国債証券 | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 121,440,000 | 648.40 | 787,417,434 | 674.62 | 819,267,272 | 8.500000 | 2037/1/31 | 0.82 | |
| チェコ | 国債証券 | 0.25 CZECH REPUB 270210 | 133,500,000 | 582.46 | 777,588,997 | 596.27 | 796,028,692 | 0.250000 | 2027/2/10 | 0.80 | |
| ポーランド | 国債証券 | 6 POLAND 331025 | 19,700,000 | 4,024.14 | 792,755,680 | 3,989.05 | 785,844,118 | 6.000000 | 2033/10/25 | 0.78 | |
| マレーシア | 国債証券 | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 23,200,000 | 3,339.20 | 774,694,656 | 3,354.82 | 778,318,928 | 3.885000 | 2029/8/15 | 0.78 | |
| ポーランド | 国債証券 | 7.5 POLAND 280725 | 18,500,000 | 4,197.14 | 776,472,417 | 4,150.02 | 767,754,159 | 7.500000 | 2028/7/25 | 0.77 | |
| マレーシア | 国債証券 | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 21,040,000 | 3,558.10 | 748,625,210 | 3,583.33 | 753,932,870 | 4.696000 | 2042/10/15 | 0.75 | |
| メキシコ | 国債証券 | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 113,900,000 | 686.31 | 781,716,441 | 657.33 | 748,703,526 | 7.750000 | 2042/11/13 | 0.75 | |
| メキシコ | 国債証券 | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 98,200,000 | 767.94 | 754,123,196 | 762.40 | 748,686,119 | 7.500000 | 2027/6/3 | 0.75 | |
| チェコ | 国債証券 | 5 CZECH REPUBLIC 300930 | 103,700,000 | 692.21 | 717,831,008 | 700.27 | 726,187,033 | 5.000000 | 2030/9/30 | 0.73 | |
| チェコ | 国債証券 | 5.5 CZECH REPUBLI 281212 | 102,000,000 | 699.37 | 713,363,246 | 699.95 | 713,951,088 | 5.500000 | 2028/12/12 | 0.71 | |
| メキシコ | 国債証券 | 7.5 MEXICAN BONOS 330526 | 101,800,000 | 717.55 | 730,467,948 | 701.19 | 713,814,798 | 7.500000 | 2033/5/26 | 0.71 | |
| ポーランド | 国債証券 | 2.75 POLAND 291025 | 20,800,000 | 3,403.92 | 708,016,293 | 3,407.82 | 708,827,034 | 2.750000 | 2029/10/25 | 0.71 | |
| ポーランド | 国債証券 | 2.5 POLAND 260725 | 19,000,000 | 3,624.36 | 688,629,005 | 3,666.14 | 696,568,127 | 2.500000 | 2026/7/25 | 0.70 | |
| メキシコ | 国債証券 | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 89,100,000 | 786.85 | 701,091,575 | 771.41 | 687,332,835 | 8.500000 | 2029/5/31 | 0.69 | |
| マレーシア | 国債証券 | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 20,600,000 | 3,330.76 | 686,137,150 | 3,329.35 | 685,847,795 | 3.955000 | 2025/9/15 | 0.69 | |
| 南アフリカ | 国債証券 | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 105,700,000 | 617.80 | 653,023,504 | 646.50 | 683,356,419 | 8.750000 | 2044/1/31 | 0.68 | |
| マレーシア | 国債証券 | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 20,300,000 | 3,339.95 | 678,009,982 | 3,339.83 | 677,986,778 | 3.906000 | 2026/7/15 | 0.68 | |

(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7月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|----|----------|
|----|----------|

| | |
|------|-------|
| 国債証券 | 96.12 |
| 合計 | 96.12 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

東証REIT指数マザーファンド

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|--------------------------|------|-----------------|----------|
| 投資証券 | 日本 | 119,402,928,500 | 98.56 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 1,740,340,894 | 1.44 |
| 純資産総額 | | 121,143,269,394 | 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7月31日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 建別 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|-------------|----|------|---------------|----------|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | 日本 | 1,719,350,000 | 1.42 |

(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7月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|------|------|-------------------|--------|------------|---------------|----------|---------------|----------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 14,006 | 590,973.49 | 8,277,174,700 | 579,000 | 8,109,474,000 | 6.69 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 12,332 | 557,908 | 6,880,121,456 | 520,000 | 6,412,640,000 | 5.29 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 38,824 | 157,937.87 | 6,131,779,864 | 147,700 | 5,734,304,800 | 4.73 |
| 日本 | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 | 60,484 | 98,050.15 | 5,930,465,382 | 93,600 | 5,661,302,400 | 4.67 |
| 日本 | 投資証券 | GLP投資法人 | 40,327 | 131,289.41 | 5,294,508,037 | 131,400 | 5,298,967,800 | 4.37 |
| 日本 | 投資証券 | KDX不動産投資法人 | 33,588 | 159,580.08 | 5,359,975,727 | 154,600 | 5,192,704,800 | 4.29 |

| | | | | | | | | |
|----|------|---------------------|--------|------------|---------------|---------|---------------|------|
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 20,915 | 266,746.9 | 5,579,011,413 | 247,100 | 5,168,096,500 | 4.27 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 66,149 | 62,347.35 | 4,124,215,384 | 68,100 | 4,504,746,900 | 3.72 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 18,097 | 253,330.94 | 4,584,530,021 | 242,100 | 4,381,283,700 | 3.62 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 26,856 | 149,599.96 | 4,017,656,525 | 143,400 | 3,851,150,400 | 3.18 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 23,922 | 168,584.49 | 4,032,878,169 | 156,100 | 3,734,224,200 | 3.08 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 11,799 | 328,716.91 | 3,878,530,821 | 315,000 | 3,716,685,000 | 3.07 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 44,104 | 76,395.41 | 3,369,343,162 | 76,800 | 3,387,187,200 | 2.80 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 36,077 | 78,401.76 | 2,828,500,295 | 79,300 | 2,860,906,100 | 2.36 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 21,982 | 134,354.11 | 2,953,372,225 | 123,600 | 2,716,975,200 | 2.24 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 8,211 | 349,230.97 | 2,867,535,494 | 326,500 | 2,680,891,500 | 2.21 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 4,146 | 610,638.45 | 2,531,707,013 | 642,000 | 2,661,732,000 | 2.20 |
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 | 15,381 | 149,767.27 | 2,303,570,379 | 148,200 | 2,279,464,200 | 1.88 |
| 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 5,006 | 457,162.21 | 2,288,554,023 | 422,500 | 2,115,035,000 | 1.75 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 8,067 | 278,520.15 | 2,246,822,109 | 256,200 | 2,066,765,400 | 1.71 |
| 日本 | 投資証券 | アクティブア・プロパティーズ投資法人 | 5,836 | 403,032.64 | 2,352,098,487 | 353,500 | 2,063,026,000 | 1.70 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 4,455 | 431,639.99 | 1,922,956,155 | 434,500 | 1,935,697,500 | 1.60 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 14,727 | 140,546.94 | 2,069,834,785 | 129,600 | 1,908,619,200 | 1.58 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 5,912 | 314,752.46 | 1,860,816,544 | 311,500 | 1,841,588,000 | 1.52 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 14,118 | 138,622.66 | 1,957,074,713 | 128,600 | 1,815,574,800 | 1.50 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 | 17,732 | 105,964.33 | 1,878,959,499 | 101,900 | 1,806,890,800 | 1.49 |
| 日本 | 投資証券 | 森トラストリート投資法人 | 23,142 | 73,815.12 | 1,708,229,507 | 69,800 | 1,615,311,600 | 1.33 |
| 日本 | 投資証券 | 三菱地所物流リート投資法人 | 4,146 | 376,235.05 | 1,559,870,517 | 378,500 | 1,569,261,000 | 1.30 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 | 10,609 | 154,625.65 | 1,640,423,520 | 142,700 | 1,513,904,300 | 1.25 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 4,974 | 303,912.09 | 1,511,658,735 | 293,400 | 1,459,371,600 | 1.20 |

(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7月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 投資証券 | 98.56 |
| 合計 | 98.56 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年7月31日現在

| 資産の種類 | 取引所名 | 資産の名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|-------------|-------|----------------|----|-------|----|---------------|---------------|----------|
| 不動産投信指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証REIT 24年09月限 | 買建 | 1,004 | 円 | 1,707,168,840 | 1,719,350,000 | 1.42 |

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

投資状況

2024年7月31日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|--------------------------|----------|-----------------|----------|
| 投資証券 | アメリカ | 107,150,394,463 | 76.38 |
| | オーストラリア | 9,756,179,618 | 6.95 |
| | イギリス | 6,783,250,145 | 4.84 |
| | シンガポール | 4,064,975,065 | 2.90 |
| | フランス | 2,260,374,927 | 1.61 |
| | カナダ | 1,947,595,112 | 1.39 |
| | ベルギー | 1,392,926,921 | 0.99 |
| | 香港 | 1,191,110,863 | 0.85 |
| | スペイン | 629,841,867 | 0.45 |
| | ニュージーランド | 372,287,777 | 0.27 |
| | オランダ | 241,432,802 | 0.17 |
| | 韓国 | 239,354,173 | 0.17 |
| | イスラエル | 126,654,785 | 0.09 |
| | ガンジー | 111,688,242 | 0.08 |
| | ドイツ | 46,720,996 | 0.03 |
| | アイルランド | 34,996,273 | 0.02 |
| | イタリア | 7,513,134 | 0.01 |
| | 小計 | 136,357,297,163 | 97.20 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 3,922,066,971 | 2.80 |
| 純資産総額 | | 140,279,364,134 | 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7月31日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 建別 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|-------------|----|------|---------------|----------|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 3,883,104,120 | 2.77 |

(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7月31日現在

| 国／ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|-------------|------|------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 578,556 | 19,713.54 | 11,405,387,312 | 19,221.15 | 11,120,517,214 | 7.93 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 59,304 | 121,192.15 | 7,187,179,359 | 117,191.29 | 6,949,912,784 | 4.95 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 373,522 | 13,719.02 | 5,124,359,395 | 17,109.86 | 6,390,911,219 | 4.56 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 543,786 | 8,716.32 | 4,739,818,172 | 8,897.92 | 4,838,565,848 | 3.45 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 203,617 | 21,462.02 | 4,370,033,674 | 23,599.23 | 4,805,205,718 | 3.43 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 98,814 | 45,512.48 | 4,497,270,831 | 46,398.16 | 4,584,788,059 | 3.27 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 202,763 | 20,314.15 | 4,118,958,889 | 22,109.89 | 4,483,069,167 | 3.20 |
| オースト ラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 1,079,366 | 2,456.37 | 2,651,324,960 | 3,492.73 | 3,769,936,708 | 2.69 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 132,306 | 23,774.54 | 3,145,514,607 | 24,862.96 | 3,289,519,315 | 2.34 |
| アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 652,459 | 4,832.46 | 3,152,982,263 | 4,789.66 | 3,125,059,906 | 2.23 |
| アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC | 183,118 | 10,301.89 | 1,886,462,445 | 15,440.64 | 2,827,460,507 | 2.02 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 88,654 | 28,027.61 | 2,484,760,482 | 31,423.98 | 2,785,861,665 | 1.99 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 215,323 | 9,289.69 | 2,000,284,695 | 10,605.25 | 2,283,554,418 | 1.63 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 252,783 | 7,452.79 | 1,883,939,019 | 8,362.85 | 2,113,988,435 | 1.51 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 359,471 | 5,186.00 | 1,864,219,770 | 5,333.87 | 1,917,373,596 | 1.37 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 98,370 | 19,122.07 | 1,881,038,380 | 18,143.40 | 1,784,767,124 | 1.27 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 40,091 | 37,187.73 | 1,490,893,604 | 42,805.15 | 1,716,101,349 | 1.22 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 72,957 | 20,131.22 | 1,468,713,884 | 21,541.29 | 1,571,588,361 | 1.12 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 77,882 | 20,096.16 | 1,565,129,538 | 19,396.46 | 1,510,635,534 | 1.08 |
| イギリス | 投資証券 | SEGRE PLC | 834,522 | 1,695.28 | 1,414,749,791 | 1,787.28 | 1,491,531,824 | 1.06 |
| アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 439,619 | 2,971.05 | 1,306,132,492 | 3,329.28 | 1,463,618,965 | 1.04 |
| アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 416,715 | 3,144.83 | 1,310,500,834 | 3,358.25 | 1,399,434,482 | 1.00 |
| アメリカ | 投資証券 | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 168,540 | 7,352.86 | 1,239,251,044 | 7,660.10 | 1,291,034,939 | 0.92 |
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 136,577 | 9,756.15 | 1,332,467,064 | 9,268.35 | 1,265,843,711 | 0.90 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 116,370 | 10,533.60 | 1,225,795,498 | 10,449.76 | 1,216,038,804 | 0.87 |
| アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC | 440,505 | 3,000.01 | 1,321,523,457 | 2,713.43 | 1,195,280,363 | 0.85 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 189,159 | 5,765.28 | 1,090,554,751 | 6,227.17 | 1,177,926,007 | 0.84 |
| アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 66,518 | 14,933.02 | 993,314,784 | 17,041.26 | 1,133,551,038 | 0.81 |
| アメリカ | 投資証券 | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 201,191 | 5,456.52 | 1,097,804,323 | 5,509.18 | 1,108,397,755 | 0.79 |
| オースト ラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP | 3,234,389 | 294.96 | 954,028,317 | 338.80 | 1,095,843,337 | 0.78 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年7月31日現在

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 投資証券 | 97.20 |
| 合計 | 97.20 |

(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7月31日現在

| 資産の種類 | 地域 | 取引所名 | 資産の名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 | 簿価金額 (円) | 評価金額 | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|-------------------------|----------|--------------|------------|----|-----|------------|------------|---------------|------------|---------------|----------|
| 不動産 投信指 数先物 取引 | アメリ カ | シカゴ商品 取引所 | DJREIT2409 | 買建 | 700 | アメリカ ドル | 23,703,740 | 3,613,398,126 | 25,473,000 | 3,883,104,120 | 2.77 |

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

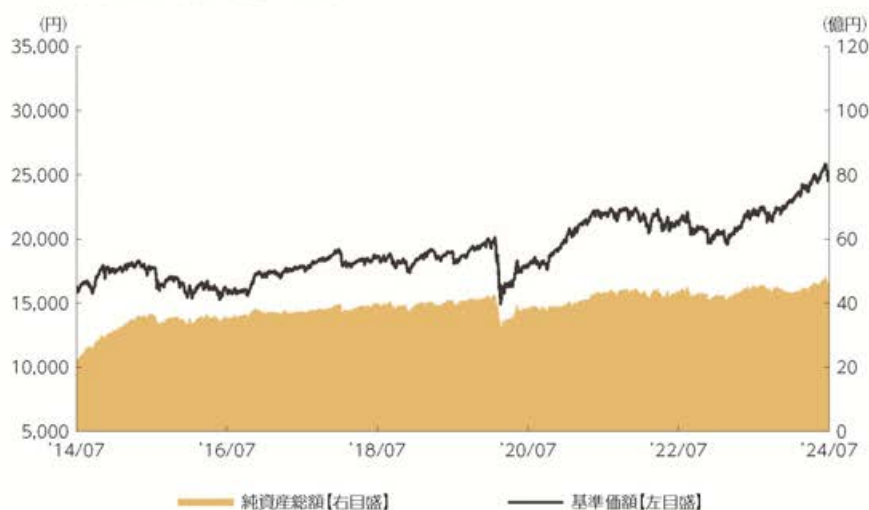
《参考情報》



運用実績

2024年7月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2014年7月31日～2024年7月31日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 24,627円 |
| 純資産総額 | 45.7億円 |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

| | |
|---------|----|
| 2024年1月 | 0円 |
| 2023年1月 | 0円 |
| 2022年1月 | 0円 |
| 2021年1月 | 0円 |
| 2020年1月 | 0円 |
| 2019年1月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

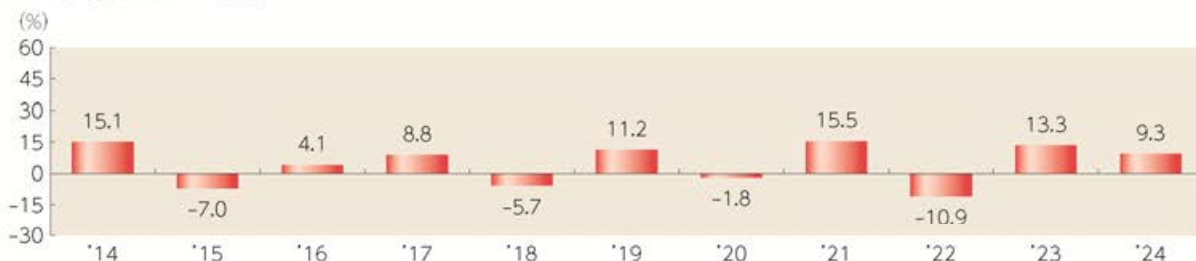
■主要な資産の状況

| 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 | 11.7% | 1 円 | 32.8% | 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 | 1.0% |
| 国内債券 | 3.7% | 2 アメリカドル | 31.2% | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | 台湾 | 0.9% |
| 国内リート | 12.5% | 3 ユーロ | 6.1% | MICROSOFT CORP | 株式 | ソフトウェア・サービス | アメリカ | 0.9% |
| 外国株式 | 28.6% | 4 中国元 | 2.9% | NVIDIA CORP | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | アメリカ | 0.8% |
| 外国債券 | 24.1% | 5 インドルピー | 2.1% | BRAZIL-LTN 260701 | 債券 | 国債 | ブラジル | 0.2% |
| 外国リート | 12.6% | 6 イギリスポンド | 2.1% | 10(IN) BRAZIL NTN 290101 | 債券 | 国債 | ブラジル | 0.2% |
| コールローン他 (負債控除後) | 6.8% | 7 香港ドル | 2.0% | BRAZIL-LTN 260101 | 債券 | 国債 | ブラジル | 0.2% |
| 合計 | 100.0% | 8 ニュー台湾ドル | 1.9% | PROLOGIS INC | リート | - | アメリカ | 1.0% |
| | | 9 ブラジルレアル | 1.5% | 日本ビルファンド投資法人 | リート | - | 日本 | 0.8% |
| | | 10 メキシコペソ | 1.5% | ジャパンリアルエステイト投資法人 | リート | - | 日本 | 0.7% |

| その他資産の状況 | 比率 |
|------------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建) | 0.9% |
| 債券先物取引 (買建) | 0.0% |
| 不動産投信指数先物取引 (買建) | 0.5% |

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 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
- 2024年は年初から7月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みできません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

⑧申込受付時間

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

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

ります。

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

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

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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から信託財産留保額を差引いた価額

④信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%をかけた額

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社
お客様専用フリーダイヤル 0120-151034
(受付時間：営業日の9:00～17:00)
ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>
eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

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

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

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

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

(資産の評価方法)

- ・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

- ・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限（2011年10月31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1月27日から翌年1月26日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

②信託約款の変更等

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

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

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

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱に関する契約」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 1 月 27 日から 2024 年 1 月 26 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4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

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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eMAXIS バランス（波乗り型）の2023年1月27日から2024年1月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、eMAXIS バランス（波乗り型）の2024年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJ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】

【eMAXIS バランス（波乗り型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第12期 [2023年1月26日現在] | 第13期 [2024年1月26日現在] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 149,317,223 | 122,110,038 |
| 親投資信託受益証券 | 4,008,376,587 | 4,103,104,836 |
| 未収入金 | 56,782,705 | 113,170,532 |
| 流動資産合計 | 4,214,476,515 | 4,338,385,406 |
| 資産合計 | 4,214,476,515 | 4,338,385,406 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 342,082 | 24,644,360 |
| 未払受託者報酬 | 1,422,514 | 1,475,546 |
| 未払委託者報酬 | 10,431,754 | 10,820,590 |
| 未払利息 | 67 | 31 |
| その他未払費用 | 85,289 | 88,464 |
| 流動負債合計 | 12,281,706 | 37,028,991 |
| 負債合計 | 12,281,706 | 37,028,991 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 2,069,127,970 | 1,878,027,316 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,133,066,839 | 2,423,329,099 |
| （分配準備積立金） | 655,045,068 | 741,990,189 |
| 元本等合計 | 4,202,194,809 | 4,301,356,415 |
| 純資産合計 | 4,202,194,809 | 4,301,356,415 |
| 負債純資産合計 | 4,214,476,515 | 4,338,385,406 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第12期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日 | 第13期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日 |
|-------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 230 | 1,107 |
| 有価証券売買等損益 | △187,482,573 | 548,069,933 |
| 営業収益合計 | △187,482,343 | 548,071,040 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 32,578 | 44,477 |
| 受託者報酬 | 2,823,016 | 2,878,396 |

| | | |
|---|---------------|---------------|
| 委託者報酬 | 20,702,028 | 21,108,092 |
| その他費用 | 169,259 | 172,567 |
| 営業費用合計 | 23,726,881 | 24,203,532 |
| 営業利益又は営業損失(△) | △211,209,224 | 523,867,508 |
| 経常利益又は経常損失(△) | △211,209,224 | 523,867,508 |
| 当期純利益又は当期純損失(△) | △211,209,224 | 523,867,508 |
| 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(△) | △5,155,186 | 66,273,793 |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△) | 2,261,278,893 | 2,133,066,839 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 314,202,348 | 304,401,681 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 314,202,348 | 304,401,681 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 236,360,364 | 471,733,136 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 236,360,364 | 471,733,136 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 2,133,066,839 | 2,423,329,099 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | 第12期 [2023年1月26日現在] | 第13期 [2024年1月26日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額 | 1,994,064,954円 | 2,069,127,970円 |
| 期中追加設定元本額 | 284,091,628円 | 264,340,736円 |
| 期中一部解約元本額 | 209,028,612円 | 455,441,390円 |
| 2. 受益権の総数 | 2,069,127,970口 | 1,878,027,316口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第12期 自2022年1月27日 至2023年1月26日 | | | 第13期 自2023年1月27日 至2024年1月26日 | | |
|------------------------------------|--------------|----------------|------------------------------------|--------------|----------------|
| 1. 分配金の計算過程 | | | 1. 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 93,035,742円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 116,296,173円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | —円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 103,052,424円 |
| 収益調整金額 | C | 1,478,021,771円 | 収益調整金額 | C | 1,681,338,910円 |
| 分配準備積立金額 | D | 562,009,326円 | 分配準備積立金額 | D | 522,641,592円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,133,066,839円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,423,329,099円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,069,127,970口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,878,027,316口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 10,308円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 12,903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12期 自 2022年1月27日 至 2023年1月26日 | 第13期 自 2023年1月27日 至 2024年1月26日 |
|--------------------------|---|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 第12期 [2023年1月26日現在] | 第13期 [2024年1月26日現在] |
|----------------------------|--|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | (1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第12期 [2023年1月26日現在] | 第13期 [2024年1月26日現在] |
|----|------------------------|------------------------|
| | | |

| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 23,926,658 | 285,686,481 |
| 合計 | 23,926,658 | 285,686,481 |

(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12期 [2023年1月26日現在] | 第13期 [2024年1月26日現在] |
|---------------------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.0309円 (20,309円) | 2.2904円 (22,904円) |

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|-----------|--------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | MUAM G-REITマザーファンド | 210,075,177 | 537,267,265 | |
| | 新興国株式インデックスマザーファンド | 54,786,673 | 188,570,249 | |
| | 東証REIT指数マザーファンド | 150,884,725 | 532,336,398 | |
| | 新興国債券インデックスマザーファンド | 305,210,639 | 540,894,294 | |
| | TOPIXマザーファンド | 228,954,458 | 694,075,439 | |
| | 外国株式インデックスマザーファンド | 96,518,422 | 601,589,672 | |
| | 日本債券インデックスマザーファンド | 366,017,906 | 466,563,024 | |
| | 外国債券インデックスマザーファンド | 210,492,811 | 541,808,495 | |
| 合計 | | 1,622,940,811 | 4,103,104,836 | |

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1月26日現在]

| 資産の部 | |
|-------------|-------------------|
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 72,840,188,264 |
| 株式 | 1,255,140,150,820 |
| 派生商品評価勘定 | 210,245,700 |
| 未収配当金 | 1,660,274,048 |
| 未収利息 | 246,307 |
| その他未収収益 | 10,304,786 |
| 差入委託証拠金 | 563,067,892 |
| 流動資産合計 | 1,330,424,477,817 |
| 資産合計 | 1,330,424,477,817 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 98,872,200 |
| 前受金 | 290,258,500 |
| 未払金 | 996,238,760 |
| 未払解約金 | 789,140,304 |
| 未払利息 | 18,619 |
| 受入担保金 | 61,636,051,496 |
| 流動負債合計 | 63,810,579,879 |
| 負債合計 | 63,810,579,879 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 417,817,127,461 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 848,796,770,477 |
| 元本等合計 | 1,266,613,897,938 |
| 純資産合計 | 1,266,613,897,938 |
| 負債純資産合計 | 1,330,424,477,817 |

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1月26日現在] |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2023年1月27日 |
| 期首元本額 | 366,259,437,339円 |
| 期中追加設定元本額 | 192,381,950,775円 |
| 期中一部解約元本額 | 140,824,260,653円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ トピックスインデックスオープン | 6,447,018,234円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 840,780,915円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 3,761,141,819円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 3,598,073,030円 |
| 三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金) | 3,565,619,436円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 6,356,443,497円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 35,553,887,762円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 42,242,188,254円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 92,405,749円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 244,937,376円 |
| ファンド・マネジャー(国内株式) | 612,208,925円 |
| eMAXIS TOPIXインデックス | 6,978,711,056円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,993,275,807円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 228,954,458円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 2,866,630,004円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 858,983,509円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 1,082,939,793円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 1,052,405,792円 |
| eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX) | 38,944,512,990円 |
| 国内株式セレクション(ラップ向け) | 4,601,781,983円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 10,068,792,022円 |
| つみたて日本株式(TOPIX) | 8,659,070,945円 |
| つみたて8資産均等バランス | 5,019,302,203円 |
| つみたて4資産均等バランス | 1,747,997,110円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 2,638,218円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 4,475,360円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 7,789,488円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 706,699,665円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金) | 894,234,726円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金) | 646,107,976円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式15) | 559,296,813円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式40) | 1,772,410,850円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式65) | 4,027,732,153円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型) | 1,172,977,495円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス(国内株式) | 4,028,231,985円 |

| | |
|---|-----------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 574,783,344円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 163,770,540円 |
| 国内株式インデックス・オープン (ラップ向け) | 19,607,155,130円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 261,577,385円 |
| ラップ向けインデックスf 国内株式 | 3,966,842,893円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 160,349,292円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型) | 2,710,125,103円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型) | 1,467,640,059円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 45,804,787円 |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け) | 6,964,475,565円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド | 145,989,087円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 23,075,486円 |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け) | 29,710,782円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金) | 1,601,769円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型) | 1,211,727,734円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型) | 2,638,567,745円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 448,561,299円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) | 1,498,549,889円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型) | 335,496,678円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 15,511,339円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型) | 103,433,057円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 698,350,090円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 128,295,672円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 157,971,210円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 589,860,601円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 497,928,025円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 990,555,948円 |
| 三菱UFJ トピックスオープン | 976,536,102円 |
| 三菱UFJ DCトピックスオープン | 7,919,035,586円 |
| 三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定) | 52,966,008円 |
| 三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA (適格機関投資家限定) | 4,295,287,317円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定) | 604円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 7,904,229円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 3,902,061,723円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 69,091,505円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 1,287,114,079円 |
| MUAM 日本株式インデックスファンド (適格機関投資家限定) | 41,935,804,106円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定) | 200,683,429円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 225,958円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 129,085円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 205,706,647円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 359,856,686円 |
| MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定) | 3,913,205,044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) | 3,716,634,839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） | 1,121,022,107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） | 500,920,574円 |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定） | 87,858,660円 |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定） | 3,480,217,629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） | 172,866,220円 |
| MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定） | 3,179,402,391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） | 322,075,532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） | 17,337,864,283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） | 103,238,774円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 310,244円 |
| 日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定） | 123,848,439円 |
| 日本株式インデックスファンドS | 2,549,588,259円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 35,980,732円 |
| MUKAM 米回国債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 92,748,992円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定） | 35,434,968円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定） | 35,501,352円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 35,160,631円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 35,822,253円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定） | 35,950,680円 |
| MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定） | 333,253,973円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07（適格機関投資家限定） | 34,885,307円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09（適格機関投資家限定） | 34,844,004円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定） | 35,768,349円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定） | 35,818,860円 |
| MUKAM 日米コアバランス（除く米国株）2022-03（適格機関投資家限定） | 710,000,989円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定） | 40,180,532円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定） | 39,815,667円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定） | 40,598,807円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定） | 40,095,797円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定） | 34,367,095円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定） | 39,980,785円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定） | 34,332,624円 |

| | |
|---|-------------------|
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定) | 35,329,633 円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド | 5,447,585,274 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 2,728,314 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 6,896,345 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 1,487,796 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 6,058,830 円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1 | 471,389,680 円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA | 74,343,277 円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 3,030,411 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 25,320,501 円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 1,438,650 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 14,619,491 円 |
| 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド | 1,578,965,324 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) | 327,017,765 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) | 1,404,986,549 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) | 1,356,780,443 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) | 1,267,602,997 円 |
| 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド | 59,531,179,818 円 |
| 合計 | 417,817,127,461 円 |
| 2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式 | 57,979,517,320 円 |
| 3. 受益権の総数 | 417,817,127,461 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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、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 1 月 26 日現在] |
|----|---------------------|

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年1月26日現在] | |
|----|--------------------|-----------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | |
| 株式 | | 232,891,016,432 |
| 合計 | | 232,891,016,432 |

(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1月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|----------|----------------|-------|----------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 12,360,851,500 | — | 12,472,500,000 | 111,648,500 |
| 合計 | | 12,360,851,500 | — | 12,472,500,000 | 111,648,500 |

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| | [2024年1月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 3.0315円 |
| (1万口当たり純資産額) | (30,315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 | 18,800 | 3,895.00 | 73,226,000 | |
| 1332 | ニッスイ | 496,600 | 785.90 | 390,277,940 | 貸付有価証券 19,200株 |
| 1333 | マルハニチロ | 73,700 | 2,896.00 | 213,435,200 | |
| 1375 | 雪国まいたけ | 42,300 | 954.00 | 40,354,200 | |
| 1376 | カネコ種苗 | 15,200 | 1,434.00 | 21,796,800 | |
| 1377 | サカタのタネ | 56,500 | 3,665.00 | 207,072,500 | |
| 1379 | ホクト | 39,800 | 1,775.00 | 70,645,000 | |
| 1384 | ホクリョウ | 3,100 | 1,048.00 | 3,248,800 | 貸付有価証券 200株 |
| 1514 | 住石ホールディングス | 51,000 | 1,780.00 | 90,780,000 | 貸付有価証券 20,900株 |
| 1515 | 日鉄鉱業 | 19,900 | 5,170.00 | 102,883,000 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 1518 | 三井松島ホールディングス | 29,400 | 2,837.00 | 83,407,800 | 貸付有価証券 4,100株 |
| 1605 | I N P E X | 1,836,800 | 1,984.50 | 3,645,129,600 | 貸付有価証券 70,700株 |
| 1662 | 石油資源開発 | 57,500 | 6,020.00 | 346,150,000 | 貸付有価証券 7,900株 |
| 1663 | K&Oエナジーグループ | 22,500 | 2,275.00 | 51,187,500 | 貸付有価証券 2,900株 |
| 1414 | ショーボンドホールディングス | 67,600 | 6,531.00 | 441,495,600 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 1417 | ミライト・ワン | 164,200 | 1,911.50 | 313,868,300 | |
| 1419 | タマホーム | 31,200 | 4,030.00 | 125,736,000 | |
| 1420 | サンヨーホームズ | 2,600 | 760.00 | 1,976,000 | |
| 1429 | 日本アクア | 8,800 | 963.00 | 8,474,400 | |
| 1430 | ファーストコーポレーション | 5,400 | 772.00 | 4,168,800 | |
| 1433 | バステラ | 4,800 | 1,069.00 | 5,131,200 | |
| 1446 | キャンディル | 3,500 | 585.00 | 2,047,500 | 貸付有価証券 400株 |
| 1712 | ダイセキ環境ソリューション | 4,300 | 1,092.00 | 4,695,600 | |
| 1716 | 第一カッター興業 | 12,700 | 1,421.00 | 18,046,700 | |
| 1719 | 安藤・間 | 287,700 | 1,157.00 | 332,868,900 | |
| 1720 | 東急建設 | 155,600 | 819.00 | 127,436,400 | 貸付有価証券 5,500株 |

| | | | | | |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 1721 | コムシスホールディングス | 158,600 | 3,205.00 | 508,313,000 | 貸付有価証券 23,800株 |
| 1726 | ビーアールホールディングス | 72,800 | 369.00 | 26,863,200 | |
| 1762 | 高松コンストラクショングループ | 36,900 | 2,880.00 | 106,272,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 1766 | 東建コーポレーション | 14,300 | 9,350.00 | 133,705,000 | |
| 1768 | ソネック | 2,200 | 945.00 | 2,079,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 1780 | ヤマウラ | 25,200 | 1,660.00 | 41,832,000 | |
| 1786 | オリエンタル白石 | 183,900 | 363.00 | 66,755,700 | |
| 1801 | 大成建設 | 325,100 | 5,294.00 | 1,721,079,400 | 貸付有価証券 43,900株 |
| 1802 | 大林組 | 1,242,400 | 1,341.50 | 1,666,679,600 | 貸付有価証券 32,400株 |
| 1803 | 清水建設 | 985,100 | 987.80 | 973,081,780 | |
| 1805 | 飛島建設 | 35,800 | 1,461.00 | 52,303,800 | |
| 1808 | 長谷工コーポレーション | 318,700 | 1,880.00 | 599,156,000 | |
| 1810 | 松井建設 | 32,400 | 806.00 | 26,114,400 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 1811 | 銭高組 | 1,900 | 4,435.00 | 8,426,500 | 貸付有価証券 600株 |
| 1812 | 鹿島建設 | 770,300 | 2,591.50 | 1,996,232,450 | |
| 1813 | 不動テトラ | 24,000 | 2,349.00 | 56,376,000 | |
| 1814 | 大末建設 | 5,700 | 1,406.00 | 8,014,200 | |
| 1815 | 鉄建建設 | 24,900 | 2,080.00 | 51,792,000 | |
| 1820 | 西松建設 | 66,300 | 3,992.00 | 264,669,600 | |
| 1821 | 三井住友建設 | 258,600 | 403.00 | 104,215,800 | 貸付有価証券 10,800株 |
| 1822 | 大豊建設 | 12,000 | 3,760.00 | 45,120,000 | |
| 1826 | 佐田建設 | 9,400 | 673.00 | 6,326,200 | |
| 1827 | ナカノフドー建設 | 10,500 | 498.00 | 5,229,000 | |
| 1833 | 奥村組 | 56,300 | 4,980.00 | 280,374,000 | |
| 1835 | 東鉄工業 | 43,000 | 2,994.00 | 128,742,000 | |
| 1847 | イチケン | 3,600 | 2,305.00 | 8,298,000 | |
| 1848 | 富士ピー・エス | 6,700 | 454.00 | 3,041,800 | |
| 1852 | 浅沼組 | 25,700 | 4,265.00 | 109,610,500 | |
| 1860 | 戸田建設 | 470,100 | 925.90 | 435,265,590 | |
| 1861 | 熊谷組 | 57,300 | 3,695.00 | 211,723,500 | 貸付有価証券 200株 |
| 1866 | 北野建設 | 2,800 | 3,090.00 | 8,652,000 | |
| 1867 | 植木組 | 4,200 | 1,581.00 | 6,640,200 | |

| | | | | | |
|------|---------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 1870 | 矢作建設工業 | 47,300 | 1,427.00 | 67,497,100 | 貸付有価証券 6,200株 |
| 1871 | ピーエス三菱 | 44,000 | 931.00 | 40,964,000 | |
| 1873 | 日本ハウスホールディングス | 74,200 | 304.00 | 22,556,800 | 貸付有価証券 13,700株 |
| 1879 | 新日本建設 | 48,800 | 1,197.00 | 58,413,600 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 1882 | 東亜道路工業 | 13,800 | 6,940.00 | 95,772,000 | |
| 1884 | 日本道路 | 40,700 | 2,121.00 | 86,324,700 | |
| 1885 | 東亜建設工業 | 26,800 | 3,775.00 | 101,170,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 1887 | 日本国土開発 | 98,800 | 546.00 | 53,944,800 | 貸付有価証券 16,100株 |
| 1888 | 若築建設 | 12,000 | 3,020.00 | 36,240,000 | |
| 1890 | 東洋建設 | 87,500 | 1,295.00 | 113,312,500 | 貸付有価証券 600株 |
| 1893 | 五洋建設 | 492,500 | 796.90 | 392,473,250 | |
| 1898 | 世紀東急工業 | 44,600 | 1,845.00 | 82,287,000 | |
| 1899 | 福田組 | 13,100 | 5,380.00 | 70,478,000 | |
| 1911 | 住友林業 | 300,200 | 4,323.00 | 1,297,764,600 | 貸付有価証券 35,200株 |
| 1914 | 日本基礎技術 | 9,000 | 500.00 | 4,500,000 | 貸付有価証券 4,900株 |
| 1921 | 巴コーポレーション | 18,700 | 548.00 | 10,247,600 | |
| 1925 | 大和ハウス工業 | 960,700 | 4,494.00 | 4,317,385,800 | 貸付有価証券 37,100株 |
| 1926 | ライト工業 | 71,500 | 2,053.00 | 146,789,500 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 1928 | 積水ハウス | 1,053,600 | 3,388.00 | 3,569,596,800 | |
| 1929 | 日特建設 | 33,200 | 1,147.00 | 38,080,400 | 貸付有価証券 500株 |
| 1930 | 北陸電気工事 | 23,800 | 1,192.00 | 28,369,600 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 1934 | ユアテック | 76,500 | 1,124.00 | 85,986,000 | |
| 1938 | 日本リーテック | 27,100 | 1,225.00 | 33,197,500 | |
| 1939 | 四電工 | 14,500 | 3,330.00 | 48,285,000 | |
| 1941 | 中電工 | 53,900 | 2,663.00 | 143,535,700 | |
| 1942 | 関電工 | 217,500 | 1,420.00 | 308,850,000 | 貸付有価証券 19,900株 |
| 1944 | きんでん | 244,600 | 2,409.00 | 589,241,400 | 貸付有価証券 11,000株 |
| 1945 | 東京エネシス | 34,500 | 1,011.00 | 34,879,500 | |
| 1946 | トーエネック | 11,500 | 4,590.00 | 52,785,000 | |

| | | | | | |
|------|-----------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 1949 | 住友電設 | 33,000 | 2,846.00 | 93,918,000 | |
| 1950 | 日本電設工業 | 65,200 | 2,014.00 | 131,312,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 1951 | エクシオグループ | 169,800 | 3,191.00 | 541,831,800 | |
| 1952 | 新日本空調 | 22,500 | 2,472.00 | 55,620,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 1959 | 九電工 | 75,100 | 5,063.00 | 380,231,300 | |
| 1961 | 三機工業 | 75,100 | 1,833.00 | 137,658,300 | |
| 1963 | 日揮ホールディングス | 343,700 | 1,734.50 | 596,147,650 | 貸付有価証券 13,200株 |
| 1964 | 中外炉工業 | 11,400 | 2,608.00 | 29,731,200 | |
| 1967 | ヤマト | 12,400 | 962.00 | 11,928,800 | |
| 1968 | 太平電業 | 21,600 | 4,230.00 | 91,368,000 | |
| 1969 | 高砂熱学工業 | 93,000 | 3,270.00 | 304,110,000 | 貸付有価証券 15,300株 |
| 1972 | 三晃金属工業 | 1,900 | 4,750.00 | 9,025,000 | |
| 1975 | 朝日工業社 | 16,200 | 2,980.00 | 48,276,000 | |
| 1976 | 明星工業 | 67,200 | 1,167.00 | 78,422,400 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 1979 | 大気社 | 40,000 | 4,270.00 | 170,800,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 1980 | ダイダン | 45,700 | 1,626.00 | 74,308,200 | |
| 1982 | 日比谷総合設備 | 25,200 | 2,517.00 | 63,428,400 | |
| 3267 | フィル・カンパニー | 5,400 | 804.00 | 4,341,600 | |
| 5074 | テスホールディングス | 74,800 | 455.00 | 34,034,000 | |
| 5076 | インフロニア・ホールディングス | 400,500 | 1,549.00 | 620,374,500 | |
| 6330 | 東洋エンジニアリング | 51,100 | 774.00 | 39,551,400 | |
| 6379 | レイズネクスト | 50,200 | 1,546.00 | 77,609,200 | |
| 2001 | ニッポン | 104,400 | 2,219.00 | 231,663,600 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 2002 | 日清製粉グループ本社 | 322,500 | 2,070.00 | 667,575,000 | 貸付有価証券 12,500株 |
| 2003 | 日東富士製粉 | 6,200 | 5,060.00 | 31,372,000 | |
| 2004 | 昭和産業 | 33,800 | 3,305.00 | 111,709,000 | |
| 2009 | 鳥越製粉 | 12,400 | 693.00 | 8,593,200 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 2053 | 中部飼料 | 48,300 | 1,115.00 | 53,854,500 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 2060 | フィード・ワン | 51,000 | 833.00 | 42,483,000 | |
| 2107 | 東洋精糖 | 2,800 | 2,250.00 | 6,300,000 | |
| 2108 | 日本甜菜製糖 | 20,300 | 2,156.00 | 43,766,800 | |

| | | | | | |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 2109 | DM三井製糖ホールディングス | 34,600 | 3,170.00 | 109,682,000 | |
| 2112 | 塩水港精糖 | 19,600 | 318.00 | 6,232,800 | |
| 2117 | ウェルネオシュガー | 17,400 | 2,300.00 | 40,020,000 | |
| 2201 | 森永製菓 | 149,300 | 2,744.50 | 409,753,850 | |
| 2204 | 中村屋 | 8,700 | 3,120.00 | 27,144,000 | |
| 2206 | 江崎グリコ | 99,800 | 4,250.00 | 424,150,000 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 2207 | 名糖産業 | 13,700 | 1,721.00 | 23,577,700 | |
| 2209 | 井村屋グループ | 20,800 | 2,409.00 | 50,107,200 | |
| 2211 | 不二家 | 23,900 | 2,511.00 | 60,012,900 | 貸付有価証券 100株 |
| 2212 | 山崎製パン | 233,400 | 3,511.00 | 819,467,400 | 貸付有価証券 9,000株 |
| 2215 | 第一屋製パン | 2,700 | 645.00 | 1,741,500 | |
| 2217 | モロゾフ | 11,300 | 3,815.00 | 43,109,500 | |
| 2220 | 亀田製菓 | 20,000 | 4,170.00 | 83,400,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 2222 | 寿スピリッツ | 164,900 | 1,970.50 | 324,935,450 | |
| 2229 | カルビー | 159,700 | 3,077.00 | 491,396,900 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 2264 | 森永乳業 | 121,800 | 2,925.50 | 356,325,900 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 2266 | 六甲バター | 25,600 | 1,348.00 | 34,508,800 | 貸付有価証券 300株 |
| 2267 | ヤクルト本社 | 498,400 | 3,211.00 | 1,600,362,400 | 貸付有価証券 80,600株 |
| 2269 | 明治ホールディングス | 427,600 | 3,539.00 | 1,513,276,400 | |
| 2270 | 雪印メグミルク | 84,300 | 2,217.00 | 186,893,100 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 2281 | プリマハム | 46,800 | 2,387.00 | 111,711,600 | |
| 2282 | 日本ハム | 150,000 | 4,943.00 | 741,450,000 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 2286 | 林兼産業 | 5,000 | 550.00 | 2,750,000 | |
| 2288 | 丸大食品 | 35,100 | 1,621.00 | 56,897,100 | |
| 2292 | S F o o d s | 38,500 | 3,300.00 | 127,050,000 | |
| 2294 | 柿安本店 | 13,600 | 2,523.00 | 34,312,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 2296 | 伊藤ハム米久ホールディングス | 53,300 | 4,080.00 | 217,464,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 2501 | サッポロホールディングス | 114,800 | 6,859.00 | 787,413,200 | 貸付有価証券 19,700株 |
| 2502 | アサヒグループホールディングス | 805,900 | 5,435.00 | 4,380,066,500 | |
| 2503 | キリンホールディングス | 1,452,800 | 2,087.00 | 3,031,993,600 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|--------------------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| | | | | | 56,000株 |
| 2531 | 宝ホールディングス | 238,100 | 1,235.00 | 294,053,500 | 貸付有価証券 42,500株 |
| 2533 | オエノンホールディングス | 104,300 | 361.00 | 37,652,300 | |
| 2540 | 養命酒製造 | 11,500 | 1,893.00 | 21,769,500 | |
| 2579 | コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ | 273,200 | 1,981.00 | 541,209,200 | |
| 2585 | ライフドリンク カンパニー | 5,200 | 5,570.00 | 28,964,000 | |
| 2587 | サントリー食品インターナショナル | 245,600 | 4,784.00 | 1,174,950,400 | 貸付有価証券 42,900株 |
| 2590 | ダイドーグループホールディングス | 39,500 | 2,921.00 | 115,379,500 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 2593 | 伊藤園 | 118,200 | 4,292.00 | 507,314,400 | |
| 2594 | キーコーヒー | 39,100 | 2,100.00 | 82,110,000 | |
| 2597 | ユニカフェ | 5,000 | 910.00 | 4,550,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 2599 | ジャパンフーズ | 2,300 | 1,257.00 | 2,891,100 | |
| 2602 | 日清オイリオグループ | 49,100 | 4,395.00 | 215,794,500 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 2607 | 不二製油グループ本社 | 81,200 | 2,289.00 | 185,866,800 | 貸付有価証券 10,800株 |
| 2612 | かどや製油 | 1,500 | 3,705.00 | 5,557,500 | |
| 2613 | J-オイルミルズ | 39,900 | 2,017.00 | 80,478,300 | |
| 2801 | キッコーマン | 231,100 | 9,141.00 | 2,112,485,100 | 貸付有価証券 8,900株 |
| 2802 | 味の素 | 828,800 | 5,925.00 | 4,910,640,000 | 貸付有価証券 130,600株 |
| 2804 | ブルドックソース | 18,500 | 2,220.00 | 41,070,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 2809 | キューピー | 187,400 | 2,566.00 | 480,868,400 | 貸付有価証券 7,300株 |
| 2810 | ハウス食品グループ本社 | 120,100 | 3,227.00 | 387,562,700 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 2811 | カゴメ | 150,000 | 3,143.00 | 471,450,000 | 貸付有価証券 18,300株 |
| 2812 | 焼津水産化学工業 | 8,000 | 1,188.00 | 9,504,000 | |
| 2815 | アリアケジャパン | 34,800 | 4,615.00 | 160,602,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 2818 | ピエトロ | 2,000 | 1,805.00 | 3,610,000 | |
| 2819 | エバラ食品工業 | 8,300 | 2,924.00 | 24,269,200 | |
| 2820 | やまみ | 1,300 | 3,805.00 | 4,946,500 | 貸付有価証券 100株 |
| 2871 | ニチレイ | 159,800 | 3,535.00 | 564,893,000 | 貸付有価証券 6,200株 |
| 2875 | 東洋水産 | 176,200 | 7,825.00 | 1,378,765,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|-------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 6,800株 |
| 2882 | イートアンドホールディングス | 16,500 | 2,101.00 | 34,666,500 | |
| 2883 | 大冷 | 2,000 | 1,940.00 | 3,880,000 | |
| 2884 | ヨシムラ・フード・ホールディングス | 15,800 | 1,003.00 | 15,847,400 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 2897 | 日清食品ホールディングス | 367,900 | 4,817.00 | 1,772,174,300 | 貸付有価証券 13,000株 |
| 2899 | 永谷園ホールディングス | 17,100 | 2,201.00 | 37,637,100 | |
| 2904 | 一正蒲鉾 | 6,400 | 733.00 | 4,691,200 | |
| 2908 | フジッコ | 35,800 | 1,963.00 | 70,275,400 | |
| 2910 | ロック・フィールド | 39,000 | 1,608.00 | 62,712,000 | |
| 2914 | 日本たばこ産業 | 2,119,400 | 3,765.00 | 7,979,541,000 | |
| 2915 | ケンコーマヨネーズ | 24,000 | 1,705.00 | 40,920,000 | |
| 2918 | わらべや日洋ホールディングス | 23,300 | 2,836.00 | 66,078,800 | |
| 2922 | なとり | 21,900 | 2,123.00 | 46,493,700 | |
| 2924 | イフジ産業 | 2,800 | 1,338.00 | 3,746,400 | 貸付有価証券 200株 |
| 2929 | ファーマフーズ | 50,100 | 1,012.00 | 50,701,200 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 2931 | ユーグレナ | 217,100 | 683.00 | 148,279,300 | 貸付有価証券 19,000株 |
| 2933 | 紀文食品 | 30,200 | 1,178.00 | 35,575,600 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 2935 | ピククルスホールディングス | 20,400 | 1,228.00 | 25,051,200 | |
| 4404 | ミヨシ油脂 | 5,500 | 1,308.00 | 7,194,000 | |
| 4526 | 理研ビタミン | 30,100 | 2,279.00 | 68,597,900 | |
| 3001 | 片倉工業 | 32,700 | 1,694.00 | 55,393,800 | |
| 3002 | グンゼ | 25,200 | 5,240.00 | 132,048,000 | |
| 3101 | 東洋紡 | 153,300 | 1,090.00 | 167,097,000 | 貸付有価証券 6,000株 |
| 3103 | ユニチカ | 114,700 | 169.00 | 19,384,300 | |
| 3104 | 富士紡ホールディングス | 15,500 | 3,895.00 | 60,372,500 | |
| 3106 | 倉敷紡績 | 26,500 | 3,055.00 | 80,957,500 | |
| 3109 | シキボウ | 16,400 | 1,208.00 | 19,811,200 | 貸付有価証券 600株 |
| 3201 | 日本毛織 | 93,500 | 1,441.00 | 134,733,500 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 3202 | ダイトウボウ | 24,600 | 92.00 | 2,263,200 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 3204 | トーア紡コーポレーション | 6,000 | 423.00 | 2,538,000 | |
| 3205 | ダイドーリミテッド | 21,800 | 479.00 | 10,442,200 | 貸付有価証券 5,700株 |

| | | | | | |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 3302 | 帝国繊維 | 40,000 | 2,192.00 | 87,680,000 | 貸付有価証券 4,900株 |
| 3401 | 帝人 | 340,900 | 1,352.50 | 461,067,250 | |
| 3402 | 東レ | 2,377,200 | 722.30 | 1,717,051,560 | |
| 3501 | 住江織物 | 2,800 | 2,352.00 | 6,585,600 | |
| 3512 | 日本フェルト | 10,800 | 434.00 | 4,687,200 | |
| 3513 | イチカワ | 1,900 | 1,800.00 | 3,420,000 | |
| 3524 | 日東製網 | 1,600 | 1,598.00 | 2,556,800 | |
| 3529 | アツギ | 10,300 | 518.00 | 5,335,400 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 3551 | ダイニック | 4,500 | 707.00 | 3,181,500 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 3569 | セーレン | 68,500 | 2,481.00 | 169,948,500 | |
| 3571 | ソトー | 4,800 | 688.00 | 3,302,400 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 3577 | 東海染工 | 1,400 | 854.00 | 1,195,600 | |
| 3580 | 小松マテール | 51,400 | 806.00 | 41,428,400 | |
| 3591 | ワコールホールディングス | 72,700 | 3,361.00 | 244,344,700 | |
| 3593 | ホギメディカル | 46,800 | 3,535.00 | 165,438,000 | |
| 3607 | クラウディアホールディングス | 3,500 | 424.00 | 1,484,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 3608 | T S Iホールディングス | 115,300 | 680.00 | 78,404,000 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 3611 | マツオカコーポレーション | 4,500 | 1,606.00 | 7,227,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 3612 | ワールド | 50,100 | 1,720.00 | 86,172,000 | |
| 8011 | 三陽商会 | 11,700 | 2,640.00 | 30,888,000 | |
| 8013 | ナイガイ | 5,100 | 270.00 | 1,377,000 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 8016 | オンワードホールディングス | 209,200 | 529.00 | 110,666,800 | 貸付有価証券 800株 |
| 8029 | ルックホールディングス | 8,600 | 2,532.00 | 21,775,200 | |
| 8107 | キムラタン | 96,300 | 18.00 | 1,733,400 | 貸付有価証券 23,300株 |
| 8111 | ゴールドウイン | 62,800 | 9,900.00 | 621,720,000 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 8114 | デサント | 61,100 | 3,580.00 | 218,738,000 | |
| 8118 | キング | 5,700 | 700.00 | 3,990,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 8127 | ヤマトインターナショナル | 11,900 | 304.00 | 3,617,600 | |
| 3708 | 特種東海製紙 | 19,400 | 3,905.00 | 75,757,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 3861 | 王子ホールディングス | 1,478,000 | 572.30 | 845,859,400 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| | | | | | 238,900株 |
| 3863 | 日本製紙 | 200,200 | 1,383.00 | 276,876,600 | 貸付有価証券 7,200株 |
| 3864 | 三菱製紙 | 20,300 | 575.00 | 11,672,500 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 3865 | 北越コーポレーション | 174,400 | 1,357.00 | 236,660,800 | 貸付有価証券 28,800株 |
| 3877 | 中越パルプ工業 | 6,000 | 1,890.00 | 11,340,000 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 3880 | 大王製紙 | 156,700 | 1,124.50 | 176,209,150 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 3896 | 阿波製紙 | 3,700 | 502.00 | 1,857,400 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 3941 | レンゴー | 323,100 | 951.80 | 307,526,580 | |
| 3946 | トーモク | 20,500 | 2,357.00 | 48,318,500 | 貸付有価証券 300株 |
| 3950 | ザ・パック | 26,400 | 3,350.00 | 88,440,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 2930 | 北の達人コーポレーション | 149,500 | 240.00 | 35,880,000 | 貸付有価証券 21,300株 |
| 3405 | クラレ | 517,100 | 1,519.00 | 785,474,900 | |
| 3407 | 旭化成 | 2,400,300 | 1,101.50 | 2,643,930,450 | 貸付有価証券 369,800株 |
| 3553 | 共和レザー | 8,700 | 765.00 | 6,655,500 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 3878 | 巴川コーポレーション | 4,300 | 1,064.00 | 4,575,200 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 4004 | レゾナック・ホールディングス | 342,900 | 2,966.50 | 1,017,212,850 | 貸付有価証券 30,900株 |
| 4005 | 住友化学 | 2,633,000 | 341.40 | 898,906,200 | 貸付有価証券 421,000株 |
| 4008 | 住友精化 | 16,700 | 5,210.00 | 87,007,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 4021 | 日産化学 | 166,700 | 5,905.00 | 984,363,500 | 貸付有価証券 30,800株 |
| 4022 | ラサ工業 | 13,700 | 2,295.00 | 31,441,500 | |
| 4023 | クレハ | 77,600 | 2,863.00 | 222,168,800 | |
| 4025 | 多木化学 | 13,800 | 3,150.00 | 43,470,000 | |
| 4027 | テイカ | 30,700 | 1,387.00 | 42,580,900 | |
| 4028 | 石原産業 | 58,800 | 1,545.00 | 90,846,000 | |
| 4031 | 片倉コープアグリ | 3,500 | 1,118.00 | 3,913,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 4041 | 日本曹達 | 41,900 | 5,750.00 | 240,925,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 4042 | 東ソー | 473,700 | 1,870.00 | 885,819,000 | |
| 4043 | トクヤマ | 114,600 | 2,467.50 | 282,775,500 | |

| | | | | | |
|------|--------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 4044 | セントラル硝子 | 37,900 | 2,717.00 | 102,974,300 | |
| 4045 | 東亜合成 | 177,800 | 1,357.50 | 241,363,500 | |
| 4046 | 大阪ソーダ | 24,800 | 10,240.00 | 253,952,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 4047 | 関東電化工業 | 68,600 | 888.00 | 60,916,800 | 貸付有価証券 10,300株 |
| 4061 | デンカ | 129,000 | 2,554.50 | 329,530,500 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 4063 | 信越化学工業 | 3,217,400 | 5,740.00 | 18,467,876,000 | 貸付有価証券 113,700株 |
| 4064 | 日本カーバイド工業 | 13,100 | 1,521.00 | 19,925,100 | |
| 4078 | 堺化学工業 | 27,000 | 1,882.00 | 50,814,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 4082 | 第一稀元素化学工業 | 38,800 | 983.00 | 38,140,400 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 4088 | エア・ウォーター | 334,800 | 1,926.50 | 644,992,200 | 貸付有価証券 10,300株 |
| 4091 | 日本酸素ホールディングス | 344,200 | 3,707.00 | 1,275,949,400 | 貸付有価証券 53,100株 |
| 4092 | 日本化学工業 | 13,000 | 1,951.00 | 25,363,000 | |
| 4093 | 東邦アセチレン | 20,000 | 372.00 | 7,440,000 | |
| 4095 | 日本パーカライジング | 158,100 | 1,166.00 | 184,344,600 | |
| 4097 | 高圧ガス工業 | 51,500 | 845.00 | 43,517,500 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 4098 | チタン工業 | 2,000 | 1,136.00 | 2,272,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 4099 | 四国化成ホールディングス | 45,400 | 1,966.00 | 89,256,400 | 貸付有価証券 200株 |
| 4100 | 戸田工業 | 8,100 | 1,560.00 | 12,636,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 4109 | ステラ ケミファ | 19,300 | 3,250.00 | 62,725,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 4112 | 保土谷化学工業 | 11,100 | 3,560.00 | 39,516,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 4114 | 日本触媒 | 51,700 | 5,501.00 | 284,401,700 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 4116 | 大日精化工業 | 24,700 | 2,703.00 | 66,764,100 | |
| 4118 | カネカ | 90,100 | 3,579.00 | 322,467,900 | |
| 4182 | 三菱瓦斯化学 | 264,900 | 2,384.50 | 631,654,050 | 貸付有価証券 15,200株 |
| 4183 | 三井化学 | 292,600 | 4,310.00 | 1,261,106,000 | 貸付有価証券 51,500株 |
| 4185 | J S R | 386,500 | 4,050.00 | 1,565,325,000 | |
| 4186 | 東京応化工業 | 169,300 | 3,385.00 | 573,080,500 | |
| 4187 | 大阪有機化学工業 | 29,700 | 2,972.00 | 88,268,400 | 貸付有価証券 4,300株 |

| | | | | | |
|------|---------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 4188 | 三菱ケミカルグループ | 2,593,800 | 887.00 | 2,300,700,600 | 貸付有価証券 241,000株 |
| 4189 | KHネオケム | 54,100 | 2,319.00 | 125,457,900 | 貸付有価証券 7,600株 |
| 4202 | ダイセル | 456,100 | 1,425.50 | 650,170,550 | 貸付有価証券 19,100株 |
| 4203 | 住友ベークライト | 49,700 | 7,360.00 | 365,792,000 | 貸付有価証券 8,300株 |
| 4204 | 積水化学工業 | 712,900 | 2,155.00 | 1,536,299,500 | |
| 4205 | 日本ゼオン | 243,200 | 1,329.00 | 323,212,800 | 貸付有価証券 8,200株 |
| 4206 | アイカ工業 | 89,500 | 3,424.00 | 306,448,000 | |
| 4208 | UBE | 168,800 | 2,414.00 | 407,483,200 | |
| 4212 | 積水樹脂 | 53,000 | 2,540.00 | 134,620,000 | |
| 4215 | タキロンシーアイ | 90,500 | 648.00 | 58,644,000 | |
| 4216 | 旭有機材 | 23,600 | 3,965.00 | 93,574,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 4218 | ニチバン | 19,200 | 1,728.00 | 33,177,600 | 貸付有価証券 400株 |
| 4220 | リケンテクノス | 76,400 | 851.00 | 65,016,400 | |
| 4221 | 大倉工業 | 16,400 | 2,607.00 | 42,754,800 | |
| 4228 | 積水化成成品工業 | 49,800 | 498.00 | 24,800,400 | |
| 4229 | 群栄化学工業 | 8,300 | 3,295.00 | 27,348,500 | |
| 4231 | タイガースポリマー | 6,800 | 905.00 | 6,154,000 | |
| 4238 | ミライアル | 5,200 | 1,512.00 | 7,862,400 | |
| 4245 | ダイキアクシス | 5,900 | 719.00 | 4,242,100 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 4246 | ダイキョーニシカワ | 78,300 | 739.00 | 57,863,700 | |
| 4248 | 竹本容器 | 5,300 | 786.00 | 4,165,800 | |
| 4249 | 森六ホールディングス | 18,400 | 2,785.00 | 51,244,000 | |
| 4251 | 恵和 | 25,500 | 1,395.00 | 35,572,500 | |
| 4272 | 日本化薬 | 271,000 | 1,314.50 | 356,229,500 | 貸付有価証券 10,500株 |
| 4275 | カーリットホールディングス | 38,200 | 949.00 | 36,251,800 | |
| 4362 | 日本精化 | 23,500 | 3,105.00 | 72,967,500 | 貸付有価証券 500株 |
| 4368 | 扶桑化学工業 | 37,600 | 4,200.00 | 157,920,000 | 貸付有価証券 4,300株 |
| 4369 | トリケミカル研究所 | 43,000 | 3,605.00 | 155,015,000 | |
| 4401 | ADEKA | 123,700 | 2,854.50 | 353,101,650 | |
| 4403 | 日油 | 107,100 | 6,603.00 | 707,181,300 | 貸付有価証券 800株 |

| | | | | | |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 4406 | 新日本理化 | 20,800 | 195.00 | 4,056,000 | |
| 4410 | ハリマ化成グループ | 19,300 | 867.00 | 16,733,100 | |
| 4452 | 花王 | 802,300 | 5,850.00 | 4,693,455,000 | |
| 4461 | 第一工業製薬 | 14,200 | 2,009.00 | 28,527,800 | |
| 4462 | 石原ケミカル | 15,900 | 2,110.00 | 33,549,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 4463 | 日華化学 | 6,000 | 899.00 | 5,394,000 | |
| 4465 | ニイタカ | 2,800 | 1,890.00 | 5,292,000 | |
| 4471 | 三洋化成工業 | 21,800 | 4,315.00 | 94,067,000 | |
| 4531 | 有機合成薬品工業 | 11,700 | 284.00 | 3,322,800 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 4611 | 大日本塗料 | 39,400 | 1,069.00 | 42,118,600 | |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス | 1,884,000 | 1,157.00 | 2,179,788,000 | |
| 4613 | 関西ペイント | 347,700 | 2,465.50 | 857,254,350 | |
| 4615 | 神東塗料 | 12,500 | 127.00 | 1,587,500 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 4617 | 中国塗料 | 72,900 | 1,742.00 | 126,991,800 | |
| 4619 | 日本特殊塗料 | 10,700 | 1,297.00 | 13,877,900 | |
| 4620 | 藤倉化成 | 40,900 | 447.00 | 18,282,300 | |
| 4626 | 太陽ホールディングス | 61,800 | 3,115.00 | 192,507,000 | |
| 4631 | D I C | 138,600 | 2,808.00 | 389,188,800 | 貸付有価証券 5,400株 |
| 4633 | サカタインクス | 78,900 | 1,414.00 | 111,564,600 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 4634 | a r t i e n c e | 77,200 | 2,706.00 | 208,903,200 | |
| 4636 | T & K T O K A | 34,000 | 1,407.00 | 47,838,000 | |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス | 659,100 | 9,219.00 | 6,076,242,900 | 貸付有価証券 76,100株 |
| 4911 | 資生堂 | 741,800 | 4,049.00 | 3,003,548,200 | 貸付有価証券 28,600株 |
| 4912 | ライオン | 465,000 | 1,301.50 | 605,197,500 | 貸付有価証券 18,000株 |
| 4914 | 高砂香料工業 | 26,700 | 3,515.00 | 93,850,500 | 貸付有価証券 700株 |
| 4917 | マンダム | 76,700 | 1,270.00 | 97,409,000 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 4919 | ミルボン | 48,300 | 3,505.00 | 169,291,500 | |
| 4921 | ファンケル | 155,400 | 2,359.50 | 366,666,300 | |
| 4922 | コーセー | 72,200 | 9,493.00 | 685,394,600 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 4923 | コタ | 32,700 | 1,595.00 | 52,156,500 | |
| 4926 | シーボン | 2,000 | 1,498.00 | 2,996,000 | |

| | | | | | |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス | 182,100 | 1,534.00 | 279,341,400 | |
| 4928 | ノエビアホールディングス | 31,700 | 5,190.00 | 164,523,000 | |
| 4929 | アジュバンホールディングス | 3,600 | 927.00 | 3,337,200 | |
| 4931 | 新日本製薬 | 20,300 | 1,751.00 | 35,545,300 | |
| 4933 | I - n e | 7,100 | 2,439.00 | 17,316,900 | |
| 4936 | アクシージア | 18,000 | 891.00 | 16,038,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 4951 | エステー | 27,400 | 1,534.00 | 42,031,600 | |
| 4955 | アグロ カネショウ | 14,200 | 1,374.00 | 19,510,800 | |
| 4956 | コニシ | 102,600 | 1,357.00 | 139,228,200 | |
| 4958 | 長谷川香料 | 67,900 | 3,235.00 | 219,656,500 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 4967 | 小林製薬 | 103,400 | 6,804.00 | 703,533,600 | |
| 4968 | 荒川化学工業 | 30,100 | 1,054.00 | 31,725,400 | |
| 4971 | メック | 29,200 | 4,440.00 | 129,648,000 | |
| 4973 | 日本高純度化学 | 8,000 | 2,590.00 | 20,720,000 | |
| 4974 | タカラバイオ | 95,700 | 1,254.00 | 120,007,800 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 4975 | J C U | 39,700 | 3,755.00 | 149,073,500 | |
| 4977 | 新田ゼラチン | 9,900 | 756.00 | 7,484,400 | |
| 4979 | O A Tアグリオ | 10,300 | 1,965.00 | 20,239,500 | |
| 4980 | デクセリアルズ | 89,100 | 4,194.00 | 373,685,400 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 4985 | アース製薬 | 32,300 | 4,440.00 | 143,412,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 4992 | 北興化学工業 | 35,700 | 1,036.00 | 36,985,200 | |
| 4994 | 大成ラミック | 10,300 | 2,972.00 | 30,611,600 | |
| 4996 | クミアイ化学工業 | 141,100 | 848.00 | 119,652,800 | 貸付有価証券 21,700株 |
| 4997 | 日本農薬 | 65,100 | 678.00 | 44,137,800 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 5142 | アキレス | 22,400 | 1,546.00 | 34,630,400 | |
| 5208 | 有沢製作所 | 62,200 | 1,105.00 | 68,731,000 | |
| 6988 | 日東電工 | 228,200 | 11,255.00 | 2,568,391,000 | 貸付有価証券 3,800株 |
| 7874 | レック | 45,500 | 1,034.00 | 47,047,000 | |
| 7888 | 三光合成 | 44,700 | 646.00 | 28,876,200 | |
| 7908 | きもと | 25,100 | 225.00 | 5,647,500 | 貸付有価証券 7,500株 |
| 7917 | 藤森工業 | 28,100 | 4,105.00 | 115,350,500 | |
| 7925 | 前澤化成工業 | 22,900 | 1,572.00 | 35,998,800 | |

| | | | | | |
|------|-----------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 7931 | 未来工業 | 12,700 | 4,325.00 | 54,927,500 | |
| 7940 | ウェーブロックホールディングス | 5,200 | 663.00 | 3,447,600 | |
| 7942 | J S P | 25,000 | 1,916.00 | 47,900,000 | |
| 7947 | エフピコ | 67,200 | 2,851.00 | 191,587,200 | |
| 7958 | 天馬 | 25,800 | 2,242.00 | 57,843,600 | |
| 7970 | 信越ポリマー | 76,600 | 1,650.00 | 126,390,000 | |
| 7971 | 東リ | 43,200 | 331.00 | 14,299,200 | |
| 7988 | ニフコ | 106,200 | 3,804.00 | 403,984,800 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 7995 | バルカー | 29,700 | 4,385.00 | 130,234,500 | |
| 8113 | ユニ・チャーム | 740,100 | 5,069.00 | 3,751,566,900 | 貸付有価証券 28,600株 |
| 9385 | ショーエイコーポレーション | 4,500 | 604.00 | 2,718,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 4151 | 協和キリン | 429,200 | 2,338.50 | 1,003,684,200 | 貸付有価証券 16,600株 |
| 4502 | 武田薬品工業 | 3,144,000 | 4,310.00 | 13,550,640,000 | |
| 4503 | アステラス製薬 | 3,116,200 | 1,688.00 | 5,260,145,600 | 貸付有価証券 129,300株 |
| 4506 | 住友ファーマ | 263,500 | 459.00 | 120,946,500 | 貸付有価証券 4,800株 |
| 4507 | 塩野義製薬 | 447,900 | 7,103.00 | 3,181,433,700 | 貸付有価証券 73,900株 |
| 4512 | わかもと製薬 | 15,900 | 213.00 | 3,386,700 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 4516 | 日本新薬 | 93,100 | 5,251.00 | 488,868,100 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 4519 | 中外製薬 | 1,112,000 | 5,416.00 | 6,022,592,000 | |
| 4521 | 科研製薬 | 60,900 | 3,492.00 | 212,662,800 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 4523 | エーザイ | 432,100 | 6,955.00 | 3,005,255,500 | 貸付有価証券 15,900株 |
| 4527 | ロート製薬 | 344,100 | 3,054.00 | 1,050,881,400 | |
| 4528 | 小野薬品工業 | 753,900 | 2,657.00 | 2,003,112,300 | |
| 4530 | 久光製薬 | 79,000 | 4,211.00 | 332,669,000 | |
| 4534 | 持田製薬 | 40,800 | 3,320.00 | 135,456,000 | |
| 4536 | 参天製薬 | 647,400 | 1,471.50 | 952,649,100 | |
| 4538 | 扶桑薬品工業 | 12,500 | 2,222.00 | 27,775,000 | |
| 4539 | 日本ケミファ | 1,700 | 1,607.00 | 2,731,900 | 貸付有価証券 600株 |
| 4540 | ツムラ | 111,800 | 2,684.50 | 300,127,100 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 4547 | キッセイ薬品工業 | 58,800 | 3,130.00 | 184,044,000 | |

| | | | | | |
|------|------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 4548 | 生化学工業 | 60,200 | 772.00 | 46,474,400 | |
| 4549 | 栄研化学 | 65,200 | 1,768.00 | 115,273,600 | |
| 4551 | 鳥居薬品 | 19,100 | 3,780.00 | 72,198,000 | |
| 4552 | J C R ファーマ | 120,200 | 1,105.00 | 132,821,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 4553 | 東和薬品 | 54,600 | 2,492.00 | 136,063,200 | |
| 4554 | 富士製薬工業 | 26,200 | 1,922.00 | 50,356,400 | |
| 4559 | ゼリア新薬工業 | 49,300 | 2,028.00 | 99,980,400 | |
| 4565 | そーせいグループ | 116,600 | 1,420.00 | 165,572,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 4568 | 第一三共 | 3,094,800 | 4,283.00 | 13,255,028,400 | 貸付有価証券 380,100株 |
| 4569 | 杏林製薬 | 77,000 | 1,779.00 | 136,983,000 | |
| 4574 | 大幸薬品 | 73,300 | 309.00 | 22,649,700 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 4577 | ダイト | 27,300 | 1,947.00 | 53,153,100 | 貸付有価証券 100株 |
| 4578 | 大塚ホールディングス | 738,900 | 5,785.00 | 4,274,536,500 | |
| 4581 | 大正製薬ホールディングス | 78,900 | 8,620.00 | 680,118,000 | |
| 4587 | ペプチドリーム | 172,200 | 1,332.00 | 229,370,400 | 貸付有価証券 29,100株 |
| 4880 | セルソース | 9,800 | 1,238.00 | 12,132,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 4886 | あすか製薬ホールディングス | 36,400 | 1,988.00 | 72,363,200 | |
| 4887 | サワイグループホールディングス | 81,200 | 5,652.00 | 458,942,400 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 3315 | 日本コークス工業 | 360,400 | 125.00 | 45,050,000 | |
| 5011 | ニチレキ | 46,200 | 2,497.00 | 115,361,400 | 貸付有価証券 200株 |
| 5013 | ユシロ化学工業 | 18,400 | 1,823.00 | 33,543,200 | |
| 5015 | ビーピー・カストロール | 5,900 | 867.00 | 5,115,300 | |
| 5017 | 富士石油 | 103,600 | 370.00 | 38,332,000 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 5018 | MORESCO | 5,400 | 1,445.00 | 7,803,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 5019 | 出光興産 | 1,972,800 | 814.50 | 1,606,845,600 | |
| 5020 | ENEOSホールディングス | 5,624,200 | 591.50 | 3,326,714,300 | |
| 5021 | コスモエネルギーホールディングス | 105,300 | 6,088.00 | 641,066,400 | |
| 5101 | 横浜ゴム | 179,700 | 3,459.00 | 621,582,300 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 5105 | TOYO TIRE | 204,100 | 2,416.50 | 493,207,650 | |
| 5108 | ブリヂストン | 1,039,900 | 6,279.00 | 6,529,532,100 | |

| | | | | | |
|------|----------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 5110 | 住友ゴム工業 | 348,400 | 1,659.00 | 577,995,600 | |
| 5121 | 藤倉コンポジット | 23,900 | 1,470.00 | 35,133,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 5122 | オカモト | 16,800 | 5,030.00 | 84,504,000 | |
| 5185 | フコク | 18,700 | 1,440.00 | 26,928,000 | |
| 5186 | ニッタ | 36,100 | 3,725.00 | 134,472,500 | |
| 5191 | 住友理工 | 55,100 | 1,138.00 | 62,703,800 | |
| 5192 | 三ツ星ベルト | 43,200 | 4,815.00 | 208,008,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 5195 | バンドー化学 | 52,700 | 1,737.00 | 91,539,900 | 貸付有価証券 500株 |
| 3110 | 日東紡績 | 45,000 | 4,795.00 | 215,775,000 | 貸付有価証券 8,200株 |
| 5201 | A G C | 316,800 | 5,468.00 | 1,732,262,400 | 貸付有価証券 5,800株 |
| 5202 | 日本板硝子 | 169,500 | 606.00 | 102,717,000 | 貸付有価証券 4,900株 |
| 5204 | 石塚硝子 | 2,600 | 3,240.00 | 8,424,000 | |
| 5210 | 日本山村硝子 | 5,700 | 1,392.00 | 7,934,400 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 5214 | 日本電気硝子 | 145,000 | 3,167.00 | 459,215,000 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 5218 | オハラ | 16,900 | 1,146.00 | 19,367,400 | |
| 5232 | 住友大阪セメント | 59,100 | 3,656.00 | 216,069,600 | 貸付有価証券 10,400株 |
| 5233 | 太平洋セメント | 210,100 | 2,941.50 | 618,009,150 | |
| 5262 | 日本ヒューム | 31,100 | 896.00 | 27,865,600 | |
| 5269 | 日本コンクリート工業 | 68,900 | 457.00 | 31,487,300 | 貸付有価証券 12,200株 |
| 5273 | 三谷セキサン | 14,900 | 5,000.00 | 74,500,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 5288 | アジアパイルホールディングス | 50,500 | 728.00 | 36,764,000 | |
| 5301 | 東海カーボン | 327,800 | 1,027.50 | 336,814,500 | 貸付有価証券 12,700株 |
| 5302 | 日本カーボン | 18,800 | 4,470.00 | 84,036,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 5310 | 東洋炭素 | 25,000 | 5,060.00 | 126,500,000 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 5331 | ノリタケカンパニーリミテド | 19,700 | 7,590.00 | 149,523,000 | |
| 5332 | T O T O | 234,400 | 4,008.00 | 939,475,200 | 貸付有価証券 40,900株 |
| 5333 | 日本碍子 | 413,200 | 1,820.00 | 752,024,000 | 貸付有価証券 16,000株 |
| 5334 | 日本特殊陶業 | 297,500 | 3,863.00 | 1,149,242,500 | |
| 5337 | ダントーホールディングス | 10,000 | 1,249.00 | 12,490,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|---------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 4,800株 |
| 5344 | MARUWA | 13,100 | 28,720.00 | 376,232,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 5351 | 品川リフラクトリーズ | 43,700 | 1,918.00 | 83,816,600 | |
| 5352 | 黒崎播磨 | 7,200 | 11,920.00 | 85,824,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 5357 | ヨータイ | 21,900 | 1,452.00 | 31,798,800 | |
| 5363 | 東京窯業 | 16,200 | 473.00 | 7,662,600 | 貸付有価証券 5,600株 |
| 5367 | ニッカトー | 6,700 | 582.00 | 3,899,400 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 5384 | フジミインコーポレーテッド | 95,500 | 2,980.00 | 284,590,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 5388 | クニミネ工業 | 4,300 | 1,068.00 | 4,592,400 | |
| 5391 | エーアンドエーマテリアル | 2,800 | 1,319.00 | 3,693,200 | |
| 5393 | ニチアス | 89,800 | 3,385.00 | 303,973,000 | |
| 7943 | ニチハ | 44,500 | 2,971.00 | 132,209,500 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 5401 | 日本製鉄 | 1,636,400 | 3,468.00 | 5,675,035,200 | 貸付有価証券 63,100株 |
| 5406 | 神戸製鋼所 | 735,000 | 1,955.00 | 1,436,925,000 | 貸付有価証券 28,400株 |
| 5408 | 中山製鋼所 | 83,600 | 878.00 | 73,400,800 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 5410 | 合同製鐵 | 20,400 | 4,965.00 | 101,286,000 | |
| 5411 | J F Eホールディングス | 1,016,400 | 2,286.00 | 2,323,490,400 | |
| 5423 | 東京製鐵 | 102,700 | 1,759.00 | 180,649,300 | 貸付有価証券 25,400株 |
| 5440 | 共英製鋼 | 41,600 | 2,068.00 | 86,028,800 | 貸付有価証券 4,900株 |
| 5444 | 大和工業 | 68,900 | 8,001.00 | 551,268,900 | |
| 5445 | 東京鐵鋼 | 16,100 | 4,435.00 | 71,403,500 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 5449 | 大阪製鐵 | 16,800 | 2,298.00 | 38,606,400 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 5451 | 淀川製鋼所 | 41,500 | 3,880.00 | 161,020,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 5461 | 中部鋼板 | 24,000 | 2,427.00 | 58,248,000 | |
| 5463 | 丸一鋼管 | 111,300 | 3,787.00 | 421,493,100 | |
| 5464 | モリ工業 | 6,500 | 4,655.00 | 30,257,500 | |
| 5471 | 大同特殊鋼 | 230,200 | 1,492.50 | 343,573,500 | 貸付有価証券 38,800株 |
| 5476 | 日本高周波鋼業 | 5,900 | 604.00 | 3,563,600 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 5480 | 日本冶金工業 | 26,700 | 4,635.00 | 123,754,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 3,600株 |
| 5481 | 山陽特殊製鋼 | 36,100 | 2,516.00 | 90,827,600 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 5482 | 愛知製鋼 | 21,100 | 3,375.00 | 71,212,500 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 5491 | 日本金属 | 4,000 | 881.00 | 3,524,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 5541 | 大太平洋金属 | 31,100 | 1,458.00 | 45,343,800 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 5563 | 新日本電工 | 181,800 | 287.00 | 52,176,600 | |
| 5602 | 栗本鐵工所 | 17,000 | 3,510.00 | 59,670,000 | |
| 5603 | 虹技 | 1,900 | 1,220.00 | 2,318,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 5612 | 日本鑄鉄管 | 1,700 | 1,127.00 | 1,915,900 | |
| 5632 | 三菱製鋼 | 27,100 | 1,577.00 | 42,736,700 | |
| 5658 | 日亜鋼業 | 15,700 | 334.00 | 5,243,800 | |
| 5659 | 日本精線 | 5,800 | 5,130.00 | 29,754,000 | |
| 5698 | エンビプロ・ホールディングス | 19,600 | 620.00 | 12,152,000 | |
| 6319 | シンニッタン | 19,600 | 265.00 | 5,194,000 | 貸付有価証券 6,800株 |
| 7305 | 新家工業 | 3,400 | 2,999.00 | 10,196,600 | |
| 5702 | 大紀アルミニウム工業所 | 46,200 | 1,239.00 | 57,241,800 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 5703 | 日本軽金属ホールディングス | 106,800 | 1,816.00 | 193,948,800 | |
| 5706 | 三井金属鉱業 | 106,400 | 4,607.00 | 490,184,800 | |
| 5707 | 東邦亜鉛 | 23,400 | 1,150.00 | 26,910,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 5711 | 三菱マテリアル | 261,300 | 2,671.00 | 697,932,300 | 貸付有価証券 29,000株 |
| 5713 | 住友金属鉱山 | 423,700 | 4,101.00 | 1,737,593,700 | |
| 5714 | DOWAホールディングス | 90,300 | 5,235.00 | 472,720,500 | 貸付有価証券 7,200株 |
| 5715 | 古河機械金属 | 48,200 | 1,878.00 | 90,519,600 | |
| 5721 | エス・サイエンス | 75,500 | 22.00 | 1,661,000 | 貸付有価証券 19,300株 |
| 5726 | 大阪チタニウムテクノロジーズ | 63,400 | 2,717.00 | 172,257,800 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 5727 | 東邦チタニウム | 75,500 | 1,907.00 | 143,978,500 | 貸付有価証券 14,900株 |
| 5741 | UACJ | 51,200 | 4,105.00 | 210,176,000 | |
| 5757 | CKサンエツ | 8,800 | 3,865.00 | 34,012,000 | |
| 5801 | 古河電気工業 | 121,700 | 2,595.50 | 315,872,350 | 貸付有価証券 18,200株 |
| 5802 | 住友電気工業 | 1,367,100 | 1,908.00 | 2,608,426,800 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 3,100株 |
| 5803 | フジクラ | 431,100 | 1,165.00 | 502,231,500 | 貸付有価証券 15,100株 |
| 5805 | SWCC | 40,800 | 2,942.00 | 120,033,600 | |
| 5809 | タツタ電線 | 65,100 | 695.00 | 45,244,500 | 貸付有価証券 8,700株 |
| 5819 | カナレ電気 | 2,500 | 1,778.00 | 4,445,000 | |
| 5821 | 平河ヒューテック | 23,300 | 1,397.00 | 32,550,100 | |
| 5851 | リョービ | 38,900 | 2,645.00 | 102,890,500 | 貸付有価証券 5,400株 |
| 5852 | アーレスティ | 17,100 | 721.00 | 12,329,100 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 5857 | AREホールディングス | 137,300 | 2,008.00 | 275,698,400 | |
| 3421 | 稲葉製作所 | 18,000 | 1,521.00 | 27,378,000 | |
| 3431 | 宮地エンジニアリンググループ | 18,300 | 3,450.00 | 63,135,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 3433 | トーカロ | 105,400 | 1,537.00 | 161,999,800 | |
| 3434 | アルファCo | 5,700 | 1,475.00 | 8,407,500 | |
| 3436 | SUMCO | 649,400 | 2,272.50 | 1,475,761,500 | 貸付有価証券 77,500株 |
| 3443 | 川田テクノロジーズ | 8,600 | 7,050.00 | 60,630,000 | |
| 3445 | RS Technologies | 24,400 | 2,991.00 | 72,980,400 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 3446 | ジェイテックコーポレーション | 2,000 | 2,192.00 | 4,384,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 3447 | 信和 | 9,900 | 754.00 | 7,464,600 | |
| 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 217,800 | 2,312.00 | 503,553,600 | |
| 5902 | ホッカンホールディングス | 17,800 | 1,771.00 | 31,523,800 | |
| 5909 | コロナ | 20,400 | 959.00 | 19,563,600 | |
| 5911 | 横河ブリッジホールディングス | 57,200 | 2,768.00 | 158,329,600 | |
| 5915 | 駒井ハルテック | 2,700 | 2,095.00 | 5,656,500 | 貸付有価証券 800株 |
| 5923 | 高田機工 | 1,200 | 3,595.00 | 4,314,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 5929 | 三和ホールディングス | 367,200 | 2,290.00 | 840,888,000 | 貸付有価証券 49,100株 |
| 5930 | 文化シャッター | 95,600 | 1,450.00 | 138,620,000 | 貸付有価証券 4,100株 |
| 5932 | 三協立山 | 41,800 | 886.00 | 37,034,800 | |
| 5933 | アルインコ | 27,900 | 1,043.00 | 29,099,700 | |
| 5936 | 東洋シャッター | 3,500 | 719.00 | 2,516,500 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 5938 | LIXIL | 570,700 | 1,971.00 | 1,124,849,700 | |

| | | | | | |
|------|-------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 5942 | 日本ファイルコン | 10,100 | 562.00 | 5,676,200 | |
| 5943 | ノーリツ | 60,600 | 1,541.00 | 93,384,600 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 5946 | 長府製作所 | 36,300 | 2,058.00 | 74,705,400 | |
| 5947 | リンナイ | 178,800 | 3,363.00 | 601,304,400 | 貸付有価証券 25,500株 |
| 5951 | ダイニチ工業 | 7,700 | 701.00 | 5,397,700 | |
| 5957 | 日東精工 | 53,000 | 542.00 | 28,726,000 | |
| 5958 | 三洋工業 | 1,800 | 2,870.00 | 5,166,000 | |
| 5959 | 岡部 | 65,300 | 794.00 | 51,848,200 | |
| 5970 | ジーテクト | 46,600 | 1,815.00 | 84,579,000 | |
| 5975 | 東プレ | 64,400 | 2,107.00 | 135,690,800 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 5976 | 高周波熱錬 | 56,400 | 1,044.00 | 58,881,600 | 貸付有価証券 200株 |
| 5981 | 東京製綱 | 23,700 | 1,347.00 | 31,923,900 | |
| 5985 | サンコール | 28,400 | 476.00 | 13,518,400 | |
| 5986 | モリテック スチール | 13,100 | 289.00 | 3,785,900 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 5988 | パイオラックス | 45,400 | 2,497.00 | 113,363,800 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 5989 | エイチワン | 37,600 | 821.00 | 30,869,600 | |
| 5991 | 日本発條 | 323,300 | 1,206.00 | 389,899,800 | 貸付有価証券 12,500株 |
| 5992 | 中央発條 | 27,100 | 711.00 | 19,268,100 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 5998 | アドバネクス | 2,000 | 943.00 | 1,886,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 7989 | 立川ブラインド工業 | 16,500 | 1,431.00 | 23,611,500 | |
| 8155 | 三益半導体工業 | 28,200 | 3,285.00 | 92,637,000 | |
| 1909 | 日本ドライケミカル | 3,500 | 2,761.00 | 9,663,500 | |
| 5631 | 日本製鋼所 | 98,500 | 2,457.00 | 242,014,500 | |
| 6005 | 三浦工業 | 149,400 | 2,739.50 | 409,281,300 | |
| 6013 | タクマ | 120,900 | 1,720.00 | 207,948,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 6101 | ツガミ | 79,500 | 1,178.00 | 93,651,000 | 貸付有価証券 9,100株 |
| 6103 | オークマ | 31,300 | 6,553.00 | 205,108,900 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 6104 | 芝浦機械 | 35,700 | 3,580.00 | 127,806,000 | |
| 6113 | アマダ | 570,800 | 1,567.00 | 894,443,600 | 貸付有価証券 56,100株 |
| 6118 | アイダエンジニアリング | 82,800 | 840.00 | 69,552,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|--------------|---------|-----------|---------------|------------------|
| | | | | | 1,400株 |
| 6134 | F U J I | 168,500 | 2,486.50 | 418,975,250 | |
| 6135 | 牧野フライス製作所 | 39,600 | 5,950.00 | 235,620,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 6136 | オーエスジー | 157,700 | 2,040.00 | 321,708,000 | |
| 6138 | ダイジェット工業 | 1,500 | 837.00 | 1,255,500 | |
| 6140 | 旭ダイヤモンド工業 | 82,500 | 874.00 | 72,105,000 | |
| 6141 | DMG森精機 | 216,900 | 2,905.00 | 630,094,500 | 貸付有価証券 8,400株 |
| 6143 | ソディック | 87,100 | 720.00 | 62,712,000 | |
| 6146 | ディスコ | 172,200 | 39,600.00 | 6,819,120,000 | 貸付有価証券 6,600株 |
| 6151 | 日東工器 | 17,300 | 1,904.00 | 32,939,200 | |
| 6157 | 日進工具 | 33,200 | 1,033.00 | 34,295,600 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 6165 | パンチ工業 | 14,600 | 422.00 | 6,161,200 | |
| 6167 | 富士ダイス | 18,500 | 698.00 | 12,913,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 6203 | 豊和工業 | 8,300 | 763.00 | 6,332,900 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6208 | 石川製作所 | 3,900 | 1,137.00 | 4,434,300 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6209 | リケンNPR | 38,800 | 2,645.00 | 102,626,000 | 貸付有価証券 5,600株 |
| 6210 | 東洋機械金属 | 11,000 | 688.00 | 7,568,000 | |
| 6217 | 津田駒工業 | 2,700 | 408.00 | 1,101,600 | 貸付有価証券 800株 |
| 6218 | エンシュウ | 3,600 | 691.00 | 2,487,600 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6222 | 島精機製作所 | 56,900 | 1,508.00 | 85,805,200 | |
| 6235 | オプトラン | 58,800 | 1,743.00 | 102,488,400 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 6236 | NCホールディングス | 3,600 | 1,613.00 | 5,806,800 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 6237 | イワキポンプ | 23,800 | 2,143.00 | 51,003,400 | |
| 6238 | フリー | 33,700 | 1,324.00 | 44,618,800 | |
| 6240 | ヤマシンフィルタ | 85,900 | 342.00 | 29,377,800 | 貸付有価証券 9,400株 |
| 6247 | 日阪製作所 | 39,000 | 975.00 | 38,025,000 | |
| 6250 | やまびこ | 58,400 | 1,563.00 | 91,279,200 | |
| 6254 | 野村マイクロ・サイエンス | 12,100 | 14,090.00 | 170,489,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6258 | 平田機工 | 17,100 | 6,780.00 | 115,938,000 | 貸付有価証券 2,100株 |

| | | | | | |
|------|----------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 6262 | PEGASUS | 39,500 | 446.00 | 17,617,000 | |
| 6264 | マルマエ | 15,600 | 1,873.00 | 29,218,800 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 6266 | タツモ | 21,600 | 3,230.00 | 69,768,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 6268 | ナブテスコ | 224,500 | 2,872.50 | 644,876,250 | 貸付有価証券 8,700株 |
| 6269 | 三井海洋開発 | 45,300 | 2,315.00 | 104,869,500 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 6272 | レオン自動機 | 41,400 | 1,524.00 | 63,093,600 | |
| 6273 | SMC | 107,100 | 82,120.00 | 8,795,052,000 | 貸付有価証券 18,300株 |
| 6277 | ホソカワミクロン | 22,900 | 4,655.00 | 106,599,500 | |
| 6278 | ユニオンツール | 15,700 | 3,405.00 | 53,458,500 | |
| 6279 | 瑞光 | 25,800 | 1,727.00 | 44,556,600 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 6282 | オイレス工業 | 48,500 | 2,098.00 | 101,753,000 | |
| 6284 | 日精エー・エス・ビー機械 | 14,200 | 4,320.00 | 61,344,000 | |
| 6287 | サトーホールディングス | 50,900 | 2,154.00 | 109,638,600 | |
| 6289 | 技研製作所 | 33,600 | 2,137.00 | 71,803,200 | |
| 6291 | 日本エアージェット | 16,700 | 1,257.00 | 20,991,900 | |
| 6292 | カワタ | 4,700 | 1,128.00 | 5,301,600 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 6293 | 日精樹脂工業 | 26,600 | 1,140.00 | 30,324,000 | |
| 6294 | オカダアイヨン | 5,100 | 2,643.00 | 13,479,300 | |
| 6298 | ワイエイシイホールディングス | 11,800 | 2,464.00 | 29,075,200 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 6301 | 小松製作所 | 1,676,900 | 3,904.00 | 6,546,617,600 | 貸付有価証券 216,900株 |
| 6302 | 住友重機械工業 | 211,600 | 3,720.00 | 787,152,000 | |
| 6305 | 日立建機 | 142,500 | 4,097.00 | 583,822,500 | 貸付有価証券 23,300株 |
| 6306 | 日工 | 53,000 | 757.00 | 40,121,000 | |
| 6309 | 巴工業 | 14,000 | 3,670.00 | 51,380,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 6310 | 井関農機 | 33,500 | 1,142.00 | 38,257,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 6315 | TOWA | 39,800 | 7,650.00 | 304,470,000 | |
| 6316 | 丸山製作所 | 2,600 | 2,588.00 | 6,728,800 | |
| 6317 | 北川鉄工所 | 14,100 | 1,534.00 | 21,629,400 | |
| 6323 | ローツェ | 18,700 | 16,280.00 | 304,436,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 6325 | タカキタ | 5,000 | 483.00 | 2,415,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|--------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| | | | | | 1,600株 |
| 6326 | クボタ | 1,875,800 | 2,210.00 | 4,145,518,000 | 貸付有価証券 73,000株 |
| 6328 | 荏原実業 | 18,800 | 2,985.00 | 56,118,000 | |
| 6331 | 三菱化工機 | 12,600 | 3,455.00 | 43,533,000 | |
| 6332 | 月島ホールディングス | 48,300 | 1,345.00 | 64,963,500 | 貸付有価証券 500株 |
| 6333 | 帝国電機製作所 | 25,200 | 3,005.00 | 75,726,000 | |
| 6335 | 東京機械製作所 | 4,000 | 472.00 | 1,888,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6339 | 新東工業 | 72,300 | 1,094.00 | 79,096,200 | |
| 6340 | 澁谷工業 | 33,600 | 2,489.00 | 83,630,400 | |
| 6345 | アイチ コーポレーション | 49,800 | 1,091.00 | 54,331,800 | |
| 6349 | 小森コーポレーション | 88,100 | 1,335.00 | 117,613,500 | |
| 6351 | 鶴見製作所 | 27,300 | 3,620.00 | 98,826,000 | |
| 6356 | 日本ギア工業 | 5,800 | 510.00 | 2,958,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 6358 | 酒井重工業 | 4,900 | 6,900.00 | 33,810,000 | |
| 6361 | 荏原製作所 | 146,800 | 9,197.00 | 1,350,119,600 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 6362 | 石井鐵工所 | 1,700 | 2,688.00 | 4,569,600 | 貸付有価証券 300株 |
| 6363 | 西島製作所 | 30,800 | 2,436.00 | 75,028,800 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 6364 | 北越工業 | 36,000 | 2,637.00 | 94,932,000 | |
| 6367 | ダイキン工業 | 427,100 | 23,915.00 | 10,214,096,500 | 貸付有価証券 73,100株 |
| 6368 | オルガノ | 43,000 | 6,110.00 | 262,730,000 | |
| 6369 | トーヨーカネツ | 12,100 | 4,230.00 | 51,183,000 | |
| 6370 | 栗田工業 | 200,100 | 5,471.00 | 1,094,747,100 | |
| 6371 | 椿本チエイン | 50,700 | 4,180.00 | 211,926,000 | |
| 6373 | 大同工業 | 6,700 | 748.00 | 5,011,600 | |
| 6378 | 木村化工機 | 27,300 | 725.00 | 19,792,500 | |
| 6381 | アネスト岩田 | 55,300 | 1,287.00 | 71,171,100 | |
| 6383 | ダイフク | 603,700 | 2,903.00 | 1,752,541,100 | 貸付有価証券 89,500株 |
| 6387 | サムコ | 9,600 | 4,580.00 | 43,968,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 6390 | 加藤製作所 | 7,700 | 1,420.00 | 10,934,000 | |
| 6393 | 油研工業 | 2,500 | 2,251.00 | 5,627,500 | 貸付有価証券 100株 |
| 6395 | タダノ | 205,800 | 1,175.00 | 241,815,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|-----------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| | | | | | 300 株 |
| 6406 | フジテック | 83,600 | 3,712.00 | 310,323,200 | |
| 6407 | CKD | 98,900 | 2,626.00 | 259,711,400 | 貸付有価証券 16,200 株 |
| 6412 | 平和 | 105,800 | 2,173.00 | 229,903,400 | 貸付有価証券 3,600 株 |
| 6413 | 理想科学工業 | 28,600 | 2,775.00 | 79,365,000 | |
| 6417 | SANKYO | 82,300 | 8,779.00 | 722,511,700 | 貸付有価証券 4,300 株 |
| 6418 | 日本金銭機械 | 43,200 | 1,512.00 | 65,318,400 | 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 | 18,100 | 2,685.00 | 48,598,500 | 貸付有価証券 3,500 株 |
| 6420 | フクシマガリレイ | 23,400 | 5,130.00 | 120,042,000 | |
| 6428 | オーイズミ | 5,700 | 453.00 | 2,582,100 | 貸付有価証券 1,900 株 |
| 6430 | ダイコク電機 | 17,600 | 3,625.00 | 63,800,000 | 貸付有価証券 2,100 株 |
| 6432 | 竹内製作所 | 64,900 | 4,705.00 | 305,354,500 | |
| 6436 | アマノ | 101,500 | 3,369.00 | 341,953,500 | |
| 6440 | JUKI | 55,400 | 445.00 | 24,653,000 | |
| 6444 | サンデン | 22,700 | 194.00 | 4,403,800 | 貸付有価証券 7,600 株 |
| 6445 | ジャノメ | 36,200 | 693.00 | 25,086,600 | |
| 6454 | マックス | 50,400 | 3,255.00 | 164,052,000 | |
| 6457 | グローリー | 85,900 | 3,027.00 | 260,019,300 | 貸付有価証券 3,400 株 |
| 6458 | 新晃工業 | 36,000 | 3,000.00 | 108,000,000 | 貸付有価証券 1,400 株 |
| 6459 | 大和冷機工業 | 54,800 | 1,580.00 | 86,584,000 | |
| 6460 | セガサミーホールディングス | 319,500 | 2,138.50 | 683,250,750 | |
| 6463 | T P R | 45,400 | 1,970.00 | 89,438,000 | |
| 6464 | ツバキ・ナカシマ | 71,600 | 748.00 | 53,556,800 | 貸付有価証券 9,000 株 |
| 6465 | ホシザキ | 211,100 | 5,304.00 | 1,119,674,400 | |
| 6470 | 大豊工業 | 30,900 | 827.00 | 25,554,300 | |
| 6471 | 日本精工 | 662,300 | 795.90 | 527,124,570 | |
| 6472 | N T N | 775,800 | 266.00 | 206,362,800 | |
| 6473 | ジェイテクト | 318,300 | 1,306.50 | 415,858,950 | 貸付有価証券 23,700 株 |
| 6474 | 不二越 | 26,400 | 3,455.00 | 91,212,000 | 貸付有価証券 1,100 株 |
| 6480 | 日本トムソン | 97,400 | 586.00 | 57,076,400 | |

| | | | | | |
|------|--------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 6481 | THK | 206,400 | 2,874.00 | 593,193,600 | 貸付有価証券 25,800株 |
| 6482 | ユーシン精機 | 28,300 | 670.00 | 18,961,000 | |
| 6485 | 前澤給装工業 | 27,400 | 1,298.00 | 35,565,200 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6486 | イーグル工業 | 39,500 | 1,680.00 | 66,360,000 | |
| 6489 | 前澤工業 | 8,700 | 1,077.00 | 9,369,900 | |
| 6490 | 日本ピラー工業 | 33,200 | 4,885.00 | 162,182,000 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 6498 | キッツ | 119,700 | 1,197.00 | 143,280,900 | |
| 6586 | マキタ | 408,000 | 3,938.00 | 1,606,704,000 | |
| 7003 | 三井E&S | 177,500 | 723.00 | 128,332,500 | 貸付有価証券 16,000株 |
| 7004 | 日立造船 | 315,700 | 921.00 | 290,759,700 | 貸付有価証券 11,300株 |
| 7011 | 三菱重工業 | 625,600 | 9,405.00 | 5,883,768,000 | |
| 7013 | IHI | 266,400 | 2,800.50 | 746,053,200 | 貸付有価証券 40,700株 |
| 7022 | サノヤスホールディングス | 19,500 | 140.00 | 2,730,000 | |
| 7718 | スター精密 | 66,600 | 1,775.00 | 118,215,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 3105 | 日清紡ホールディングス | 268,900 | 1,189.50 | 319,856,550 | |
| 4062 | イビデン | 186,600 | 7,465.00 | 1,392,969,000 | 貸付有価証券 31,900株 |
| 4902 | コニカミノルタ | 799,000 | 412.90 | 329,907,100 | 貸付有価証券 30,800株 |
| 6448 | ブラザー工業 | 478,000 | 2,474.00 | 1,182,572,000 | 貸付有価証券 54,200株 |
| 6479 | ミネベアミツミ | 622,300 | 3,006.00 | 1,870,633,800 | 貸付有価証券 54,400株 |
| 6501 | 日立製作所 | 1,719,400 | 11,170.00 | 19,205,698,000 | 貸付有価証券 13,300株 |
| 6503 | 三菱電機 | 3,981,800 | 2,152.50 | 8,570,824,500 | |
| 6504 | 富士電機 | 217,500 | 7,279.00 | 1,583,182,500 | 貸付有価証券 26,800株 |
| 6505 | 東洋電機製造 | 5,000 | 1,094.00 | 5,470,000 | |
| 6506 | 安川電機 | 388,600 | 5,784.00 | 2,247,662,400 | 貸付有価証券 16,400株 |
| 6507 | シンフォニアテクノロジー | 39,500 | 2,273.00 | 89,783,500 | |
| 6508 | 明電舎 | 66,300 | 2,608.00 | 172,910,400 | |
| 6513 | オリジン | 3,400 | 1,223.00 | 4,158,200 | |
| 6516 | 山洋電気 | 15,500 | 6,440.00 | 99,820,000 | |
| 6517 | デンヨー | 27,300 | 2,269.00 | 61,943,700 | 貸付有価証券 1,200株 |

| | | | | | |
|------|----------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 6523 | PHCホールディングス | 66,800 | 1,533.00 | 102,404,400 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 6525 | KOKUSAI ELECTRIC | 138,100 | 3,785.00 | 522,708,500 | |
| 6526 | ソシオネクスト | 259,500 | 3,294.00 | 854,793,000 | 貸付有価証券 9,500株 |
| 6588 | 東芝テック | 45,800 | 3,025.00 | 138,545,000 | |
| 6590 | 芝浦メカトロニクス | 20,400 | 7,140.00 | 145,656,000 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 6592 | マブチモーター | 175,900 | 2,493.50 | 438,606,650 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 6594 | ニデック | 789,800 | 5,628.00 | 4,444,994,400 | |
| 6615 | ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 22,500 | 355.00 | 7,987,500 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 6616 | トレックス・セミコンダクター | 18,400 | 1,820.00 | 33,488,000 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 6617 | 東光高岳 | 21,600 | 2,154.00 | 46,526,400 | |
| 6619 | ダブル・スコープ | 102,400 | 804.00 | 82,329,600 | 貸付有価証券 6,000株 |
| 6622 | ダイヘン | 35,900 | 6,800.00 | 244,120,000 | |
| 6630 | ヤーマン | 61,800 | 1,003.00 | 61,985,400 | 貸付有価証券 6,400株 |
| 6632 | JVCケンウッド | 282,400 | 718.00 | 202,763,200 | |
| 6638 | ミマキエンジニアリング | 34,000 | 910.00 | 30,940,000 | |
| 6640 | I-PEX | 24,800 | 1,763.00 | 43,722,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6644 | 大崎電気工業 | 78,300 | 649.00 | 50,816,700 | |
| 6645 | オムロン | 273,200 | 6,763.00 | 1,847,651,600 | 貸付有価証券 41,500株 |
| 6651 | 日東工業 | 48,200 | 3,915.00 | 188,703,000 | |
| 6652 | IDEC | 52,800 | 2,994.00 | 158,083,200 | |
| 6653 | 正興電機製作所 | 5,200 | 1,074.00 | 5,584,800 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 6654 | 不二電機工業 | 3,000 | 1,187.00 | 3,561,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 6674 | ジーエス・ユアサコーポレーション | 139,600 | 2,090.00 | 291,764,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 6675 | サクサホールディングス | 3,500 | 2,671.00 | 9,348,500 | |
| 6676 | メルコホールディングス | 11,200 | 3,300.00 | 36,960,000 | |
| 6678 | テクノメディカ | 8,700 | 1,971.00 | 17,147,700 | |
| 6699 | ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 13,300 | 702.00 | 9,336,600 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 6701 | 日本電気 | 469,800 | 9,262.00 | 4,351,287,600 | |
| 6702 | 富士通 | 329,200 | 20,625.00 | 6,789,750,000 | |

| | | | | | |
|------|-----------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 6703 | 沖電気工業 | 161,700 | 1,018.00 | 164,610,600 | |
| 6704 | 岩崎通信機 | 6,900 | 750.00 | 5,175,000 | |
| 6706 | 電気興業 | 16,000 | 2,320.00 | 37,120,000 | |
| 6707 | サンケン電気 | 33,200 | 6,976.00 | 231,603,200 | |
| 6715 | ナカヨ | 2,400 | 1,170.00 | 2,808,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 6718 | アイホン | 19,300 | 2,973.00 | 57,378,900 | 貸付有価証券 400株 |
| 6723 | ルネサスエレクトロニクス | 2,334,700 | 2,481.00 | 5,792,390,700 | 貸付有価証券 210,900株 |
| 6724 | セイコーエプソン | 459,000 | 2,191.50 | 1,005,898,500 | 貸付有価証券 17,700株 |
| 6727 | ワコム | 272,100 | 668.00 | 181,762,800 | 貸付有価証券 10,500株 |
| 6728 | アルバック | 85,000 | 7,247.00 | 615,995,000 | 貸付有価証券 12,100株 |
| 6730 | アクセル | 12,500 | 2,226.00 | 27,825,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6737 | E I Z O | 26,200 | 5,140.00 | 134,668,000 | |
| 6740 | ジャパンディスプレイ | 1,542,000 | 21.00 | 32,382,000 | 貸付有価証券 126,800株 |
| 6741 | 日本信号 | 81,500 | 940.00 | 76,610,000 | |
| 6742 | 京三製作所 | 74,900 | 461.00 | 34,528,900 | |
| 6744 | 能美防災 | 48,300 | 2,245.00 | 108,433,500 | |
| 6745 | ホーチキ | 26,700 | 1,954.00 | 52,171,800 | |
| 6748 | 星和電機 | 6,300 | 481.00 | 3,030,300 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 6750 | エレコム | 85,500 | 1,729.00 | 147,829,500 | |
| 6752 | パナソニック ホールディングス | 4,226,200 | 1,395.00 | 5,895,549,000 | |
| 6753 | シャープ | 603,100 | 1,034.00 | 623,605,400 | 貸付有価証券 50,900株 |
| 6754 | アンリツ | 252,000 | 1,349.00 | 339,948,000 | |
| 6755 | 富士通ゼネラル | 101,400 | 2,193.50 | 222,420,900 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 6758 | ソニーグループ | 2,505,600 | 14,005.00 | 35,090,928,000 | 貸付有価証券 33,700株 |
| 6762 | T D K | 566,500 | 7,251.00 | 4,107,691,500 | 貸付有価証券 21,900株 |
| 6763 | 帝国通信工業 | 15,700 | 2,030.00 | 31,871,000 | |
| 6768 | タムラ製作所 | 142,500 | 540.00 | 76,950,000 | 貸付有価証券 14,900株 |
| 6770 | アルプスアルパイン | 319,500 | 1,273.00 | 406,723,500 | 貸付有価証券 12,400株 |
| 6771 | 池上通信機 | 4,800 | 950.00 | 4,560,000 | |

| | | | | | |
|------|----------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 6779 | 日本電波工業 | 42,900 | 1,261.00 | 54,096,900 | |
| 6785 | 鈴木 | 19,100 | 1,169.00 | 22,327,900 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 6787 | メイコー | 35,500 | 4,125.00 | 146,437,500 | |
| 6788 | 日本トリム | 8,000 | 3,130.00 | 25,040,000 | |
| 6789 | ローランド ディー. ジー. | 19,600 | 3,795.00 | 74,382,000 | |
| 6794 | フォスター電機 | 26,500 | 1,089.00 | 28,858,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 6798 | SMK | 9,500 | 2,508.00 | 23,826,000 | |
| 6800 | ヨコオ | 31,600 | 1,474.00 | 46,578,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6803 | ティアック | 25,000 | 97.00 | 2,425,000 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 6804 | ホシデン | 81,300 | 1,769.00 | 143,819,700 | |
| 6806 | ヒロセ電機 | 52,800 | 17,500.00 | 924,000,000 | 貸付有価証券 9,100株 |
| 6807 | 日本航空電子工業 | 85,600 | 3,040.00 | 260,224,000 | 貸付有価証券 10,100株 |
| 6809 | TOA | 40,700 | 1,109.00 | 45,136,300 | 貸付有価証券 4,800株 |
| 6810 | マクセル | 79,000 | 1,610.00 | 127,190,000 | |
| 6814 | 古野電気 | 46,500 | 2,022.00 | 94,023,000 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 6817 | スミダコーポレーション | 47,900 | 1,173.00 | 56,186,700 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 6820 | アイコム | 13,800 | 3,745.00 | 51,681,000 | |
| 6823 | リオン | 14,700 | 2,435.00 | 35,794,500 | |
| 6841 | 横河電機 | 391,400 | 2,937.50 | 1,149,737,500 | 貸付有価証券 15,100株 |
| 6844 | 新電元工業 | 13,700 | 3,120.00 | 42,744,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 6845 | アズビル | 243,700 | 4,803.00 | 1,170,491,100 | 貸付有価証券 11,900株 |
| 6848 | 東亜ディーケーケー | 7,000 | 943.00 | 6,601,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 6849 | 日本光電工業 | 151,900 | 4,456.00 | 676,866,400 | 貸付有価証券 6,400株 |
| 6850 | チノー | 14,700 | 2,365.00 | 34,765,500 | |
| 6853 | 共和電業 | 14,000 | 428.00 | 5,992,000 | |
| 6855 | 日本電子材料 | 21,800 | 1,803.00 | 39,305,400 | |
| 6856 | 堀場製作所 | 67,600 | 11,785.00 | 796,666,000 | 貸付有価証券 11,500株 |
| 6857 | アドバンテスト | 1,014,800 | 5,716.00 | 5,800,596,800 | 貸付有価証券 43,200株 |
| 6858 | 小野測器 | 5,900 | 466.00 | 2,749,400 | |

| | | | | | |
|------|------------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 6859 | エスペック | 28,400 | 2,550.00 | 72,420,000 | |
| 6861 | キーエンス | 354,400 | 66,340.00 | 23,510,896,000 | |
| 6866 | 日置電機 | 16,700 | 6,890.00 | 115,063,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 6869 | シスメックス | 305,600 | 7,912.00 | 2,417,907,200 | 貸付有価証券 43,600株 |
| 6871 | 日本マイクロニクス | 63,600 | 4,105.00 | 261,078,000 | 貸付有価証券 7,700株 |
| 6875 | メガチップス | 28,000 | 4,950.00 | 138,600,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 6877 | OBARA GROUP | 19,400 | 4,035.00 | 78,279,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 6901 | 澤藤電機 | 1,800 | 1,292.00 | 2,325,600 | 貸付有価証券 500株 |
| 6904 | 原田工業 | 6,700 | 755.00 | 5,058,500 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 6905 | コーセル | 42,600 | 1,454.00 | 61,940,400 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 6908 | イリソ電子工業 | 32,600 | 3,475.00 | 113,285,000 | |
| 6914 | オプテックスグループ | 65,000 | 1,795.00 | 116,675,000 | |
| 6915 | 千代田インテグレ | 13,900 | 2,762.00 | 38,391,800 | |
| 6920 | レーザーテック | 162,400 | 40,010.00 | 6,497,624,000 | 貸付有価証券 6,300株 |
| 6923 | スタンレー電気 | 226,800 | 2,833.00 | 642,524,400 | 貸付有価証券 40,900株 |
| 6925 | ウシオ電機 | 179,900 | 2,083.50 | 374,821,650 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 6926 | 岡谷電機産業 | 11,500 | 286.00 | 3,289,000 | |
| 6927 | ヘリオス テクノ ホールディング | 14,700 | 543.00 | 7,982,100 | 貸付有価証券 6,500株 |
| 6928 | エノモト | 4,200 | 1,601.00 | 6,724,200 | |
| 6929 | 日本セラミック | 28,900 | 2,687.00 | 77,654,300 | |
| 6932 | 遠藤照明 | 6,800 | 1,365.00 | 9,282,000 | |
| 6937 | 古河電池 | 26,100 | 898.00 | 23,437,800 | 貸付有価証券 3,600株 |
| 6938 | 双信電機 | 6,000 | 312.00 | 1,872,000 | |
| 6941 | 山一電機 | 31,800 | 2,134.00 | 67,861,200 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 6947 | 函研 | 30,800 | 4,085.00 | 125,818,000 | |
| 6951 | 日本電子 | 88,700 | 6,952.00 | 616,642,400 | 貸付有価証券 8,700株 |
| 6952 | カシオ計算機 | 255,900 | 1,274.50 | 326,144,550 | 貸付有価証券 10,200株 |
| 6954 | ファナック | 1,727,300 | 4,300.00 | 7,427,390,000 | 貸付有価証券 207,600株 |

| | | | | | |
|------|---------------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 6958 | 日本シイエムケイ | 75,200 | 753.00 | 56,625,600 | |
| 6961 | エンプラス | 10,300 | 12,340.00 | 127,102,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 6962 | 大真空 | 52,700 | 905.00 | 47,693,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 6963 | ローム | 654,900 | 2,606.50 | 1,706,996,850 | |
| 6965 | 浜松ホトニクス | 284,200 | 5,945.00 | 1,689,569,000 | |
| 6966 | 三井ハイテック | 31,400 | 6,857.00 | 215,309,800 | |
| 6967 | 新光電気工業 | 125,300 | 5,468.00 | 685,140,400 | |
| 6971 | 京セラ | 2,200,800 | 2,162.50 | 4,759,230,000 | |
| 6976 | 太陽誘電 | 172,500 | 3,654.00 | 630,315,000 | 貸付有価証券 26,300株 |
| 6981 | 村田製作所 | 3,222,700 | 2,984.00 | 9,616,536,800 | 貸付有価証券 124,200株 |
| 6986 | 双葉電子工業 | 67,400 | 521.00 | 35,115,400 | |
| 6989 | 北陸電気工業 | 5,600 | 1,398.00 | 7,828,800 | |
| 6996 | ニチコン | 93,000 | 1,287.00 | 119,691,000 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 6997 | 日本ケミコン | 37,700 | 1,352.00 | 50,970,400 | |
| 6999 | K O A | 53,600 | 1,550.00 | 83,080,000 | 貸付有価証券 6,700株 |
| 7244 | 市光工業 | 63,800 | 579.00 | 36,940,200 | |
| 7276 | 小糸製作所 | 367,000 | 2,336.50 | 857,495,500 | 貸付有価証券 41,800株 |
| 7280 | ミツバ | 66,400 | 1,071.00 | 71,114,400 | |
| 7735 | S C R E E Nホールディングス | 121,100 | 14,280.00 | 1,729,308,000 | 貸付有価証券 4,800株 |
| 7739 | キヤノン電子 | 39,100 | 2,021.00 | 79,021,100 | |
| 7751 | キヤノン | 1,766,700 | 3,775.00 | 6,669,292,500 | 貸付有価証券 68,100株 |
| 7752 | リコー | 888,100 | 1,165.00 | 1,034,636,500 | 貸付有価証券 34,300株 |
| 7965 | 象印マホービン | 96,200 | 1,468.00 | 141,221,600 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 7999 | M U T O Hホールディングス | 1,900 | 2,181.00 | 4,143,900 | |
| 8035 | 東京エレクトロン | 749,700 | 27,970.00 | 20,969,109,000 | 貸付有価証券 28,900株 |
| 9880 | イノテック | 23,600 | 1,812.00 | 42,763,200 | |
| 3116 | トヨタ紡織 | 149,100 | 2,425.50 | 361,642,050 | |
| 3526 | 芦森工業 | 3,000 | 2,172.00 | 6,516,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 5949 | ユニプレス | 63,600 | 1,014.00 | 64,490,400 | 貸付有価証券 8,600株 |
| 6201 | 豊田自動織機 | 302,100 | 12,650.00 | 3,821,565,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|--------------|------------|----------|----------------|----------------------|
| | | | | | 30,900株 |
| 6455 | モリタホールディングス | 62,100 | 1,557.00 | 96,689,700 | |
| 6584 | 三櫻工業 | 54,100 | 828.00 | 44,794,800 | 貸付有価証券 5,600株 |
| 6902 | デンソー | 2,922,400 | 2,284.50 | 6,676,222,800 | 貸付有価証券 112,800株 |
| 6995 | 東海理化電機製作所 | 99,900 | 2,293.00 | 229,070,700 | |
| 7012 | 川崎重工業 | 289,200 | 3,281.00 | 948,865,200 | 貸付有価証券 34,400株 |
| 7014 | 名村造船所 | 77,200 | 1,355.00 | 104,606,000 | 貸付有価証券 21,000株 |
| 7102 | 日本車輛製造 | 11,700 | 2,116.00 | 24,757,200 | |
| 7105 | 三菱ロジスネクスト | 56,500 | 1,489.00 | 84,128,500 | |
| 7122 | 近畿車輛 | 2,000 | 1,907.00 | 3,814,000 | |
| 7201 | 日産自動車 | 5,027,600 | 560.40 | 2,817,467,040 | 貸付有価証券 997,700株 |
| 7202 | いすゞ自動車 | 1,029,800 | 2,030.00 | 2,090,494,000 | |
| 7203 | トヨタ自動車 | 19,449,700 | 2,892.50 | 56,258,257,250 | 貸付有価証券 3,218,700株 |
| 7205 | 日野自動車 | 532,800 | 498.90 | 265,813,920 | 貸付有価証券 17,600株 |
| 7211 | 三菱自動車工業 | 1,381,800 | 453.70 | 626,922,660 | 貸付有価証券 163,900株 |
| 7212 | エフテック | 10,500 | 633.00 | 6,646,500 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 7213 | レシップホールディングス | 6,500 | 650.00 | 4,225,000 | |
| 7214 | GMB | 2,900 | 1,232.00 | 3,572,800 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 7215 | ファルテック | 2,700 | 550.00 | 1,485,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 7220 | 武蔵精密工業 | 86,600 | 1,683.00 | 145,747,800 | |
| 7222 | 日産車体 | 41,600 | 968.00 | 40,268,800 | 貸付有価証券 12,500株 |
| 7224 | 新明和工業 | 102,000 | 1,225.00 | 124,950,000 | 貸付有価証券 4,300株 |
| 7226 | 極東開発工業 | 58,500 | 1,993.00 | 116,590,500 | |
| 7231 | トピー工業 | 28,700 | 2,838.00 | 81,450,600 | 貸付有価証券 4,800株 |
| 7236 | ティラド | 7,900 | 3,585.00 | 28,321,500 | |
| 7238 | 曙ブレーキ工業 | 216,200 | 114.00 | 24,646,800 | 貸付有価証券 24,300株 |
| 7239 | タチエス | 65,400 | 1,950.00 | 127,530,000 | |
| 7240 | NOK | 137,600 | 1,920.00 | 264,192,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 7241 | フタバ産業 | 94,900 | 871.00 | 82,657,900 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|-------------|-----------|-----------|----------------|---------------------|
| | | | | | 3,100 株 |
| 7242 | カヤバ | 34,100 | 5,080.00 | 173,228,000 | |
| 7245 | 大同メタル工業 | 69,200 | 541.00 | 37,437,200 | |
| 7246 | プレス工業 | 141,500 | 638.00 | 90,277,000 | |
| 7247 | ミクニ | 19,000 | 480.00 | 9,120,000 | 貸付有価証券 5,600 株 |
| 7250 | 太平洋工業 | 81,200 | 1,422.00 | 115,466,400 | |
| 7256 | 河西工業 | 21,100 | 183.00 | 3,861,300 | 貸付有価証券 6,000 株 |
| 7259 | アイシン | 273,200 | 5,391.00 | 1,472,821,200 | |
| 7261 | マツダ | 1,171,600 | 1,703.00 | 1,995,234,800 | |
| 7266 | 今仙電機製作所 | 9,500 | 632.00 | 6,004,000 | |
| 7267 | 本田技研工業 | 8,637,900 | 1,583.50 | 13,678,114,650 | 貸付有価証券 409,800 株 |
| 7269 | スズキ | 650,600 | 6,298.00 | 4,097,478,800 | 貸付有価証券 112,500 株 |
| 7270 | S U B A R U | 1,098,500 | 2,901.50 | 3,187,297,750 | 貸付有価証券 137,400 株 |
| 7271 | 安永 | 6,600 | 658.00 | 4,342,800 | |
| 7272 | ヤマハ発動機 | 1,530,900 | 1,388.50 | 2,125,654,650 | 貸付有価証券 59,100 株 |
| 7277 | T B K | 16,300 | 397.00 | 6,471,100 | 貸付有価証券 5,200 株 |
| 7278 | エクセディ | 57,900 | 2,775.00 | 160,672,500 | |
| 7282 | 豊田合成 | 103,300 | 2,817.50 | 291,047,750 | |
| 7283 | 愛三工業 | 58,600 | 1,352.00 | 79,227,200 | |
| 7284 | 盟和産業 | 2,100 | 1,024.00 | 2,150,400 | |
| 7291 | 日本プラス | 12,300 | 548.00 | 6,740,400 | |
| 7294 | ヨロズ | 33,200 | 920.00 | 30,544,000 | |
| 7296 | エフ・シー・シー | 62,800 | 1,902.00 | 119,445,600 | |
| 7309 | シマノ | 143,700 | 21,520.00 | 3,092,424,000 | 貸付有価証券 19,100 株 |
| 7313 | テイ・エス テック | 126,100 | 1,847.00 | 232,906,700 | |
| 7408 | ジャムコ | 14,900 | 1,609.00 | 23,974,100 | 貸付有価証券 2,200 株 |
| 4543 | テルモ | 990,400 | 4,933.00 | 4,885,643,200 | 貸付有価証券 42,000 株 |
| 5187 | クリエートメディック | 4,900 | 899.00 | 4,405,100 | 貸付有価証券 300 株 |
| 6376 | 日機装 | 82,500 | 1,068.00 | 88,110,000 | 貸付有価証券 12,800 株 |
| 7600 | 日本エム・ディ・エム | 28,100 | 770.00 | 21,637,000 | |

| | | | | | |
|------|----------------|-----------|-----------|----------------|--------------------|
| 7701 | 島津製作所 | 470,600 | 4,095.00 | 1,927,107,000 | |
| 7702 | JMS | 32,800 | 529.00 | 17,351,200 | |
| 7709 | クボテック | 3,600 | 258.00 | 928,800 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 7715 | 長野計器 | 25,700 | 2,240.00 | 57,568,000 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 7717 | ブイ・テクノロジー | 18,700 | 2,749.00 | 51,406,300 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 7721 | 東京計器 | 27,100 | 1,822.00 | 49,376,200 | |
| 7723 | 愛知時計電機 | 15,300 | 2,755.00 | 42,151,500 | |
| 7725 | インターアクション | 16,800 | 1,136.00 | 19,084,800 | |
| 7727 | オーバル | 13,200 | 554.00 | 7,312,800 | |
| 7729 | 東京精密 | 72,400 | 9,601.00 | 695,112,400 | |
| 7730 | マニー | 141,700 | 2,063.50 | 292,397,950 | |
| 7731 | ニコン | 512,100 | 1,491.00 | 763,541,100 | 貸付有価証券 19,800株 |
| 7732 | トプコン | 172,200 | 1,593.00 | 274,314,600 | 貸付有価証券 12,500株 |
| 7733 | オリンパス | 2,180,300 | 2,169.50 | 4,730,160,850 | 貸付有価証券 309,700株 |
| 7734 | 理研計器 | 25,100 | 7,230.00 | 181,473,000 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 7740 | タムロン | 21,700 | 5,650.00 | 122,605,000 | |
| 7741 | HOYA | 697,300 | 18,190.00 | 12,683,887,000 | 貸付有価証券 89,100株 |
| 7743 | シード | 7,500 | 787.00 | 5,902,500 | |
| 7744 | ノーリツ鋼機 | 33,600 | 3,315.00 | 111,384,000 | |
| 7745 | A&Dホロンホールディングス | 51,600 | 2,030.00 | 104,748,000 | |
| 7747 | 朝日インテック | 395,800 | 2,880.00 | 1,139,904,000 | 貸付有価証券 15,200株 |
| 7762 | シチズン時計 | 325,900 | 925.00 | 301,457,500 | 貸付有価証券 12,600株 |
| 7769 | リズム | 3,400 | 3,060.00 | 10,404,000 | |
| 7775 | 大研医器 | 13,000 | 521.00 | 6,773,000 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 7780 | メニコン | 121,800 | 2,213.00 | 269,543,400 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 7782 | シンシア | 1,400 | 530.00 | 742,000 | |
| 7979 | 松風 | 16,000 | 2,941.00 | 47,056,000 | |
| 8050 | セイコーグループ | 49,400 | 2,592.00 | 128,044,800 | 貸付有価証券 100株 |
| 8086 | ニプロ | 295,200 | 1,168.00 | 344,793,600 | |
| 7795 | KYORITSU | 22,500 | 189.00 | 4,252,500 | |

| | | | | | |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| 7811 | 中本ボックス | 4,800 | 1,712.00 | 8,217,600 | 貸付有価証券 800株 |
| 7816 | スノーピーク | 50,500 | 876.00 | 44,238,000 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 7817 | パラマウントベッドホールディングス | 73,600 | 2,672.00 | 196,659,200 | |
| 7818 | トランザクション | 23,300 | 2,371.00 | 55,244,300 | |
| 7819 | 粧美堂 | 4,100 | 690.00 | 2,829,000 | |
| 7820 | ニホンフラッシュ | 33,200 | 935.00 | 31,042,000 | |
| 7821 | 前田工織 | 29,900 | 3,170.00 | 94,783,000 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 7822 | 永大産業 | 17,900 | 233.00 | 4,170,700 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 7823 | アートネイチャー | 31,900 | 803.00 | 25,615,700 | |
| 7826 | フルヤ金属 | 6,300 | 9,320.00 | 58,716,000 | |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス | 970,400 | 3,151.00 | 3,057,730,400 | 貸付有価証券 174,800株 |
| 7833 | アイフィスジャパン | 4,200 | 609.00 | 2,557,800 | |
| 7839 | SHOEI | 80,000 | 1,973.00 | 157,840,000 | 貸付有価証券 11,500株 |
| 7840 | フランスベッドホールディングス | 45,800 | 1,380.00 | 63,204,000 | |
| 7846 | パイロットコーポレーション | 49,800 | 4,117.00 | 205,026,600 | |
| 7856 | 萩原工業 | 23,700 | 1,480.00 | 35,076,000 | |
| 7864 | フジシールインターナショナル | 71,700 | 1,732.00 | 124,184,400 | |
| 7867 | タカラトミー | 161,200 | 2,511.50 | 404,853,800 | |
| 7868 | 広済堂ホールディングス | 79,700 | 798.00 | 63,600,600 | 貸付有価証券 15,500株 |
| 7872 | エステールホールディングス | 3,600 | 638.00 | 2,296,800 | |
| 7885 | タカノ | 5,600 | 1,000.00 | 5,600,000 | |
| 7893 | プロネクサス | 36,700 | 1,301.00 | 47,746,700 | |
| 7897 | ホクシン | 11,600 | 113.00 | 1,310,800 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 7898 | ウッドワン | 5,100 | 1,042.00 | 5,314,200 | 貸付有価証券 300株 |
| 7911 | TOPPANホールディングス | 435,400 | 4,045.00 | 1,761,193,000 | 貸付有価証券 16,800株 |
| 7912 | 大日本印刷 | 387,100 | 4,198.00 | 1,625,045,800 | 貸付有価証券 54,000株 |
| 7914 | 共同印刷 | 10,000 | 3,350.00 | 33,500,000 | |
| 7915 | NISSHA | 60,600 | 1,604.00 | 97,202,400 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 7916 | 光村印刷 | 1,100 | 1,558.00 | 1,713,800 | 貸付有価証券 400株 |
| 7921 | TAKARA & COMPANY | 22,600 | 2,822.00 | 63,777,200 | |

| | | | | | |
|------|--------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 7936 | アシックス | 301,800 | 4,514.00 | 1,362,325,200 | 貸付有価証券 11,600株 |
| 7937 | ツツミ | 8,300 | 2,160.00 | 17,928,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 7944 | ローランド | 26,100 | 4,930.00 | 128,673,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 7949 | 小松ウオール工業 | 14,400 | 3,440.00 | 49,536,000 | |
| 7951 | ヤマハ | 223,300 | 3,264.00 | 728,851,200 | 貸付有価証券 35,000株 |
| 7952 | 河合楽器製作所 | 10,700 | 3,670.00 | 39,269,000 | |
| 7955 | クリナップ | 34,700 | 737.00 | 25,573,900 | |
| 7956 | ビジョン | 225,600 | 1,616.00 | 364,569,600 | 貸付有価証券 8,700株 |
| 7962 | キングジム | 31,300 | 870.00 | 27,231,000 | |
| 7966 | リンテック | 71,100 | 2,769.00 | 196,875,900 | |
| 7972 | イトーキ | 72,600 | 1,460.00 | 105,996,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 7974 | 任天堂 | 2,236,300 | 7,895.00 | 17,655,588,500 | |
| 7976 | 三菱鉛筆 | 50,300 | 2,013.00 | 101,253,900 | |
| 7981 | タカラスタンダード | 74,600 | 1,742.00 | 129,953,200 | |
| 7984 | コクヨ | 144,900 | 2,377.50 | 344,499,750 | |
| 7987 | ナカバヤシ | 38,100 | 542.00 | 20,650,200 | |
| 7990 | グローブライド | 31,800 | 2,072.00 | 65,889,600 | |
| 7994 | オカムラ | 106,600 | 2,228.00 | 237,504,800 | |
| 8022 | 美津濃 | 35,200 | 4,340.00 | 152,768,000 | |
| 9501 | 東京電力ホールディングス | 3,193,000 | 756.20 | 2,414,546,600 | 貸付有価証券 123,000株 |
| 9502 | 中部電力 | 1,305,300 | 1,858.00 | 2,425,247,400 | 貸付有価証券 135,500株 |
| 9503 | 関西電力 | 1,367,800 | 1,923.00 | 2,630,279,400 | |
| 9504 | 中国電力 | 615,400 | 1,021.00 | 628,323,400 | 貸付有価証券 54,200株 |
| 9505 | 北陸電力 | 362,200 | 709.30 | 256,908,460 | 貸付有価証券 53,500株 |
| 9506 | 東北電力 | 932,600 | 966.40 | 901,264,640 | |
| 9507 | 四国電力 | 329,900 | 1,046.50 | 345,240,350 | 貸付有価証券 11,700株 |
| 9508 | 九州電力 | 816,500 | 1,059.00 | 864,673,500 | |
| 9509 | 北海道電力 | 342,200 | 643.30 | 220,137,260 | |
| 9511 | 沖縄電力 | 90,500 | 1,145.00 | 103,622,500 | |
| 9513 | 電源開発 | 291,000 | 2,428.50 | 706,693,500 | |
| 9514 | エフオン | 22,900 | 444.00 | 10,167,600 | |

| | | | | | |
|------|--------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 9517 | イーレックス | 63,000 | 780.00 | 49,140,000 | 貸付有価証券 8,800株 |
| 9519 | レノバ | 94,400 | 1,192.00 | 112,524,800 | 貸付有価証券 7,300株 |
| 9531 | 東京瓦斯 | 748,800 | 3,295.00 | 2,467,296,000 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 9532 | 大阪瓦斯 | 717,500 | 2,988.00 | 2,143,890,000 | 貸付有価証券 49,500株 |
| 9533 | 東邦瓦斯 | 153,400 | 2,954.50 | 453,220,300 | 貸付有価証券 21,800株 |
| 9534 | 北海道瓦斯 | 21,100 | 2,244.00 | 47,348,400 | |
| 9535 | 広島ガス | 74,800 | 389.00 | 29,097,200 | |
| 9536 | 西部ガスホールディングス | 36,900 | 1,918.00 | 70,774,200 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 9543 | 静岡ガス | 70,600 | 1,005.00 | 70,953,000 | |
| 9551 | メタウォーター | 42,400 | 2,160.00 | 91,584,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 2384 | SBSホールディングス | 31,600 | 2,520.00 | 79,632,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 9001 | 東武鉄道 | 389,100 | 3,884.00 | 1,511,264,400 | 貸付有価証券 15,000株 |
| 9003 | 相鉄ホールディングス | 126,800 | 2,713.00 | 344,008,400 | |
| 9005 | 東急 | 993,200 | 1,720.50 | 1,708,800,600 | 貸付有価証券 112,700株 |
| 9006 | 京浜急行電鉄 | 438,300 | 1,287.00 | 564,092,100 | |
| 9007 | 小田急電鉄 | 585,700 | 2,238.00 | 1,310,796,600 | 貸付有価証券 21,400株 |
| 9008 | 京王電鉄 | 170,300 | 4,357.00 | 741,997,100 | |
| 9009 | 京成電鉄 | 228,400 | 6,748.00 | 1,541,243,200 | 貸付有価証券 40,600株 |
| 9010 | 富士急行 | 43,600 | 4,425.00 | 192,930,000 | 貸付有価証券 6,000株 |
| 9020 | 東日本旅客鉄道 | 650,700 | 8,314.00 | 5,409,919,800 | 貸付有価証券 23,200株 |
| 9021 | 西日本旅客鉄道 | 420,200 | 6,032.00 | 2,534,646,400 | 貸付有価証券 17,500株 |
| 9022 | 東海旅客鉄道 | 1,364,300 | 3,616.00 | 4,933,308,800 | 貸付有価証券 53,000株 |
| 9024 | 西武ホールディングス | 428,500 | 2,050.00 | 878,425,000 | 貸付有価証券 16,600株 |
| 9025 | 鴻池運輸 | 60,400 | 1,950.00 | 117,780,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 9031 | 西日本鉄道 | 94,600 | 2,417.00 | 228,648,200 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 9037 | ハマキョウレックス | 30,200 | 4,080.00 | 123,216,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 9039 | サカイ引越センター | 39,200 | 2,779.00 | 108,936,800 | |

| | | | | | |
|------|--------------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 9041 | 近鉄グループホールディングス | 353,600 | 4,532.00 | 1,602,515,200 | 貸付有価証券 20,400株 |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス | 471,500 | 4,473.00 | 2,109,019,500 | 貸付有価証券 18,200株 |
| 9044 | 南海電気鉄道 | 157,700 | 2,824.00 | 445,344,800 | 貸付有価証券 16,500株 |
| 9045 | 京阪ホールディングス | 194,900 | 3,601.00 | 701,834,900 | 貸付有価証券 6,300株 |
| 9046 | 神戸電鉄 | 9,600 | 2,892.00 | 27,763,200 | |
| 9048 | 名古屋鉄道 | 364,800 | 2,256.00 | 822,988,800 | 貸付有価証券 15,100株 |
| 9052 | 山陽電気鉄道 | 26,600 | 2,173.00 | 57,801,800 | |
| 9055 | アルプス物流 | 28,200 | 1,799.00 | 50,731,800 | |
| 9064 | ヤマトホールディングス | 452,800 | 2,591.00 | 1,173,204,800 | 貸付有価証券 55,400株 |
| 9065 | 山九 | 90,000 | 5,194.00 | 467,460,000 | |
| 9067 | 丸運 | 7,700 | 280.00 | 2,156,000 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 9068 | 丸全昭和運輸 | 21,800 | 4,015.00 | 87,527,000 | |
| 9069 | センコーグループホールディングス | 187,200 | 1,141.00 | 213,595,200 | 貸付有価証券 7,300株 |
| 9070 | トナミホールディングス | 7,800 | 4,755.00 | 37,089,000 | |
| 9072 | ニッコンホールディングス | 113,200 | 3,104.00 | 351,372,800 | 貸付有価証券 5,100株 |
| 9074 | 日本石油輸送 | 1,500 | 2,892.00 | 4,338,000 | |
| 9075 | 福山通運 | 40,400 | 4,070.00 | 164,428,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 9076 | セイノーホールディングス | 198,900 | 2,131.00 | 423,855,900 | 貸付有価証券 7,700株 |
| 9078 | エスライングループ本社 | 4,300 | 886.00 | 3,809,800 | |
| 9081 | 神奈川中央交通 | 10,000 | 3,065.00 | 30,650,000 | |
| 9090 | AZ-COM丸和ホールディングス | 90,400 | 1,550.00 | 140,120,000 | |
| 9099 | C&Fロジホールディングス | 34,000 | 1,666.00 | 56,644,000 | |
| 9142 | 九州旅客鉄道 | 250,000 | 3,171.00 | 792,750,000 | |
| 9143 | SGホールディングス | 593,800 | 2,007.00 | 1,191,756,600 | |
| 9147 | NIPPON EXPRESSホール ディン | 120,000 | 8,737.00 | 1,048,440,000 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 9101 | 日本郵船 | 1,013,600 | 4,970.00 | 5,037,592,000 | 貸付有価証券 36,500株 |
| 9104 | 商船三井 | 767,400 | 5,113.00 | 3,923,716,200 | 貸付有価証券 24,100株 |
| 9107 | 川崎汽船 | 298,600 | 7,006.00 | 2,091,991,600 | 貸付有価証券 10,300株 |
| 9110 | NSユニテッド海運 | 19,100 | 5,100.00 | 97,410,000 | 貸付有価証券 1,300株 |

| | | | | | |
|------|----------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 9115 | 明海グループ | 16,300 | 793.00 | 12,925,900 | |
| 9119 | 飯野海運 | 129,800 | 1,262.00 | 163,807,600 | 貸付有価証券 19,800株 |
| 9130 | 共栄タンカー | 2,800 | 909.00 | 2,545,200 | 貸付有価証券 800株 |
| 9308 | 乾汽船 | 41,400 | 1,110.00 | 45,954,000 | 貸付有価証券 4,300株 |
| 9201 | 日本航空 | 868,600 | 2,811.50 | 2,442,068,900 | |
| 9202 | A N Aホールディングス | 962,200 | 3,162.00 | 3,042,476,400 | |
| 9232 | パスコ | 2,800 | 1,815.00 | 5,082,000 | |
| 9058 | トランコム | 10,300 | 7,150.00 | 73,645,000 | |
| 9066 | 日新 | 26,900 | 2,706.00 | 72,791,400 | |
| 9301 | 三菱倉庫 | 86,900 | 4,514.00 | 392,266,600 | 貸付有価証券 16,300株 |
| 9302 | 三井倉庫ホールディングス | 33,100 | 4,965.00 | 164,341,500 | |
| 9303 | 住友倉庫 | 95,400 | 2,621.00 | 250,043,400 | |
| 9304 | 澁澤倉庫 | 16,100 | 3,090.00 | 49,749,000 | |
| 9306 | 東陽倉庫 | 4,000 | 1,555.00 | 6,220,000 | |
| 9310 | 日本トランスシティ | 71,100 | 632.00 | 44,935,200 | |
| 9312 | ケイヒン | 2,700 | 1,838.00 | 4,962,600 | |
| 9319 | 中央倉庫 | 18,900 | 1,160.00 | 21,924,000 | |
| 9322 | 川西倉庫 | 2,700 | 1,136.00 | 3,067,200 | 貸付有価証券 200株 |
| 9324 | 安田倉庫 | 24,100 | 1,205.00 | 29,040,500 | |
| 9325 | ファイズホールディングス | 2,100 | 1,192.00 | 2,503,200 | |
| 9351 | 東洋埠頭 | 4,400 | 1,390.00 | 6,116,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 9364 | 上組 | 163,300 | 3,389.00 | 553,423,700 | 貸付有価証券 6,400株 |
| 9366 | サンリツ | 3,600 | 768.00 | 2,764,800 | |
| 9368 | キムラユニティー | 7,100 | 1,562.00 | 11,090,200 | |
| 9369 | キューソー流通システム | 14,100 | 939.00 | 13,239,900 | |
| 9380 | 東海運 | 8,800 | 295.00 | 2,596,000 | |
| 9381 | エーアイテイナー | 22,200 | 1,817.00 | 40,337,400 | |
| 9384 | 内外トランスライン | 14,200 | 2,448.00 | 34,761,600 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 9386 | 日本コンセプト | 12,900 | 1,739.00 | 22,433,100 | |
| 1973 | N E C ネットズエスアイ | 138,500 | 2,252.00 | 311,902,000 | |
| 2307 | クロスキャット | 22,500 | 1,156.00 | 26,010,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 2317 | システナ | 537,500 | 302.00 | 162,325,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 23,100株 |
| 2326 | デジタルアーツ | 22,500 | 5,040.00 | 113,400,000 | |
| 2327 | 日鉄ソリューションズ | 60,600 | 4,835.00 | 293,001,000 | |
| 2335 | キューブシステム | 18,800 | 1,124.00 | 21,131,200 | |
| 2359 | コア | 15,700 | 1,817.00 | 28,526,900 | |
| 2477 | 手間いらず | 6,000 | 2,920.00 | 17,520,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 3031 | ラクーンホールディングス | 29,500 | 687.00 | 20,266,500 | |
| 3040 | ソリトンシステムズ | 18,300 | 1,408.00 | 25,766,400 | |
| 3371 | ソフトクリエイイトホールディングス | 29,200 | 1,730.00 | 50,516,000 | |
| 3626 | T I S | 388,500 | 3,315.00 | 1,287,877,500 | |
| 3627 | テクミラホールディングス | 6,900 | 442.00 | 3,049,800 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 3632 | グリーン | 95,200 | 594.00 | 56,548,800 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 3633 | GMOペパボ | 4,300 | 1,187.00 | 5,104,100 | 貸付有価証券 500株 |
| 3635 | コーエーテクモホールディングス | 222,600 | 1,788.00 | 398,008,800 | 貸付有価証券 23,000株 |
| 3636 | 三菱総合研究所 | 17,400 | 4,810.00 | 83,694,000 | |
| 3639 | ボルテージ | 4,400 | 267.00 | 1,174,800 | 貸付有価証券 500株 |
| 3640 | 電算 | 1,800 | 1,509.00 | 2,716,200 | 貸付有価証券 500株 |
| 3648 | A G S | 6,200 | 848.00 | 5,257,600 | |
| 3649 | ファインデックス | 28,200 | 1,027.00 | 28,961,400 | |
| 3655 | ブレインパッド | 26,600 | 1,204.00 | 32,026,400 | |
| 3656 | K L a b | 65,300 | 366.00 | 23,899,800 | 貸付有価証券 10,900株 |
| 3657 | ポールトゥウィンホールディングス | 60,600 | 536.00 | 32,481,600 | |
| 3659 | ネクソン | 794,800 | 2,378.00 | 1,890,034,400 | |
| 3660 | アイスタイル | 105,400 | 428.00 | 45,111,200 | 貸付有価証券 11,100株 |
| 3661 | エムアップホールディングス | 43,500 | 1,008.00 | 43,848,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 3662 | エイチーム | 21,000 | 579.00 | 12,159,000 | |
| 3665 | エニグモ | 45,200 | 364.00 | 16,452,800 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 3666 | テクノスジャパン | 13,100 | 628.00 | 8,226,800 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 3667 | e n i s h | 11,900 | 176.00 | 2,094,400 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 3668 | コロプラ | 137,800 | 626.00 | 86,262,800 | 貸付有価証券 9,600株 |

| | | | | | |
|------|----------------------|---------|-----------|-------------|-------------------|
| 3672 | オルトプラス | 12,100 | 146.00 | 1,766,600 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 3673 | ブロードリーフ | 168,600 | 607.00 | 102,340,200 | |
| 3675 | クロス・マーケティンググループ | 6,400 | 581.00 | 3,718,400 | 貸付有価証券 700株 |
| 3676 | デジタルハーツホールディングス | 22,200 | 1,050.00 | 23,310,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 3678 | メディアドゥ | 16,000 | 1,368.00 | 21,888,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 3679 | じげん | 103,600 | 529.00 | 54,804,400 | |
| 3681 | ブイキューブ | 42,600 | 312.00 | 13,291,200 | |
| 3682 | エンカレッジ・テクノロジー | 3,600 | 604.00 | 2,174,400 | 貸付有価証券 700株 |
| 3683 | サイバーリンクス | 5,100 | 800.00 | 4,080,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 3686 | ディー・エル・イー | 10,700 | 195.00 | 2,086,500 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 3687 | フィックスターズ | 40,100 | 1,670.00 | 66,967,000 | |
| 3688 | CARTA HOLDINGS | 16,700 | 1,531.00 | 25,567,700 | |
| 3694 | オプティム | 36,500 | 945.00 | 34,492,500 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 3696 | セレス | 14,300 | 1,128.00 | 16,130,400 | |
| 3697 | SHIFT | 23,600 | 26,600.00 | 627,760,000 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 3738 | ティーガイア | 37,100 | 1,974.00 | 73,235,400 | |
| 3741 | セック | 3,800 | 5,280.00 | 20,064,000 | |
| 3762 | テクマトリックス | 64,900 | 1,664.00 | 107,993,600 | |
| 3763 | プロシップ | 17,100 | 1,390.00 | 23,769,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 3765 | ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 92,500 | 2,478.00 | 229,215,000 | 貸付有価証券 10,500株 |
| 3769 | GMOペイメントゲートウェイ | 71,000 | 8,743.00 | 620,753,000 | 貸付有価証券 9,000株 |
| 3770 | ザッパラス | 4,200 | 444.00 | 1,864,800 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 3771 | システムリサーチ | 12,200 | 2,961.00 | 36,124,200 | |
| 3774 | インターネットイニシアティブ | 169,800 | 2,950.00 | 500,910,000 | 貸付有価証券 21,900株 |
| 3778 | さくらインターネット | 39,900 | 3,855.00 | 153,814,500 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 3788 | GMOグローバルサイン・ホールディングス | 10,800 | 2,848.00 | 30,758,400 | |
| 3817 | SRAホールディングス | 18,200 | 3,780.00 | 68,796,000 | |
| 3826 | システムインテグレータ | 4,400 | 429.00 | 1,887,600 | 貸付有価証券 1,300株 |

| | | | | | |
|------|-----------------------|---------|----------|-------------|------------------|
| 3834 | 朝日ネット | 38,100 | 624.00 | 23,774,400 | |
| 3835 | e B A S E | 50,000 | 720.00 | 36,000,000 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 3836 | アバントグループ | 44,900 | 1,449.00 | 65,060,100 | |
| 3837 | アドソル日進 | 14,900 | 1,577.00 | 23,497,300 | |
| 3839 | ODKソリューションズ | 2,800 | 601.00 | 1,682,800 | |
| 3843 | フリービット | 18,600 | 1,519.00 | 28,253,400 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 3844 | コムチュア | 51,200 | 1,848.00 | 94,617,600 | |
| 3853 | アステリア | 27,800 | 602.00 | 16,735,600 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 3854 | アイル | 16,600 | 3,185.00 | 52,871,000 | |
| 3901 | マークライnz | 19,300 | 3,015.00 | 58,189,500 | |
| 3902 | メディカル・データ・ビジョン | 42,400 | 640.00 | 27,136,000 | |
| 3903 | g u m i | 52,400 | 405.00 | 21,222,000 | 貸付有価証券 5,500株 |
| 3909 | ショーケース | 3,500 | 324.00 | 1,134,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 3912 | モバイルファクトリー | 3,200 | 652.00 | 2,086,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 3915 | テラスカイ | 15,300 | 1,514.00 | 23,164,200 | 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 | 20,500 | 1,685.00 | 34,542,500 | |
| 3918 | P C Iホールディングス | 5,800 | 1,008.00 | 5,846,400 | |
| 3920 | アイビーシー | 2,300 | 493.00 | 1,133,900 | |
| 3921 | ネオジャパン | 11,900 | 1,048.00 | 12,471,200 | |
| 3922 | P R T I M E S | 7,100 | 2,145.00 | 15,229,500 | |
| 3923 | ラクス | 168,000 | 2,433.00 | 408,744,000 | |
| 3924 | ランドコンピュータ | 7,300 | 908.00 | 6,628,400 | |
| 3925 | ダブルスタンダード | 10,800 | 1,647.00 | 17,787,600 | |
| 3926 | オーブンドア | 20,700 | 871.00 | 18,029,700 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 3928 | マイネット | 4,900 | 292.00 | 1,430,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 3932 | アカツキ | 16,900 | 2,656.00 | 44,886,400 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 3934 | ベネフィットジャパン | 900 | 1,230.00 | 1,107,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 3937 | U b i c o mホールディングス | 11,000 | 1,501.00 | 16,511,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 3939 | カナミックネットワーク | 38,300 | 418.00 | 16,009,400 | |
| 3940 | ノムラシステムコーポレーション | 14,700 | 114.00 | 1,675,800 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 4,000株 |
| 3962 | チェンジホールディングス | 77,300 | 1,411.00 | 109,070,300 | 貸付有価証券 5,400株 |
| 3963 | シンクロ・フード | 8,500 | 669.00 | 5,686,500 | |
| 3964 | オークネット | 13,100 | 2,110.00 | 27,641,000 | |
| 3965 | キャピタル・アセット・プランニング | 2,800 | 763.00 | 2,136,400 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 3968 | セグエグループ | 4,300 | 912.00 | 3,921,600 | |
| 3969 | エイトレッド | 2,200 | 1,395.00 | 3,069,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 3978 | マクロミル | 69,700 | 800.00 | 55,760,000 | |
| 3981 | ビーグリー | 2,700 | 1,292.00 | 3,488,400 | 貸付有価証券 800株 |
| 3983 | オロ | 12,800 | 2,971.00 | 38,028,800 | |
| 3984 | ユーザーローカル | 12,800 | 2,091.00 | 26,764,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 3985 | テモナ | 3,000 | 263.00 | 789,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 3992 | ニーズウェル | 8,300 | 783.00 | 6,498,900 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 3994 | マネーフォワード | 79,000 | 5,426.00 | 428,654,000 | 貸付有価証券 10,100株 |
| 3996 | サインポスト | 5,400 | 532.00 | 2,872,800 | 貸付有価証券 700株 |
| 4053 | Sun Asterisk | 25,200 | 992.00 | 24,998,400 | 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 | 21,000 | 2,632.00 | 55,272,000 | |
| 4072 | 電算システムホールディングス | 15,700 | 2,920.00 | 45,844,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 4180 | Appier Group | 121,400 | 1,797.00 | 218,155,800 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 4194 | ビジョナル | 21,000 | 9,530.00 | 200,130,000 | |
| 4284 | ソルクシーズ | 12,300 | 404.00 | 4,969,200 | 貸付有価証券 3,800株 |
| 4295 | フェイス | 4,300 | 483.00 | 2,076,900 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 4298 | プロトコーポレーション | 38,900 | 1,318.00 | 51,270,200 | |
| 4299 | ハイマックス | 11,100 | 1,411.00 | 15,662,100 | |
| 4307 | 野村総合研究所 | 787,000 | 4,337.00 | 3,413,219,000 | 貸付有価証券 27,300株 |
| 4320 | CEホールディングス | 7,700 | 624.00 | 4,804,800 | |
| 4323 | 日本システム技術 | 11,500 | 3,355.00 | 38,582,500 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 4326 | インテージホールディングス | 40,200 | 1,744.00 | 70,108,800 | |
| 4333 | 東邦システムサイエンス | 11,600 | 1,309.00 | 15,184,400 | |

| | | | | | |
|------|-----------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 4344 | ソースネクスト | 162,600 | 153.00 | 24,877,800 | 貸付有価証券 20,400株 |
| 4348 | インフォコム | 45,800 | 2,555.00 | 117,019,000 | |
| 4373 | シンプレクス・ホールディングス | 53,400 | 2,897.00 | 154,699,800 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 4382 | HEROZ | 11,900 | 1,680.00 | 19,992,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 4384 | ラクスル | 85,600 | 1,186.00 | 101,521,600 | 貸付有価証券 9,600株 |
| 4385 | メルカリ | 215,400 | 2,451.50 | 528,053,100 | 貸付有価証券 27,600株 |
| 4390 | I P S | 10,200 | 1,972.00 | 20,114,400 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 4392 | F I G | 17,500 | 317.00 | 5,547,500 | 貸付有価証券 900株 |
| 4396 | システムサポート | 13,700 | 2,012.00 | 27,564,400 | |
| 4420 | イーソル | 25,600 | 585.00 | 14,976,000 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 4430 | 東海ソフト | 2,200 | 1,162.00 | 2,556,400 | |
| 4432 | ウイングアーク1st | 36,900 | 2,825.00 | 104,242,500 | |
| 4433 | ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング | 9,500 | 1,200.00 | 11,400,000 | |
| 4434 | サーバーワークス | 7,300 | 3,930.00 | 28,689,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 4439 | 東名 | 1,200 | 2,224.00 | 2,668,800 | 貸付有価証券 500株 |
| 4440 | ヴィッツ | 1,400 | 837.00 | 1,171,800 | 貸付有価証券 400株 |
| 4441 | トビラシステムズ | 3,900 | 887.00 | 3,459,300 | 貸付有価証券 900株 |
| 4443 | S a n s a n | 116,500 | 1,386.00 | 161,469,000 | 貸付有価証券 20,900株 |
| 4446 | L i n k - U | 3,000 | 664.00 | 1,992,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 4449 | ギフトィ | 31,000 | 1,644.00 | 50,964,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 4480 | メドレー | 47,700 | 4,540.00 | 216,558,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 4481 | ベース | 12,300 | 3,355.00 | 41,266,500 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 4483 | J M D C | 60,600 | 4,007.00 | 242,824,200 | 貸付有価証券 9,300株 |
| 4662 | フォーカスシステムズ | 23,700 | 1,052.00 | 24,932,400 | |
| 4674 | クレスコ | 29,100 | 1,903.00 | 55,377,300 | |
| 4676 | フジ・メディア・ホールディングス | 341,200 | 1,727.00 | 589,252,400 | 貸付有価証券 13,200株 |
| 4684 | オービック | 118,700 | 22,765.00 | 2,702,205,500 | |

| | | | | | |
|------|------------------|-----------|-----------|---------------|------------------|
| 4686 | ジャストシステム | 51,000 | 3,200.00 | 163,200,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 4687 | TDCソフト | 33,300 | 2,205.00 | 73,426,500 | |
| 4689 | LINEヤフー | 5,057,200 | 467.90 | 2,366,263,880 | |
| 4704 | トレンドマイクロ | 167,900 | 8,192.00 | 1,375,436,800 | 貸付有価証券 6,500株 |
| 4709 | IDホールディングス | 23,900 | 1,724.00 | 41,203,600 | |
| 4716 | 日本オラクル | 68,000 | 11,685.00 | 794,580,000 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 4719 | アルファシステムズ | 9,300 | 3,105.00 | 28,876,500 | |
| 4722 | フューチャー | 75,800 | 1,771.00 | 134,241,800 | |
| 4725 | CAC Holdings | 19,000 | 1,773.00 | 33,687,000 | |
| 4726 | SBテクノロジー | 15,100 | 2,473.00 | 37,342,300 | |
| 4728 | トーセ | 4,200 | 712.00 | 2,990,400 | 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 | 49,900 | 6,863.00 | 342,463,700 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 4743 | アイティフォー | 45,500 | 1,211.00 | 55,100,500 | |
| 4746 | 東計電算 | 9,900 | 3,510.00 | 34,749,000 | |
| 4762 | エクスネット | 2,000 | 1,127.00 | 2,254,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 4768 | 大塚商会 | 176,200 | 6,134.00 | 1,080,810,800 | |
| 4776 | サイボウズ | 48,900 | 2,138.00 | 104,548,200 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 4812 | 電通総研 | 43,200 | 5,640.00 | 243,648,000 | |
| 4813 | ACCESS | 36,900 | 776.00 | 28,634,400 | 貸付有価証券 4,100株 |
| 4819 | デジタルガレージ | 56,800 | 3,595.00 | 204,196,000 | 貸付有価証券 7,900株 |
| 4820 | EMシステムズ | 59,200 | 686.00 | 40,611,200 | 貸付有価証券 800株 |
| 4825 | ウェザーニューズ | 11,000 | 5,450.00 | 59,950,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 4826 | C I J | 59,000 | 672.00 | 39,648,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 4828 | ビジネスエンジニアリング | 5,800 | 4,585.00 | 26,593,000 | |
| 4829 | 日本エンタープライズ | 15,600 | 127.00 | 1,981,200 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 4839 | WOWOW | 26,700 | 1,139.00 | 30,411,300 | |
| 4845 | スカラ | 32,900 | 759.00 | 24,971,100 | |
| 4847 | インテリジェント ウェイブ | 8,000 | 1,062.00 | 8,496,000 | |
| 5032 | ANYCOLOR | 12,500 | 3,770.00 | 47,125,000 | |
| 6879 | IMAGICA GROUP | 35,600 | 634.00 | 22,570,400 | |

| | | | | | |
|------|--------------------------|-------------|-----------|----------------|--------------------|
| 7518 | ネットワンシステムズ | 143,400 | 2,374.00 | 340,431,600 | |
| 7527 | システムソフト | 123,600 | 61.00 | 7,539,600 | 貸付有価証券 10,300株 |
| 7595 | アルゴグラフィックス | 32,600 | 3,960.00 | 129,096,000 | |
| 7844 | マーベラス | 57,700 | 754.00 | 43,505,800 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 7860 | エイベックス | 60,500 | 1,406.00 | 85,063,000 | |
| 8056 | B I P R O G Y | 116,200 | 4,330.00 | 503,146,000 | |
| 8157 | 都築電気 | 18,700 | 2,178.00 | 40,728,600 | |
| 9401 | T B Sホールディングス | 178,700 | 3,412.00 | 609,724,400 | 貸付有価証券 26,500株 |
| 9404 | 日本テレビホールディングス | 314,500 | 1,701.50 | 535,121,750 | |
| 9405 | 朝日放送グループホールディングス | 33,200 | 671.00 | 22,277,200 | |
| 9409 | テレビ朝日ホールディングス | 86,300 | 1,752.00 | 151,197,600 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 9412 | スカパー J S A Tホールディングス | 275,900 | 757.00 | 208,856,300 | |
| 9413 | テレビ東京ホールディングス | 25,600 | 3,085.00 | 78,976,000 | |
| 9414 | 日本BS放送 | 5,400 | 902.00 | 4,870,800 | |
| 9416 | ビジョン | 53,500 | 1,182.00 | 63,237,000 | |
| 9417 | スマートバリュー | 3,600 | 404.00 | 1,454,400 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 9418 | USEN-NEXT HOLDING S | 39,800 | 4,295.00 | 170,941,000 | |
| 9419 | ワイヤレスゲート | 6,600 | 285.00 | 1,881,000 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 9424 | 日本通信 | 349,700 | 231.00 | 80,780,700 | |
| 9428 | クロップス | 2,000 | 1,126.00 | 2,252,000 | |
| 9432 | 日本電信電話 | 105,672,300 | 183.40 | 19,380,299,820 | |
| 9433 | K D D I | 2,745,100 | 4,859.00 | 13,338,440,900 | |
| 9434 | ソフトバンク | 5,716,500 | 1,933.50 | 11,052,852,750 | 貸付有価証券 219,900株 |
| 9435 | 光通信 | 35,800 | 25,320.00 | 906,456,000 | |
| 9438 | エムティーアイ | 24,300 | 594.00 | 14,434,200 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 9449 | GMOインターネットグループ | 131,300 | 2,640.50 | 346,697,650 | 貸付有価証券 10,000株 |
| 9450 | ファイバーゲート | 19,100 | 954.00 | 18,221,400 | |
| 9466 | アイドママーケティングコミュニケー ション | 3,500 | 234.00 | 819,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 9468 | K A D O K A W A | 187,800 | 3,143.00 | 590,255,400 | 貸付有価証券 30,700株 |
| 9470 | 学研ホールディングス | 59,100 | 1,030.00 | 60,873,000 | |

| | | | | | |
|------|----------------------|-----------|-----------|----------------|-------------------|
| 9474 | ゼンリン | 60,700 | 881.00 | 53,476,700 | |
| 9475 | 昭文社ホールディングス | 6,500 | 356.00 | 2,314,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 9479 | インプレスホールディングス | 13,900 | 177.00 | 2,460,300 | 貸付有価証券 3,600株 |
| 9600 | アイネット | 21,500 | 1,988.00 | 42,742,000 | |
| 9601 | 松竹 | 18,500 | 10,035.00 | 185,647,500 | 貸付有価証券 2,900株 |
| 9602 | 東宝 | 197,600 | 4,789.00 | 946,306,400 | |
| 9605 | 東映 | 11,700 | 20,430.00 | 239,031,000 | |
| 9613 | N T Tデータグループ | 928,900 | 2,103.00 | 1,953,476,700 | 貸付有価証券 43,000株 |
| 9629 | ピー・シー・エー | 20,400 | 1,208.00 | 24,643,200 | 貸付有価証券 600株 |
| 9658 | ビジネスブレイン太田昭和 | 13,900 | 2,204.00 | 30,635,600 | |
| 9682 | D T S | 74,900 | 3,625.00 | 271,512,500 | |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 162,300 | 5,837.00 | 947,345,100 | 貸付有価証券 18,600株 |
| 9692 | シーイーシー | 44,800 | 1,701.00 | 76,204,800 | |
| 9697 | カプコン | 317,700 | 5,505.00 | 1,748,938,500 | 貸付有価証券 13,500株 |
| 9702 | アイ・エス・ビー | 18,100 | 1,573.00 | 28,471,300 | |
| 9717 | ジャステック | 21,800 | 1,351.00 | 29,451,800 | |
| 9719 | S C S K | 248,600 | 2,852.50 | 709,131,500 | 貸付有価証券 30,300株 |
| 9739 | N S W | 15,800 | 2,850.00 | 45,030,000 | |
| 9742 | アイネス | 27,700 | 1,598.00 | 44,264,600 | |
| 9746 | T K C | 56,300 | 3,785.00 | 213,095,500 | |
| 9749 | 富士ソフト | 71,400 | 6,380.00 | 455,532,000 | |
| 9759 | N S D | 126,800 | 2,760.00 | 349,968,000 | |
| 9766 | コナミグループ | 133,100 | 8,872.00 | 1,180,863,200 | 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 | 21,900 | 2,608.00 | 57,115,200 | |
| 9889 | J B C Cホールディングス | 23,500 | 4,075.00 | 95,762,500 | |
| 9928 | ミロク情報サービス | 32,300 | 1,822.00 | 58,850,600 | |
| 9984 | ソフトバンクグループ | 1,752,400 | 6,520.00 | 11,425,648,000 | 貸付有価証券 67,600株 |
| 2676 | 高千穂交易 | 10,400 | 4,135.00 | 43,004,000 | 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 | 2,400 | 1,858.00 | 4,459,200 | 貸付有価証券 500株 |
| 2692 | 伊藤忠食品 | 8,400 | 7,390.00 | 62,076,000 | |

| | | | | | |
|------|---------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 2715 | エレマテック | 33,600 | 1,855.00 | 62,328,000 | |
| 2733 | あらた | 57,300 | 3,200.00 | 183,360,000 | |
| 2737 | トーメンデバイス | 5,400 | 5,340.00 | 28,836,000 | |
| 2760 | 東京エレクトロニクスデバイス | 37,400 | 5,890.00 | 220,286,000 | 貸付有価証券 4,800株 |
| 2767 | 円谷フィールズホールディングス | 64,300 | 1,696.00 | 109,052,800 | 貸付有価証券 6,800株 |
| 2768 | 双日 | 417,200 | 3,418.00 | 1,425,989,600 | |
| 2784 | アルフレッサホールディングス | 376,200 | 2,402.50 | 903,820,500 | |
| 2874 | 横浜冷凍 | 102,100 | 1,081.00 | 110,370,100 | 貸付有価証券 12,200株 |
| 3004 | 神栄 | 2,300 | 1,806.00 | 4,153,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 3023 | ラサ商事 | 13,300 | 1,664.00 | 22,131,200 | |
| 3036 | アルコニックス | 49,300 | 1,393.00 | 68,674,900 | |
| 3038 | 神戸物産 | 289,900 | 3,830.00 | 1,110,317,000 | 貸付有価証券 11,100株 |
| 3054 | ハイパー | 3,100 | 308.00 | 954,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 3076 | あいホールディングス | 60,000 | 2,509.00 | 150,540,000 | |
| 3079 | ディーブイエックス | 4,300 | 1,078.00 | 4,635,400 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 3107 | ダイワボウホールディングス | 165,900 | 3,221.00 | 534,363,900 | |
| 3132 | マクニカホールディングス | 88,700 | 8,000.00 | 709,600,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 3139 | ラクト・ジャパン | 14,500 | 2,160.00 | 31,320,000 | |
| 3150 | グリムス | 15,800 | 2,091.00 | 33,037,800 | 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 | 56,700 | 1,141.00 | 64,694,700 | |
| 3153 | 八洲電機 | 30,300 | 1,319.00 | 39,965,700 | |
| 3154 | メディアスホールディングス | 24,000 | 761.00 | 18,264,000 | |
| 3156 | レスターホールディングス | 31,900 | 3,040.00 | 96,976,000 | |
| 3157 | ジオリーブグループ | 3,300 | 1,363.00 | 4,497,900 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 3160 | 大光 | 6,800 | 628.00 | 4,270,400 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 3166 | OCHIホールディングス | 3,500 | 1,569.00 | 5,491,500 | |
| 3167 | TOKAIホールディングス | 203,500 | 976.00 | 198,616,000 | |
| 3168 | 黒谷 | 4,300 | 606.00 | 2,605,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 3173 | Cominix | 2,900 | 822.00 | 2,383,800 | |
| 3176 | 三洋貿易 | 42,300 | 1,250.00 | 52,875,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|------------------|---------|----------|-------------|------------------|
| | | | | | 4,400株 |
| 3180 | ビューティガレージ | 11,800 | 2,226.00 | 26,266,800 | |
| 3183 | ウイン・パートナーズ | 24,200 | 1,223.00 | 29,596,600 | |
| 3321 | ミタチ産業 | 4,000 | 1,150.00 | 4,600,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 3360 | シップヘルスケアホールディングス | 134,700 | 2,307.50 | 310,820,250 | |
| 3388 | 明治電機工業 | 13,900 | 1,440.00 | 20,016,000 | |
| 3392 | デリカフーズホールディングス | 6,600 | 588.00 | 3,880,800 | |
| 3393 | スターティアホールディングス | 3,600 | 1,517.00 | 5,461,200 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 3543 | コメダホールディングス | 91,800 | 2,781.00 | 255,295,800 | |
| 3559 | ビーバンドットコム | 1,900 | 385.00 | 731,500 | 貸付有価証券 800株 |
| 3565 | アセンテック | 14,300 | 587.00 | 8,394,100 | 貸付有価証券 600株 |
| 5009 | 富士興産 | 4,200 | 1,988.00 | 8,349,600 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 6973 | 協栄産業 | 1,600 | 2,736.00 | 4,377,600 | |
| 7128 | フルサト・マルカホールディングス | 33,300 | 2,411.00 | 80,286,300 | |
| 7130 | ヤマエグループホールディングス | 21,200 | 3,235.00 | 68,582,000 | 貸付有価証券 4,100株 |
| 7414 | 小野建 | 36,800 | 1,805.00 | 66,424,000 | |
| 7417 | 南陽 | 3,200 | 2,184.00 | 6,988,800 | |
| 7420 | 佐鳥電機 | 18,300 | 2,380.00 | 43,554,000 | |
| 7427 | エコートレーディング | 3,000 | 1,209.00 | 3,627,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 7433 | 伯東 | 21,500 | 6,010.00 | 129,215,000 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 7438 | コンドーテック | 28,800 | 1,235.00 | 35,568,000 | |
| 7442 | 中山福 | 8,400 | 374.00 | 3,141,600 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 7447 | ナガイレーベン | 47,300 | 2,315.00 | 109,499,500 | |
| 7451 | 三菱食品 | 34,600 | 4,925.00 | 170,405,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 7456 | 松田産業 | 28,500 | 2,678.00 | 76,323,000 | |
| 7458 | 第一興商 | 145,000 | 2,062.50 | 299,062,500 | 貸付有価証券 7,800株 |
| 7459 | メディパルホールディングス | 387,900 | 2,292.50 | 889,260,750 | |
| 7466 | S P K | 16,600 | 1,988.00 | 33,000,800 | |
| 7467 | 萩原電気ホールディングス | 16,100 | 4,975.00 | 80,097,500 | 貸付有価証券 500株 |
| 7476 | アズワン | 58,700 | 5,557.00 | 326,195,900 | |
| 7480 | スズデン | 13,100 | 2,432.00 | 31,859,200 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|--------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| | | | | | 100株 |
| 7481 | 尾家産業 | 3,700 | 1,750.00 | 6,475,000 | |
| 7482 | シモジマ | 25,100 | 1,314.00 | 32,981,400 | |
| 7483 | ドウシシャ | 34,700 | 2,201.00 | 76,374,700 | |
| 7487 | 小津産業 | 3,600 | 1,643.00 | 5,914,800 | |
| 7504 | 高速 | 22,200 | 2,232.00 | 49,550,400 | |
| 7510 | たけびし | 14,300 | 2,010.00 | 28,743,000 | |
| 7525 | リックス | 6,600 | 3,685.00 | 24,321,000 | |
| 7537 | 丸文 | 33,400 | 1,695.00 | 56,613,000 | |
| 7552 | ハピネット | 31,900 | 2,841.00 | 90,627,900 | 貸付有価証券 700株 |
| 7570 | 橋本総業ホールディングス | 14,800 | 1,298.00 | 19,210,400 | |
| 7575 | 日本ライフライン | 109,800 | 1,311.00 | 143,947,800 | |
| 7590 | タカショー | 32,600 | 505.00 | 16,463,000 | 貸付有価証券 3,800株 |
| 7599 | I DOM | 99,100 | 859.00 | 85,126,900 | |
| 7607 | 進和 | 22,900 | 2,419.00 | 55,395,100 | |
| 7608 | エスケイジャパン | 3,800 | 702.00 | 2,667,600 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 7609 | ダイトロン | 14,800 | 2,974.00 | 44,015,200 | |
| 7613 | シークス | 53,400 | 1,475.00 | 78,765,000 | 貸付有価証券 4,500株 |
| 7619 | 田中商事 | 4,400 | 783.00 | 3,445,200 | |
| 7628 | オーハシテクニカ | 19,600 | 1,754.00 | 34,378,400 | |
| 7637 | 白銅 | 10,500 | 2,433.00 | 25,546,500 | |
| 7673 | ダイコー通産 | 1,600 | 1,201.00 | 1,921,600 | 貸付有価証券 400株 |
| 8001 | 伊藤忠商事 | 2,519,200 | 6,535.00 | 16,462,972,000 | 貸付有価証券 305,000株 |
| 8002 | 丸紅 | 3,124,600 | 2,459.50 | 7,684,953,700 | |
| 8007 | 高島 | 9,600 | 1,264.00 | 12,134,400 | |
| 8012 | 長瀬産業 | 171,800 | 2,380.50 | 408,969,900 | |
| 8014 | 蝶理 | 23,500 | 2,947.00 | 69,254,500 | |
| 8015 | 豊田通商 | 328,300 | 9,479.00 | 3,111,955,700 | 貸付有価証券 27,700株 |
| 8018 | 三共生興 | 51,900 | 740.00 | 38,406,000 | |
| 8020 | 兼松 | 156,700 | 2,223.00 | 348,344,100 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 8025 | ツカモトコーポレーション | 2,200 | 1,212.00 | 2,666,400 | |
| 8031 | 三井物産 | 2,823,700 | 5,803.00 | 16,385,931,100 | |

| | | | | | |
|------|-----------------|-----------|----------|----------------|------------------|
| 8032 | 日本紙パルプ商事 | 17,900 | 5,030.00 | 90,037,000 | |
| 8037 | カメイ | 39,800 | 1,909.00 | 75,978,200 | |
| 8038 | 東都水産 | 800 | 7,020.00 | 5,616,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 8041 | OUGホールディングス | 2,300 | 2,457.00 | 5,651,100 | |
| 8043 | スターゼン | 25,900 | 2,690.00 | 69,671,000 | |
| 8051 | 山善 | 113,600 | 1,251.00 | 142,113,600 | |
| 8052 | 椿本興業 | 7,700 | 6,780.00 | 52,206,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 8053 | 住友商事 | 2,268,100 | 3,297.00 | 7,477,925,700 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 8057 | 内田洋行 | 15,200 | 7,610.00 | 115,672,000 | |
| 8058 | 三菱商事 | 7,426,000 | 2,477.50 | 18,397,915,000 | |
| 8059 | 第一実業 | 35,200 | 1,869.00 | 65,788,800 | |
| 8060 | キャノンマーケティングジャパン | 86,800 | 4,362.00 | 378,621,600 | |
| 8061 | 西華産業 | 14,700 | 3,065.00 | 45,055,500 | |
| 8065 | 佐藤商事 | 26,000 | 1,558.00 | 40,508,000 | 貸付有価証券 3,600株 |
| 8068 | 菱洋エレクトロ | 35,500 | 3,900.00 | 138,450,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 8070 | 東京産業 | 34,200 | 743.00 | 25,410,600 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 8074 | ユアサ商事 | 29,300 | 4,855.00 | 142,251,500 | |
| 8075 | 神鋼商事 | 9,400 | 5,950.00 | 55,930,000 | |
| 8077 | トルク | 8,500 | 296.00 | 2,516,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 8078 | 阪和興業 | 67,300 | 5,320.00 | 358,036,000 | 貸付有価証券 6,300株 |
| 8079 | 正栄食品工業 | 24,900 | 4,520.00 | 112,548,000 | |
| 8081 | カナデン | 28,100 | 1,538.00 | 43,217,800 | |
| 8084 | RYODEN | 30,200 | 2,703.00 | 81,630,600 | |
| 8088 | 岩谷産業 | 85,300 | 6,525.00 | 556,582,500 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 8089 | ナイス | 5,000 | 1,562.00 | 7,810,000 | |
| 8091 | ニチモウ | 4,000 | 2,127.00 | 8,508,000 | |
| 8093 | 極東貿易 | 22,400 | 2,130.00 | 47,712,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 8095 | アステナホールディングス | 70,400 | 481.00 | 33,862,400 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 8097 | 三愛オブリ | 90,100 | 1,667.00 | 150,196,700 | 貸付有価証券 5,800株 |
| 8098 | 稲畑産業 | 74,100 | 3,140.00 | 232,674,000 | |

| | | | | | |
|------|-----------------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 8101 | G S I クレオス | 20,100 | 2,326.00 | 46,752,600 | |
| 8103 | 明和産業 | 44,300 | 666.00 | 29,503,800 | |
| 8104 | クワザワホールディングス | 5,700 | 686.00 | 3,910,200 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 8125 | ワキタ | 62,000 | 1,535.00 | 95,170,000 | |
| 8129 | 東邦ホールディングス | 103,700 | 3,192.00 | 331,010,400 | |
| 8130 | サンゲツ | 86,300 | 3,210.00 | 277,023,000 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 8131 | ミツウロコグループホールディングス | 47,800 | 1,508.00 | 72,082,400 | |
| 8132 | シナネンホールディングス | 10,400 | 4,045.00 | 42,068,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 8133 | 伊藤忠エネクス | 92,900 | 1,579.00 | 146,689,100 | |
| 8136 | サンリオ | 106,200 | 6,102.00 | 648,032,400 | 貸付有価証券 12,300株 |
| 8137 | サンワテクノス | 19,100 | 2,293.00 | 43,796,300 | |
| 8140 | リョーサン | 26,500 | 5,050.00 | 133,825,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 8141 | 新光商事 | 50,300 | 1,228.00 | 61,768,400 | |
| 8142 | トーヨー | 14,600 | 2,842.00 | 41,493,200 | |
| 8150 | 三信電気 | 15,100 | 2,425.00 | 36,617,500 | |
| 8151 | 東陽テクニカ | 38,000 | 1,450.00 | 55,100,000 | |
| 8153 | モスフードサービス | 55,100 | 3,370.00 | 185,687,000 | |
| 8154 | 加賀電子 | 34,200 | 6,760.00 | 231,192,000 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 8158 | ソーダニッカ | 27,700 | 1,232.00 | 34,126,400 | |
| 8159 | 立花エレテック | 24,900 | 3,105.00 | 77,314,500 | |
| 8275 | フォーバル | 14,700 | 1,418.00 | 20,844,600 | |
| 8283 | P A L T A C | 50,500 | 4,556.00 | 230,078,000 | |
| 8285 | 三谷産業 | 65,500 | 363.00 | 23,776,500 | |
| 8835 | 太平洋興発 | 6,000 | 818.00 | 4,908,000 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 9260 | 西本W i s m e t t a cホールディングス | 9,500 | 6,080.00 | 57,760,000 | 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 | 1,200 | 2,331.00 | 2,797,200 | 貸付有価証券 300株 |
| 9273 | コア商事ホールディングス | 21,000 | 757.00 | 15,897,000 | |
| 9274 | K P Pグループホールディングス | 97,000 | 725.00 | 70,325,000 | 貸付有価証券 10,300株 |
| 9305 | ヤマタネ | 16,500 | 2,543.00 | 41,959,500 | |
| 9763 | 丸紅建材リース | 1,100 | 2,788.00 | 3,066,800 | |
| 9824 | 泉州電業 | 18,800 | 3,540.00 | 66,552,000 | |

| | | | | | |
|------|----------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 9830 | トラスコ中山 | 78,700 | 2,473.00 | 194,625,100 | |
| 9832 | オートバックスセブン | 130,400 | 1,573.00 | 205,119,200 | |
| 9837 | モリト | 26,800 | 1,425.00 | 38,190,000 | |
| 9869 | 加藤産業 | 46,400 | 4,685.00 | 217,384,000 | |
| 9872 | 北恵 | 3,700 | 863.00 | 3,193,100 | 貸付有価証券 800株 |
| 9882 | イエローハット | 59,500 | 1,804.00 | 107,338,000 | |
| 9896 | J Kホールディングス | 28,800 | 1,061.00 | 30,556,800 | |
| 9902 | 日伝 | 25,300 | 2,755.00 | 69,701,500 | 貸付有価証券 900株 |
| 9930 | 北沢産業 | 8,900 | 308.00 | 2,741,200 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 9932 | 杉本商事 | 18,100 | 2,229.00 | 40,344,900 | |
| 9934 | 因幡電機産業 | 97,200 | 3,535.00 | 343,602,000 | 貸付有価証券 3,800株 |
| 9960 | 東テク | 12,500 | 5,210.00 | 65,125,000 | |
| 9962 | ミスミグループ本社 | 565,800 | 2,448.00 | 1,385,078,400 | 貸付有価証券 68,800株 |
| 9972 | アルテック | 8,400 | 249.00 | 2,091,600 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 9982 | タキヒヨー | 3,700 | 1,112.00 | 4,114,400 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 9986 | 蔵王産業 | 2,700 | 2,495.00 | 6,736,500 | |
| 9987 | スズケン | 142,600 | 4,592.00 | 654,819,200 | |
| 9991 | ジェコス | 22,400 | 1,092.00 | 24,460,800 | |
| 9995 | グローセル | 38,300 | 671.00 | 25,699,300 | |
| 2651 | ローソン | 79,700 | 8,285.00 | 660,314,500 | |
| 2659 | サンエー | 28,600 | 4,550.00 | 130,130,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 2664 | カワチ薬品 | 29,300 | 2,686.00 | 78,699,800 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 2670 | エービーシー・マート | 164,000 | 2,614.50 | 428,778,000 | |
| 2674 | ハードオフコーポレーション | 11,600 | 1,842.00 | 21,367,200 | |
| 2678 | アスクル | 77,500 | 2,094.00 | 162,285,000 | 貸付有価証券 2,900株 |
| 2681 | ゲオホールディングス | 42,000 | 2,297.00 | 96,474,000 | |
| 2685 | アダストリア | 45,200 | 3,285.00 | 148,482,000 | |
| 2686 | ジーフット | 10,100 | 297.00 | 2,999,700 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 2687 | シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 2,000 | 740.00 | 1,480,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 2695 | くら寿司 | 43,900 | 3,785.00 | 166,161,500 | 貸付有価証券 2,000株 |

| | | | | | |
|------|------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 2698 | キャンドウ | 13,300 | 2,693.00 | 35,816,900 | |
| 2722 | I Kホールディングス | 5,100 | 368.00 | 1,876,800 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 2726 | パルグループホールディングス | 73,600 | 2,295.00 | 168,912,000 | |
| 2730 | エディオン | 148,400 | 1,590.00 | 235,956,000 | 貸付有価証券 18,400株 |
| 2734 | サーラコーポレーション | 78,700 | 807.00 | 63,510,900 | |
| 2735 | ワッツ | 7,700 | 596.00 | 4,589,200 | |
| 2742 | ハローズ | 17,000 | 4,440.00 | 75,480,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 2752 | フジオフードグループ本社 | 42,000 | 1,442.00 | 60,564,000 | |
| 2753 | あみやき亭 | 9,100 | 4,110.00 | 37,401,000 | |
| 2764 | ひらまつ | 35,800 | 253.00 | 9,057,400 | 貸付有価証券 8,600株 |
| 2791 | 大黒天物産 | 11,500 | 8,270.00 | 95,105,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 2792 | ハニーズホールディングス | 29,600 | 1,627.00 | 48,159,200 | |
| 2796 | ファーマライズホールディングス | 3,500 | 681.00 | 2,383,500 | 貸付有価証券 100株 |
| 3028 | アルペン | 30,900 | 2,031.00 | 62,757,900 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 3030 | ハブ | 5,100 | 743.00 | 3,789,300 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 3034 | クオールホールディングス | 51,500 | 1,782.00 | 91,773,000 | |
| 3046 | ジンズホールディングス | 22,200 | 4,195.00 | 93,129,000 | |
| 3048 | ビックカメラ | 199,400 | 1,345.00 | 268,193,000 | 貸付有価証券 51,100株 |
| 3050 | DCMホールディングス | 198,000 | 1,350.00 | 267,300,000 | |
| 3053 | ペッパーフードサービス | 87,000 | 97.00 | 8,439,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 3064 | Monotaro | 531,300 | 1,439.50 | 764,806,350 | 貸付有価証券 73,600株 |
| 3067 | 東京一番フーズ | 3,600 | 518.00 | 1,864,800 | |
| 3073 | DDグループ | 8,900 | 1,519.00 | 13,519,100 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 3082 | きちりホールディングス | 3,700 | 1,030.00 | 3,811,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 3086 | J. フロント リテイリング | 430,100 | 1,338.00 | 575,473,800 | 貸付有価証券 52,300株 |
| 3087 | ドトール・日レスホールディングス | 66,500 | 2,160.00 | 143,640,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 3088 | マツキヨココカラ&カンパニー | 681,700 | 2,663.00 | 1,815,367,100 | 貸付有価証券 77,400株 |
| 3091 | ブロンコビリー | 22,000 | 3,370.00 | 74,140,000 | |
| 3092 | ZOZO | 238,800 | 3,258.00 | 778,010,400 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|----------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 9,600株 |
| 3093 | トレジャー・ファクトリー | 18,100 | 1,286.00 | 23,276,600 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 3097 | 物語コーポレーション | 62,600 | 5,100.00 | 319,260,000 | |
| 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス | 631,100 | 1,675.00 | 1,057,092,500 | |
| 3134 | H a m e e | 12,900 | 1,129.00 | 14,564,100 | |
| 3135 | マーケットエンタープライズ | 1,600 | 992.00 | 1,587,200 | 貸付有価証券 100株 |
| 3141 | ウエルシアホールディングス | 194,400 | 2,403.00 | 467,143,200 | 貸付有価証券 25,800株 |
| 3148 | クリエイトSDホールディングス | 62,000 | 3,175.00 | 196,850,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 3159 | 丸善CHIホールディングス | 18,700 | 328.00 | 6,133,600 | 貸付有価証券 5,500株 |
| 3169 | ミサワ | 3,300 | 715.00 | 2,359,500 | |
| 3172 | ティーライフ | 2,100 | 1,429.00 | 3,000,900 | |
| 3175 | エー・ピーホールディングス | 3,300 | 961.00 | 3,171,300 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 3178 | チムニー | 4,900 | 1,441.00 | 7,060,900 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 3179 | シュッピン | 33,800 | 1,046.00 | 35,354,800 | |
| 3182 | オイシックス・ラ・大地 | 50,400 | 1,383.00 | 69,703,200 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 3186 | ネクステージ | 85,600 | 2,266.00 | 193,969,600 | 貸付有価証券 9,900株 |
| 3191 | ジョイフル本田 | 109,000 | 1,927.00 | 210,043,000 | 貸付有価証券 4,200株 |
| 3193 | 鳥貴族ホールディングス | 13,900 | 3,755.00 | 52,194,500 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 3196 | ホットランド | 28,700 | 1,933.00 | 55,477,100 | |
| 3197 | すかいらくホールディングス | 512,300 | 2,363.00 | 1,210,564,900 | 貸付有価証券 19,700株 |
| 3198 | SFPホールディングス | 20,500 | 2,104.00 | 43,132,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 3199 | 綿半ホールディングス | 29,000 | 1,442.00 | 41,818,000 | |
| 3221 | ヨシックスホールディングス | 6,700 | 2,974.00 | 19,925,800 | |
| 3222 | ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 104,700 | 1,013.00 | 106,061,100 | 貸付有価証券 12,700株 |
| 3319 | ゴルフダイジェスト・オンライン | 16,900 | 621.00 | 10,494,900 | |
| 3328 | B E E N O S | 15,400 | 1,512.00 | 23,284,800 | |
| 3333 | あさひ | 34,800 | 1,292.00 | 44,961,600 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 3341 | 日本調剤 | 25,500 | 1,408.00 | 35,904,000 | |
| 3349 | コスモス薬品 | 37,100 | 15,665.00 | 581,171,500 | 貸付有価証券 3,800株 |

| | | | | | |
|------|----------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 3361 | トーエル | 7,000 | 789.00 | 5,523,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス | 1,291,600 | 5,803.00 | 7,495,154,800 | |
| 3387 | クリエイト・レストランツ・ホールディング | 253,700 | 1,098.00 | 278,562,600 | 貸付有価証券 23,400株 |
| 3391 | ツルハホールディングス | 78,700 | 12,465.00 | 980,995,500 | |
| 3395 | サンマルクホールディングス | 30,200 | 2,224.00 | 67,164,800 | |
| 3396 | フェリシモ | 3,500 | 922.00 | 3,227,000 | |
| 3397 | トリドールホールディングス | 105,000 | 4,355.00 | 457,275,000 | |
| 3415 | TOKYO BASE | 45,000 | 326.00 | 14,670,000 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 3538 | ウイルプラスホールディングス | 2,600 | 1,012.00 | 2,631,200 | 貸付有価証券 100株 |
| 3539 | JMホールディングス | 28,300 | 2,250.00 | 63,675,000 | |
| 3544 | サツドラホールディングス | 7,200 | 767.00 | 5,522,400 | |
| 3546 | アレンザホールディングス | 28,000 | 1,083.00 | 30,324,000 | |
| 3547 | 串カツ田中ホールディングス | 10,000 | 1,860.00 | 18,600,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 3548 | バロックジャパンリミテッド | 29,100 | 819.00 | 23,832,900 | 貸付有価証券 800株 |
| 3549 | クスリのアオキホールディングス | 100,200 | 3,250.00 | 325,650,000 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 3561 | 力の源ホールディングス | 16,800 | 1,396.00 | 23,452,800 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 3563 | FOOD & LIFE COMPANIE | 199,900 | 2,927.00 | 585,107,300 | |
| 4350 | メディカルシステムネットワーク | 40,600 | 604.00 | 24,522,400 | |
| 7127 | 一家ホールディングス | 3,500 | 699.00 | 2,446,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 7135 | ジャパクラフトホールディングス | 9,200 | 166.00 | 1,527,200 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 7416 | はるやまホールディングス | 7,600 | 590.00 | 4,484,000 | |
| 7419 | ノジマ | 108,700 | 1,856.00 | 201,747,200 | |
| 7421 | カップ・クリエイト | 58,900 | 1,722.00 | 101,425,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 7445 | ライトオン | 12,000 | 415.00 | 4,980,000 | 貸付有価証券 5,800株 |
| 7453 | 良品計画 | 409,100 | 2,282.00 | 933,566,200 | |
| 7455 | パリミキホールディングス | 19,900 | 520.00 | 10,348,000 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 7463 | アドヴァングループ | 35,600 | 1,055.00 | 37,558,000 | |
| 7475 | アルビス | 12,300 | 2,647.00 | 32,558,100 | 貸付有価証券 700株 |
| 7494 | コナカ | 17,300 | 412.00 | 7,127,600 | 貸付有価証券 5,100株 |

| | | | | | |
|------|----------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 7506 | ハウス オブ ローゼ | 2,000 | 1,610.00 | 3,220,000 | |
| 7508 | G-7ホールディングス | 40,900 | 1,252.00 | 51,206,800 | |
| 7512 | イオン北海道 | 110,800 | 946.00 | 104,816,800 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 7513 | コジマ | 61,900 | 745.00 | 46,115,500 | |
| 7514 | ヒマラヤ | 5,100 | 936.00 | 4,773,600 | 貸付有価証券 100株 |
| 7516 | コーナン商事 | 45,900 | 3,880.00 | 178,092,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 7520 | エコス | 13,900 | 2,434.00 | 33,832,600 | |
| 7522 | ワタミ | 39,600 | 1,032.00 | 40,867,200 | |
| 7524 | マルシェ | 5,500 | 246.00 | 1,353,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 7532 | パン・パシフィック・インターナショナルホ | 756,800 | 3,171.00 | 2,399,812,800 | |
| 7545 | 西松屋チェーン | 73,700 | 2,089.00 | 153,959,300 | |
| 7550 | ゼンショーホールディングス | 190,800 | 7,127.00 | 1,359,831,600 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 7554 | 幸楽苑ホールディングス | 27,700 | 1,218.00 | 33,738,600 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 7561 | ハークスレイ | 5,600 | 915.00 | 5,124,000 | |
| 7581 | サイゼリヤ | 55,400 | 5,040.00 | 279,216,000 | |
| 7593 | V Tホールディングス | 142,300 | 526.00 | 74,849,800 | |
| 7596 | 魚力 | 13,100 | 2,316.00 | 30,339,600 | |
| 7601 | ポプラ | 3,600 | 207.00 | 745,200 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 7605 | フジ・コーポレーション | 17,800 | 1,720.00 | 30,616,000 | |
| 7606 | ユナイテッドアローズ | 44,000 | 1,899.00 | 83,556,000 | |
| 7611 | ハイデイ日高 | 55,600 | 2,885.00 | 160,406,000 | 貸付有価証券 10,500株 |
| 7615 | YU-WA Creation Holdi | 8,900 | 145.00 | 1,290,500 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 7616 | コロワイド | 161,200 | 2,286.50 | 368,583,800 | 貸付有価証券 19,700株 |
| 7630 | 壱番屋 | 29,600 | 6,120.00 | 181,152,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 7640 | トップカルチャー | 5,200 | 157.00 | 816,400 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 7646 | P L A N T | 3,600 | 1,705.00 | 6,138,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 7649 | スギホールディングス | 75,500 | 6,929.00 | 523,139,500 | |
| 7679 | 薬王堂ホールディングス | 18,300 | 2,614.00 | 47,836,200 | |
| 7918 | ヴィア・ホールディングス | 22,200 | 154.00 | 3,418,800 | 貸付有価証券 6,400株 |

| | | | | | |
|------|------------------|---------|-----------|-------------|-------------------|
| 8005 | スクロール | 55,800 | 1,012.00 | 56,469,600 | |
| 8008 | ヨンドシーホールディングス | 35,500 | 1,999.00 | 70,964,500 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 8160 | 木曽路 | 56,700 | 2,617.00 | 148,383,900 | |
| 8163 | S R Sホールディングス | 61,800 | 1,181.00 | 72,985,800 | |
| 8165 | 千趣会 | 69,000 | 317.00 | 21,873,000 | 貸付有価証券 7,800株 |
| 8166 | タカキュー | 11,200 | 69.00 | 772,800 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 8167 | リテールパートナーズ | 55,600 | 1,756.00 | 97,633,600 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 8173 | 上新電機 | 37,100 | 2,433.00 | 90,264,300 | |
| 8174 | 日本瓦斯 | 198,600 | 2,340.50 | 464,823,300 | |
| 8179 | ロイヤルホールディングス | 66,000 | 2,579.00 | 170,214,000 | |
| 8181 | 東天紅 | 1,200 | 895.00 | 1,074,000 | |
| 8182 | いなげや | 36,400 | 1,275.00 | 46,410,000 | |
| 8185 | チヨダ | 35,800 | 892.00 | 31,933,600 | |
| 8194 | ライフコーポレーション | 39,300 | 3,720.00 | 146,196,000 | |
| 8200 | リンガーハット | 48,300 | 2,415.00 | 116,644,500 | |
| 8203 | M r M a x HD | 47,200 | 618.00 | 29,169,600 | |
| 8207 | テンアライド | 17,000 | 310.00 | 5,270,000 | 貸付有価証券 8,300株 |
| 8214 | A O K Iホールディングス | 80,300 | 1,160.00 | 93,148,000 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 8217 | オークワ | 53,900 | 881.00 | 47,485,900 | |
| 8218 | コメリ | 57,700 | 3,305.00 | 190,698,500 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 8219 | 青山商事 | 80,100 | 1,761.00 | 141,056,100 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 8227 | しまむら | 44,000 | 16,325.00 | 718,300,000 | |
| 8230 | はせがわ | 7,500 | 368.00 | 2,760,000 | |
| 8233 | 高島屋 | 259,000 | 2,008.00 | 520,072,000 | 貸付有価証券 10,900株 |
| 8237 | 松屋 | 63,500 | 928.00 | 58,928,000 | 貸付有価証券 9,100株 |
| 8242 | エイチ・ツー・オー リテイリング | 165,800 | 1,578.00 | 261,632,400 | 貸付有価証券 27,800株 |
| 8244 | 近鉄百貨店 | 16,100 | 2,517.00 | 40,523,700 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 8252 | 丸井グループ | 248,800 | 2,449.50 | 609,435,600 | 貸付有価証券 10,700株 |
| 8255 | アクシアル リテイリング | 25,600 | 4,090.00 | 104,704,000 | |
| 8260 | 井筒屋 | 7,500 | 355.00 | 2,662,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|-------------------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 2,300株 |
| 8267 | イオン | 1,270,400 | 3,463.00 | 4,399,395,200 | 貸付有価証券 49,000株 |
| 8273 | イズミ | 66,400 | 3,426.00 | 227,486,400 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 8276 | 平和堂 | 62,600 | 2,173.00 | 136,029,800 | 貸付有価証券 8,900株 |
| 8278 | フジ | 57,500 | 1,955.00 | 112,412,500 | 貸付有価証券 7,500株 |
| 8279 | ヤオコー | 42,400 | 8,404.00 | 356,329,600 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 8281 | ゼビオホールディングス | 50,800 | 965.00 | 49,022,000 | |
| 8282 | ケーズホールディングス | 264,700 | 1,319.00 | 349,139,300 | 貸付有価証券 51,600株 |
| 8289 | O l y m p i cグループ | 6,900 | 552.00 | 3,808,800 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 8291 | 日産東京販売ホールディングス | 23,600 | 460.00 | 10,856,000 | 貸付有価証券 6,400株 |
| 9262 | シルバーライフ | 7,200 | 878.00 | 6,321,600 | 貸付有価証券 400株 |
| 9267 | G e n k y D r u g S t o r e s | 16,400 | 6,250.00 | 102,500,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 9275 | ナルミヤ・インターナショナル | 2,600 | 1,221.00 | 3,174,600 | |
| 9278 | ブックオフグループホールディングス | 19,100 | 1,291.00 | 24,658,100 | |
| 9279 | ギフトホールディングス | 15,900 | 2,727.00 | 43,359,300 | |
| 9627 | アインホールディングス | 51,600 | 4,669.00 | 240,920,400 | |
| 9828 | 元気寿司 | 21,200 | 3,550.00 | 75,260,000 | |
| 9831 | ヤマダホールディングス | 1,152,600 | 448.10 | 516,480,060 | |
| 9842 | アークランズ | 111,500 | 1,686.00 | 187,989,000 | 貸付有価証券 12,900株 |
| 9843 | ニトリホールディングス | 136,400 | 18,995.00 | 2,590,918,000 | 貸付有価証券 5,800株 |
| 9850 | グルメ杵屋 | 30,300 | 1,073.00 | 32,511,900 | |
| 9854 | 愛眼 | 11,700 | 185.00 | 2,164,500 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 9856 | ケーユーホールディングス | 17,500 | 1,164.00 | 20,370,000 | |
| 9861 | 吉野家ホールディングス | 138,000 | 3,210.00 | 442,980,000 | 貸付有価証券 8,500株 |
| 9887 | 松屋フーズホールディングス | 17,700 | 5,770.00 | 102,129,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 9900 | サガミホールディングス | 56,200 | 1,515.00 | 85,143,000 | |
| 9919 | 関西フードマーケット | 25,400 | 1,448.00 | 36,779,200 | |
| 9936 | 王将フードサービス | 27,800 | 8,000.00 | 222,400,000 | |
| 9946 | ミニストップ | 27,200 | 1,524.00 | 41,452,800 | |

| | | | | | |
|------|---------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| 9948 | アークス | 68,700 | 2,897.00 | 199,023,900 | 貸付有価証券 11,600株 |
| 9956 | パローホールディングス | 71,500 | 2,470.00 | 176,605,000 | 貸付有価証券 9,600株 |
| 9974 | ベルク | 18,700 | 6,320.00 | 118,184,000 | |
| 9979 | 大庄 | 15,700 | 1,329.00 | 20,865,300 | |
| 9983 | ファーストリテイリング | 168,600 | 38,870.00 | 6,553,482,000 | 貸付有価証券 23,900株 |
| 9989 | サンドラッグ | 126,500 | 4,541.00 | 574,436,500 | |
| 9990 | サックスパーホールディングス | 31,600 | 840.00 | 26,544,000 | |
| 9993 | ヤマザワ | 3,400 | 1,268.00 | 4,311,200 | 貸付有価証券 900株 |
| 9994 | やまや | 3,300 | 3,080.00 | 10,164,000 | |
| 9997 | ベルーナ | 90,200 | 625.00 | 56,375,000 | |
| 5830 | いよぎんホールディングス | 415,100 | 989.40 | 410,699,940 | |
| 5831 | しずおかフィナンシャルグループ | 775,100 | 1,321.00 | 1,023,907,100 | 貸付有価証券 108,100株 |
| 5832 | ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 293,700 | 1,028.50 | 302,070,450 | |
| 5838 | 楽天銀行 | 121,300 | 2,297.00 | 278,626,100 | |
| 5844 | 京都フィナンシャルグループ | 442,000 | 2,369.00 | 1,047,098,000 | |
| 7150 | 島根銀行 | 4,300 | 530.00 | 2,279,000 | |
| 7161 | じもとホールディングス | 11,200 | 551.00 | 6,171,200 | 貸付有価証券 2,900株 |
| 7167 | めぶきフィナンシャルグループ | 1,731,100 | 438.70 | 759,433,570 | |
| 7173 | 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 44,700 | 4,200.00 | 187,740,000 | |
| 7180 | 九州フィナンシャルグループ | 675,200 | 881.80 | 595,391,360 | 貸付有価証券 111,200株 |
| 7182 | ゆうちょ銀行 | 3,833,500 | 1,531.00 | 5,869,088,500 | 貸付有価証券 160,700株 |
| 7184 | 富山第一銀行 | 110,700 | 809.00 | 89,556,300 | |
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,871,800 | 691.70 | 1,294,724,060 | 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 | 196,800 | 1,671.00 | 328,852,800 | |
| 7322 | 三十三フィナンシャルグループ | 31,200 | 1,900.00 | 59,280,000 | |
| 7327 | 第四北越フィナンシャルグループ | 54,800 | 4,020.00 | 220,296,000 | |
| 7337 | ひろぎんホールディングス | 496,500 | 979.10 | 486,123,150 | |
| 7350 | おきなわフィナンシャルグループ | 29,700 | 2,479.00 | 73,626,300 | |
| 7380 | 十六フィナンシャルグループ | 45,200 | 3,955.00 | 178,766,000 | |
| 7381 | 北國フィナンシャルホールディングス | 36,700 | 4,355.00 | 159,828,500 | |
| 7384 | プロクレアホールディングス | 39,900 | 1,890.00 | 75,411,000 | 貸付有価証券 4,600株 |

| | | | | | |
|------|-------------------|------------|----------|----------------|-------------------|
| 7389 | あいちフィナンシャルグループ | 53,700 | 2,555.00 | 137,203,500 | 貸付有価証券 4,100株 |
| 8304 | あおぞら銀行 | 250,700 | 3,207.00 | 803,994,900 | 貸付有価証券 9,700株 |
| 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 21,245,200 | 1,341.00 | 28,489,813,200 | |
| 8308 | りそなホールディングス | 4,067,800 | 798.00 | 3,246,104,400 | |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 1,253,700 | 2,936.50 | 3,681,490,050 | |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 2,480,400 | 7,440.00 | 18,454,176,000 | |
| 8331 | 千葉銀行 | 972,200 | 1,069.00 | 1,039,281,800 | 貸付有価証券 37,500株 |
| 8334 | 群馬銀行 | 677,000 | 718.50 | 486,424,500 | |
| 8336 | 武蔵野銀行 | 48,700 | 2,760.00 | 134,412,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 8337 | 千葉興業銀行 | 57,700 | 856.00 | 49,391,200 | |
| 8338 | 筑波銀行 | 153,100 | 255.00 | 39,040,500 | 貸付有価証券 8,100株 |
| 8341 | 七十七銀行 | 101,500 | 3,560.00 | 361,340,000 | |
| 8343 | 秋田銀行 | 23,400 | 2,000.00 | 46,800,000 | |
| 8344 | 山形銀行 | 38,700 | 1,110.00 | 42,957,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 8345 | 岩手銀行 | 22,100 | 2,570.00 | 56,797,000 | |
| 8346 | 東邦銀行 | 275,900 | 306.00 | 84,425,400 | 貸付有価証券 49,800株 |
| 8349 | 東北銀行 | 7,200 | 1,180.00 | 8,496,000 | |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 303,800 | 3,497.00 | 1,062,388,600 | |
| 8358 | スルガ銀行 | 307,500 | 847.00 | 260,452,500 | 貸付有価証券 74,700株 |
| 8359 | 八十二銀行 | 748,600 | 802.30 | 600,601,780 | |
| 8360 | 山梨中央銀行 | 39,100 | 1,735.00 | 67,838,500 | |
| 8361 | 大垣共立銀行 | 66,500 | 1,951.00 | 129,741,500 | |
| 8362 | 福井銀行 | 31,200 | 1,706.00 | 53,227,200 | |
| 8364 | 清水銀行 | 13,900 | 1,600.00 | 22,240,000 | |
| 8365 | 富山銀行 | 2,500 | 1,735.00 | 4,337,500 | 貸付有価証券 800株 |
| 8366 | 滋賀銀行 | 58,000 | 3,470.00 | 201,260,000 | |
| 8367 | 南都銀行 | 52,500 | 2,629.00 | 138,022,500 | |
| 8368 | 百五銀行 | 328,200 | 571.00 | 187,402,200 | |
| 8370 | 紀陽銀行 | 124,800 | 1,667.00 | 208,041,600 | 貸付有価証券 14,900株 |
| 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ | 215,900 | 1,555.00 | 335,724,500 | 貸付有価証券 500株 |
| 8381 | 山陰合同銀行 | 218,300 | 1,039.00 | 226,813,700 | |

| | | | | | |
|------|--------------------|-----------|----------|----------------|-------------------|
| 8383 | 鳥取銀行 | 5,200 | 1,446.00 | 7,519,200 | |
| 8386 | 百十四銀行 | 34,300 | 2,450.00 | 84,035,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 8387 | 四国銀行 | 51,100 | 1,012.00 | 51,713,200 | |
| 8388 | 阿波銀行 | 48,900 | 2,451.00 | 119,853,900 | |
| 8392 | 大分銀行 | 21,000 | 2,660.00 | 55,860,000 | |
| 8393 | 宮崎銀行 | 21,000 | 2,722.00 | 57,162,000 | |
| 8395 | 佐賀銀行 | 20,400 | 1,945.00 | 39,678,000 | |
| 8399 | 琉球銀行 | 74,200 | 1,142.00 | 84,736,400 | 貸付有価証券 10,100株 |
| 8410 | セブン銀行 | 1,093,500 | 304.70 | 333,189,450 | 貸付有価証券 48,200株 |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 4,708,900 | 2,610.00 | 12,290,229,000 | |
| 8416 | 高知銀行 | 5,100 | 973.00 | 4,962,300 | |
| 8418 | 山口フィナンシャルグループ | 342,100 | 1,370.00 | 468,677,000 | |
| 8522 | 名古屋銀行 | 22,600 | 5,360.00 | 121,136,000 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 8524 | 北洋銀行 | 528,600 | 376.00 | 198,753,600 | |
| 8537 | 大光銀行 | 4,800 | 1,498.00 | 7,190,400 | |
| 8541 | 愛媛銀行 | 47,000 | 1,060.00 | 49,820,000 | |
| 8542 | トマト銀行 | 5,200 | 1,218.00 | 6,333,600 | |
| 8544 | 京葉銀行 | 146,400 | 718.00 | 105,115,200 | |
| 8550 | 栃木銀行 | 174,200 | 312.00 | 54,350,400 | |
| 8551 | 北日本銀行 | 11,400 | 2,246.00 | 25,604,400 | |
| 8558 | 東和銀行 | 64,000 | 632.00 | 40,448,000 | |
| 8562 | 福島銀行 | 15,500 | 239.00 | 3,704,500 | 貸付有価証券 4,100株 |
| 8563 | 大東銀行 | 6,500 | 760.00 | 4,940,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 8600 | トモニホールディングス | 330,100 | 401.00 | 132,370,100 | 貸付有価証券 33,800株 |
| 8713 | フィデアホールディングス | 36,000 | 1,608.00 | 57,888,000 | |
| 8714 | 池田泉州ホールディングス | 483,900 | 334.00 | 161,622,600 | |
| 7148 | F P G | 118,000 | 1,672.00 | 197,296,000 | |
| 7172 | ジャパンインベストメントアドバイザー | 56,800 | 881.00 | 50,040,800 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 7347 | マーキュリアホールディングス | 7,500 | 722.00 | 5,415,000 | |
| 8473 | S B Iホールディングス | 510,900 | 3,568.00 | 1,822,891,200 | 貸付有価証券 19,400株 |
| 8518 | 日本アジア投資 | 10,800 | 279.00 | 3,013,200 | 貸付有価証券 3,700株 |

| | | | | | |
|------|----------------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 8595 | ジャフコ グループ | 104,000 | 1,712.00 | 178,048,000 | |
| 8601 | 大和証券グループ本社 | 2,702,400 | 1,037.00 | 2,802,388,800 | |
| 8604 | 野村ホールディングス | 5,866,600 | 743.20 | 4,360,057,120 | |
| 8609 | 岡三証券グループ | 306,300 | 737.00 | 225,743,100 | 貸付有価証券 9,100株 |
| 8613 | 丸三証券 | 116,100 | 879.00 | 102,051,900 | 貸付有価証券 17,500株 |
| 8614 | 東洋証券 | 92,600 | 319.00 | 29,539,400 | |
| 8616 | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 414,200 | 546.00 | 226,153,200 | |
| 8617 | 光世証券 | 3,400 | 583.00 | 1,982,200 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 8622 | 水戸証券 | 103,000 | 464.00 | 47,792,000 | |
| 8624 | いちよし証券 | 65,300 | 771.00 | 50,346,300 | |
| 8628 | 松井証券 | 171,700 | 821.00 | 140,965,700 | |
| 8698 | マネックスグループ | 341,700 | 748.00 | 255,591,600 | |
| 8706 | 極東証券 | 47,800 | 1,024.00 | 48,947,200 | 貸付有価証券 5,100株 |
| 8707 | 岩井コスモホールディングス | 39,800 | 2,098.00 | 83,500,400 | |
| 8708 | アイザワ証券グループ | 50,400 | 1,201.00 | 60,530,400 | |
| 8732 | マネーパートナーズグループ | 15,500 | 310.00 | 4,805,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 8739 | スパークス・グループ | 38,900 | 1,781.00 | 69,280,900 | |
| 8742 | 小林洋行 | 5,900 | 249.00 | 1,469,100 | 貸付有価証券 100株 |
| 7181 | かんぽ生命保険 | 355,300 | 2,668.50 | 948,118,050 | |
| 7388 | F P パートナー | 6,900 | 5,920.00 | 40,848,000 | |
| 8630 | SOMPOホールディングス | 524,800 | 7,491.00 | 3,931,276,800 | |
| 8715 | アニコム ホールディングス | 118,500 | 582.00 | 68,967,000 | 貸付有価証券 14,400株 |
| 8725 | MS & ADインシュアランスグループ ホール | 781,100 | 5,953.00 | 4,649,888,300 | 貸付有価証券 114,100株 |
| 8750 | 第一生命ホールディングス | 1,704,600 | 3,148.00 | 5,366,080,800 | 貸付有価証券 8,400株 |
| 8766 | 東京海上ホールディングス | 3,448,300 | 3,733.00 | 12,872,503,900 | 貸付有価証券 61,100株 |
| 8795 | T & Dホールディングス | 936,800 | 2,356.50 | 2,207,569,200 | 貸付有価証券 90,600株 |
| 8798 | アドバンスクリエイト | 20,200 | 1,043.00 | 21,068,600 | |
| 7164 | 全国保証 | 91,200 | 5,450.00 | 497,040,000 | 貸付有価証券 3,600株 |
| 7183 | あんしん保証 | 6,400 | 242.00 | 1,548,800 | 貸付有価証券 1,600株 |

| | | | | | |
|------|---------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| 7187 | ジェイリース | 9,100 | 2,356.00 | 21,439,600 | |
| 7191 | イントラスト | 5,700 | 844.00 | 4,810,800 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 7192 | 日本モーゲージサービス | 8,300 | 523.00 | 4,340,900 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 7196 | C a s a | 5,800 | 911.00 | 5,283,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 7198 | S B I アルヒ | 33,500 | 857.00 | 28,709,500 | |
| 7199 | プレミアグループ | 58,800 | 1,789.00 | 105,193,200 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 7383 | ネットプロテクションズホールディングス | 115,500 | 183.00 | 21,136,500 | |
| 8253 | クレディセゾン | 221,100 | 2,760.00 | 610,236,000 | 貸付有価証券 39,200株 |
| 8424 | 芙蓉総合リース | 32,100 | 12,985.00 | 416,818,500 | |
| 8425 | みずほリース | 58,400 | 5,280.00 | 308,352,000 | |
| 8439 | 東京センチュリー | 260,700 | 1,609.00 | 419,466,300 | 貸付有価証券 19,000株 |
| 8511 | 日本証券金融 | 128,200 | 1,557.00 | 199,607,400 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 8515 | アイフル | 513,500 | 373.00 | 191,535,500 | 貸付有価証券 66,600株 |
| 8566 | リコーリース | 33,100 | 5,050.00 | 167,155,000 | |
| 8570 | イオンフィナンシャルサービス | 200,300 | 1,316.00 | 263,594,800 | |
| 8572 | アコム | 622,300 | 369.90 | 230,188,770 | |
| 8584 | ジャックス | 37,200 | 5,720.00 | 212,784,000 | |
| 8585 | オリエントコーポレーション | 113,800 | 1,114.00 | 126,773,200 | 貸付有価証券 15,300株 |
| 8591 | オリックス | 2,126,400 | 2,820.00 | 5,996,448,000 | |
| 8593 | 三菱HCキャピタル | 1,554,500 | 1,017.50 | 1,581,703,750 | |
| 8596 | 九州リースサービス | 6,000 | 1,150.00 | 6,900,000 | |
| 8697 | 日本取引所グループ | 910,200 | 3,164.00 | 2,879,872,800 | 貸付有価証券 28,000株 |
| 8771 | イー・ギャランティ | 56,700 | 2,012.00 | 114,080,400 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 8772 | アサックス | 6,800 | 737.00 | 5,011,600 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 8793 | NECキャピタルソリューション | 17,100 | 3,650.00 | 62,415,000 | |
| 1435 | R o b o t H o m e | 96,600 | 172.00 | 16,615,200 | 貸付有価証券 12,200株 |
| 1878 | 大東建託 | 127,800 | 16,150.00 | 2,063,970,000 | |
| 2337 | いちご | 401,700 | 376.00 | 151,039,200 | |
| 2353 | 日本駐車場開発 | 369,200 | 189.00 | 69,778,800 | 貸付有価証券 47,900株 |

| | | | | | |
|------|-------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 2975 | スター・マイカ・ホールディングス | 40,500 | 600.00 | 24,300,000 | |
| 2980 | S R Eホールディングス | 15,000 | 2,746.00 | 41,190,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 2982 | A Dワークスグループ | 37,400 | 230.00 | 8,602,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 3003 | ヒューリック | 813,700 | 1,544.50 | 1,256,759,650 | 貸付有価証券 31,400株 |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス | 194,100 | 3,933.00 | 763,395,300 | 貸付有価証券 35,100株 |
| 3232 | 三重交通グループホールディングス | 74,600 | 624.00 | 46,550,400 | |
| 3244 | サムティ | 55,500 | 2,497.00 | 138,583,500 | |
| 3245 | ディア・ライフ | 59,500 | 1,003.00 | 59,678,500 | |
| 3246 | コーセーアールイー | 4,700 | 1,126.00 | 5,292,200 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 3252 | 地主 | 26,600 | 2,291.00 | 60,940,600 | |
| 3254 | プレサンスコーポレーション | 55,300 | 1,644.00 | 90,913,200 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 3271 | T H Eグローバル社 | 8,600 | 397.00 | 3,414,200 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 3275 | ハウスコム | 2,400 | 915.00 | 2,196,000 | |
| 3276 | J P M C | 20,200 | 1,160.00 | 23,432,000 | |
| 3277 | サンセイランディック | 4,400 | 1,039.00 | 4,571,600 | |
| 3280 | エストラスト | 1,500 | 642.00 | 963,000 | |
| 3284 | フージャースホールディングス | 53,800 | 1,137.00 | 61,170,600 | |
| 3288 | オープンハウスグループ | 127,800 | 4,490.00 | 573,822,000 | 貸付有価証券 12,600株 |
| 3289 | 東急不動産ホールディングス | 1,048,800 | 981.30 | 1,029,187,440 | 貸付有価証券 40,500株 |
| 3291 | 飯田グループホールディングス | 334,300 | 2,242.00 | 749,500,600 | 貸付有価証券 40,100株 |
| 3294 | イーランド | 2,200 | 1,563.00 | 3,438,600 | |
| 3299 | ムゲンエステート | 9,900 | 1,103.00 | 10,919,700 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 3452 | ビーロット | 10,100 | 1,017.00 | 10,271,700 | |
| 3454 | ファーストブラザーズ | 2,900 | 1,264.00 | 3,665,600 | |
| 3457 | A n d D oホールディングス | 21,100 | 1,103.00 | 23,273,300 | |
| 3458 | シーアールイー | 19,400 | 1,435.00 | 27,839,000 | |
| 3465 | ケイアイスター不動産 | 16,800 | 3,490.00 | 58,632,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 3467 | アグレ都市デザイン | 2,700 | 1,626.00 | 4,390,200 | |
| 3475 | グッドコムアセット | 32,400 | 750.00 | 24,300,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 3480 | ジェイ・エス・ビー | 17,300 | 2,610.00 | 45,153,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| | | | | | 1,900株 |
| 3482 | ロードスターキャピタル | 22,700 | 1,967.00 | 44,650,900 | |
| 3484 | テンポイノベーション | 4,400 | 1,015.00 | 4,466,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 3486 | グローバル・リンク・マネジメント | 2,700 | 2,491.00 | 6,725,700 | |
| 3489 | フェイスネットワーク | 4,000 | 1,593.00 | 6,372,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 3498 | 霞ヶ関キャピタル | 9,500 | 11,650.00 | 110,675,000 | |
| 4666 | パーク24 | 226,600 | 1,865.50 | 422,722,300 | 貸付有価証券 32,200株 |
| 4809 | バラカ | 12,300 | 1,911.00 | 23,505,300 | |
| 5535 | ミガロホールディングス | 2,900 | 1,420.00 | 4,118,000 | |
| 6620 | 宮越ホールディングス | 15,900 | 1,143.00 | 18,173,700 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 8801 | 三井不動産 | 1,613,300 | 3,642.00 | 5,875,638,600 | |
| 8802 | 三菱地所 | 2,280,400 | 2,026.50 | 4,621,230,600 | 貸付有価証券 295,800株 |
| 8803 | 平和不動産 | 56,600 | 3,905.00 | 221,023,000 | |
| 8804 | 東京建物 | 304,800 | 2,212.50 | 674,370,000 | |
| 8818 | 京阪神ビルディング | 65,200 | 1,450.00 | 94,540,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 8830 | 住友不動産 | 504,500 | 4,548.00 | 2,294,466,000 | 貸付有価証券 24,300株 |
| 8841 | テーオーシー | 62,200 | 688.00 | 42,793,600 | |
| 8842 | 東京楽天地 | 5,700 | 6,700.00 | 38,190,000 | |
| 8848 | レオパレス21 | 349,000 | 405.00 | 141,345,000 | |
| 8850 | スターツコーポレーション | 50,100 | 3,010.00 | 150,801,000 | |
| 8860 | フジ住宅 | 43,900 | 709.00 | 31,125,100 | |
| 8864 | 空港施設 | 49,100 | 622.00 | 30,540,200 | |
| 8869 | 明和地所 | 17,400 | 1,333.00 | 23,194,200 | |
| 8871 | ゴールドクレスト | 28,400 | 2,375.00 | 67,450,000 | |
| 8877 | エスリード | 16,400 | 3,510.00 | 57,564,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 8881 | 日神グループホールディングス | 56,000 | 521.00 | 29,176,000 | |
| 8892 | 日本エスコン | 65,300 | 965.00 | 63,014,500 | 貸付有価証券 7,900株 |
| 8897 | MIRARTHホールディングス | 160,300 | 493.00 | 79,027,900 | |
| 8904 | AVANTIA | 7,900 | 896.00 | 7,078,400 | |
| 8905 | イオンモール | 180,900 | 1,791.00 | 323,991,900 | 貸付有価証券 21,900株 |
| 8908 | 毎日コムネット | 5,400 | 777.00 | 4,195,800 | 貸付有価証券 1,000株 |

| | | | | | |
|------|-------------------|-----------|----------|-------------|-------------------|
| 8917 | ファースト住建 | 5,900 | 1,109.00 | 6,543,100 | 貸付有価証券 800株 |
| 8918 | ランド | 1,908,700 | 7.00 | 13,360,900 | |
| 8919 | カチタス | 93,800 | 1,919.00 | 180,002,200 | |
| 8923 | トーセイ | 58,000 | 2,145.00 | 124,410,000 | |
| 8928 | 穴吹興産 | 2,800 | 2,115.00 | 5,922,000 | |
| 8934 | サンフロンティア不動産 | 51,700 | 1,754.00 | 90,681,800 | |
| 8935 | F Jネクストホールディングス | 36,700 | 1,202.00 | 44,113,400 | |
| 8940 | インテリックス | 3,500 | 575.00 | 2,012,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 8944 | ランドビジネス | 5,400 | 271.00 | 1,463,400 | |
| 8945 | サンネクスタグループ | 4,300 | 958.00 | 4,119,400 | |
| 8999 | グランディハウス | 22,900 | 657.00 | 15,045,300 | |
| 9706 | 日本空港ビルデング | 123,400 | 5,804.00 | 716,213,600 | |
| 1717 | 明豊ファシリティワークス | 7,500 | 877.00 | 6,577,500 | |
| 2120 | L I F U L L | 124,500 | 201.00 | 25,024,500 | |
| 2121 | M I X I | 78,100 | 2,543.00 | 198,608,300 | |
| 2124 | ジェイエイシーリクルートメント | 131,600 | 674.00 | 88,698,400 | |
| 2127 | 日本M&Aセンターホールディングス | 580,200 | 755.20 | 438,167,040 | 貸付有価証券 64,000株 |
| 2130 | メンバーズ | 12,400 | 998.00 | 12,375,200 | |
| 2139 | 中広 | 2,500 | 417.00 | 1,042,500 | |
| 2146 | U Tグループ | 46,900 | 2,381.00 | 111,668,900 | |
| 2148 | アイティメディア | 13,800 | 1,058.00 | 14,600,400 | |
| 2150 | ケアネット | 55,900 | 821.00 | 45,893,900 | |
| 2153 | E・Jホールディングス | 21,300 | 1,725.00 | 36,742,500 | |
| 2154 | オープンアップグループ | 109,200 | 2,233.00 | 243,843,600 | 貸付有価証券 200株 |
| 2157 | コシダカホールディングス | 109,000 | 1,001.00 | 109,109,000 | |
| 2163 | アルトナー | 3,900 | 2,270.00 | 8,853,000 | |
| 2168 | パソナグループ | 44,200 | 2,739.00 | 121,063,800 | |
| 2169 | C D S | 3,800 | 1,700.00 | 6,460,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 2170 | リンクアンドモチベーション | 104,800 | 566.00 | 59,316,800 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 2175 | エス・エム・エス | 127,600 | 2,657.00 | 339,033,200 | |
| 2180 | サニーサイドアップグループ | 4,600 | 586.00 | 2,695,600 | |
| 2181 | パーソルホールディングス | 3,706,800 | 235.20 | 871,839,360 | |
| 2183 | リニカル | 9,100 | 523.00 | 4,759,300 | |

| | | | | | |
|------|------------------|---------|----------|---------------|--------------------|
| 2193 | クックパッド | 99,600 | 117.00 | 11,653,200 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 2196 | エスクリ | 6,300 | 294.00 | 1,852,200 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 2198 | アイ・ケイ・ケイホールディングス | 7,500 | 723.00 | 5,422,500 | |
| 2301 | 学情 | 18,500 | 1,769.00 | 32,726,500 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 2305 | スタジオアリス | 18,200 | 2,103.00 | 38,274,600 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 2309 | シミックホールディングス | 17,500 | 2,643.00 | 46,252,500 | |
| 2311 | エプロコ | 3,500 | 959.00 | 3,356,500 | |
| 2325 | N J S | 8,000 | 2,767.00 | 22,136,000 | |
| 2331 | 総合警備保障 | 608,200 | 795.70 | 483,944,740 | 貸付有価証券 24,700株 |
| 2371 | カカクコム | 240,500 | 1,694.00 | 407,407,000 | 貸付有価証券 10,300株 |
| 2372 | アイロムグループ | 14,700 | 2,056.00 | 30,223,200 | |
| 2374 | セントケア・ホールディング | 26,500 | 957.00 | 25,360,500 | |
| 2376 | サイネックス | 2,700 | 842.00 | 2,273,400 | 貸付有価証券 700株 |
| 2378 | ルネサンス | 28,300 | 919.00 | 26,007,700 | |
| 2379 | ディップ | 55,800 | 2,603.00 | 145,247,400 | |
| 2389 | デジタルホールディングス | 18,900 | 1,262.00 | 23,851,800 | |
| 2395 | 新日本科学 | 33,100 | 1,748.00 | 57,858,800 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 2410 | キャリアデザインセンター | 3,200 | 2,056.00 | 6,579,200 | |
| 2412 | ベネフィット・ワン | 126,500 | 2,130.00 | 269,445,000 | |
| 2413 | エムスリー | 719,600 | 2,379.00 | 1,711,928,400 | 貸付有価証券 120,900株 |
| 2418 | ツカダ・グローバルホールディング | 10,000 | 389.00 | 3,890,000 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 2424 | プラス | 1,800 | 762.00 | 1,371,600 | 貸付有価証券 500株 |
| 2427 | アウトソーシング | 233,700 | 1,743.50 | 407,455,950 | |
| 2428 | ウェルネット | 11,800 | 570.00 | 6,726,000 | |
| 2429 | ワールドホールディングス | 16,400 | 2,969.00 | 48,691,600 | |
| 2432 | ディー・エヌ・エー | 129,400 | 1,519.50 | 196,623,300 | 貸付有価証券 20,900株 |
| 2433 | 博報堂D Yホールディングス | 464,400 | 1,136.50 | 527,790,600 | |
| 2440 | ぐるなび | 67,800 | 275.00 | 18,645,000 | 貸付有価証券 7,300株 |
| 2445 | タカミヤ | 49,400 | 484.00 | 23,909,600 | |
| 2453 | ジャパンベストレスキューシステム | 18,100 | 997.00 | 18,045,700 | |

| | | | | | |
|------|-----------------------|-----------|----------|----------------|-------------------|
| 2461 | ファンコミュニケーションズ | 51,000 | 402.00 | 20,502,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 2462 | ライク | 13,600 | 1,519.00 | 20,658,400 | 貸付有価証券 900株 |
| 2464 | A o b a - B B T | 5,800 | 411.00 | 2,383,800 | |
| 2471 | エスプール | 104,700 | 318.00 | 33,294,600 | |
| 2475 | WDBホールディングス | 18,600 | 2,315.00 | 43,059,000 | |
| 2485 | ティア | 9,200 | 466.00 | 4,287,200 | |
| 2487 | CDG | 1,700 | 1,225.00 | 2,082,500 | |
| 2489 | アドウェイズ | 50,100 | 511.00 | 25,601,100 | 貸付有価証券 7,400株 |
| 2491 | バリューコマース | 32,000 | 1,562.00 | 49,984,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 2492 | インフォマート | 378,000 | 414.00 | 156,492,000 | |
| 2749 | J Pホールディングス | 93,100 | 456.00 | 42,453,600 | |
| 3521 | エコナックホールディングス | 13,400 | 134.00 | 1,795,600 | 貸付有価証券 3,800株 |
| 4286 | CLホールディングス | 8,600 | 926.00 | 7,963,600 | |
| 4290 | プレステージ・インターナショナル | 170,400 | 599.00 | 102,069,600 | 貸付有価証券 19,600株 |
| 4301 | アミューズ | 22,200 | 1,550.00 | 34,410,000 | |
| 4310 | ドリームインキュベータ | 12,500 | 3,315.00 | 41,437,500 | |
| 4318 | クイック | 25,300 | 2,520.00 | 63,756,000 | |
| 4319 | T A C | 7,600 | 198.00 | 1,504,800 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 4324 | 電通グループ | 357,900 | 3,972.00 | 1,421,578,800 | 貸付有価証券 45,300株 |
| 4331 | テイクアンドギヴ・ニーズ | 12,200 | 1,215.00 | 14,823,000 | |
| 4337 | びあ | 12,400 | 3,340.00 | 41,416,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 4343 | イオンファンタジー | 13,100 | 2,515.00 | 32,946,500 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 4345 | シーティーエス | 46,000 | 686.00 | 31,556,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 4346 | N E X Y Z . G r o u p | 4,800 | 723.00 | 3,470,400 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 4544 | H. U. グループホールディングス | 106,600 | 2,704.50 | 288,299,700 | 貸付有価証券 15,600株 |
| 4641 | アルプス技研 | 34,600 | 2,884.00 | 99,786,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 4651 | サニックス | 58,300 | 300.00 | 17,490,000 | |
| 4658 | 日本空調サービス | 39,100 | 837.00 | 32,726,700 | |
| 4661 | オリエンタルランド | 1,927,000 | 5,448.00 | 10,498,296,000 | 貸付有価証券 74,300株 |

| | | | | | |
|------|------------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 4665 | ダスキン | 81,100 | 3,400.00 | 275,740,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 4668 | 明光ネットワークジャパン | 44,200 | 723.00 | 31,956,600 | |
| 4671 | ファルコホールディングス | 16,400 | 2,190.00 | 35,916,000 | |
| 4678 | 秀英予備校 | 3,500 | 301.00 | 1,053,500 | |
| 4679 | 田谷 | 2,600 | 417.00 | 1,084,200 | 貸付有価証券 200株 |
| 4680 | ラウンドワン | 342,600 | 644.00 | 220,634,400 | |
| 4681 | リゾートトラスト | 158,100 | 2,506.50 | 396,277,650 | |
| 4694 | ビー・エム・エル | 44,800 | 2,844.00 | 127,411,200 | |
| 4714 | リゾー教育 | 186,200 | 243.00 | 45,246,600 | 貸付有価証券 19,400株 |
| 4718 | 早稲田アカデミー | 20,100 | 1,687.00 | 33,908,700 | |
| 4732 | ユー・エス・エス | 408,500 | 2,816.50 | 1,150,540,250 | 貸付有価証券 43,400株 |
| 4745 | 東京個別指導学院 | 43,100 | 446.00 | 19,222,600 | |
| 4751 | サイバーエージェント | 804,600 | 951.30 | 765,415,980 | 貸付有価証券 31,000株 |
| 4755 | 楽天グループ | 3,120,500 | 684.70 | 2,136,606,350 | 貸付有価証券 423,600株 |
| 4763 | クリーク・アンド・リバー社 | 18,300 | 1,955.00 | 35,776,500 | |
| 4765 | SBIグローバルアセットマネジメン ト | 71,300 | 640.00 | 45,632,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 4767 | テー・オー・ダブリュー | 71,400 | 332.00 | 23,704,800 | |
| 4792 | 山田コンサルティンググループ | 15,800 | 1,768.00 | 27,934,400 | |
| 4801 | セントラルスポーツ | 13,700 | 2,488.00 | 34,085,600 | |
| 4848 | フルキャストホールディングス | 34,800 | 1,808.00 | 62,918,400 | |
| 4849 | エン・ジャパン | 59,300 | 2,678.00 | 158,805,400 | |
| 5261 | リゾルホールディングス | 1,300 | 5,970.00 | 7,761,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 6028 | テクノプロ・ホールディングス | 213,200 | 3,505.00 | 747,266,000 | |
| 6029 | アトラグループ | 3,600 | 184.00 | 662,400 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 6035 | アイ・アールジャパンホールディング ス | 18,900 | 1,555.00 | 29,389,500 | |
| 6036 | Ke e P e r 技研 | 22,500 | 6,380.00 | 143,550,000 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 6037 | ファーストロジック | 3,500 | 518.00 | 1,813,000 | |
| 6044 | 三機サービス | 2,300 | 1,428.00 | 3,284,400 | |
| 6047 | G u n o s y | 28,900 | 694.00 | 20,056,600 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 6048 | デザインワン・ジャパン | 3,800 | 139.00 | 528,200 | 貸付有価証券 800株 |

| | | | | | |
|------|---------------------|-----------|----------|----------------|--------------------|
| 6050 | イー・ガーディアン | 13,800 | 1,593.00 | 21,983,400 | |
| 6054 | リブセンス | 7,100 | 248.00 | 1,760,800 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 6055 | ジャパンマテリアル | 111,400 | 2,500.00 | 278,500,000 | 貸付有価証券 4,200株 |
| 6058 | ベクトル | 44,700 | 1,200.00 | 53,640,000 | |
| 6059 | ウチヤマホールディングス | 6,600 | 381.00 | 2,514,600 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 6062 | チャーム・ケア・コーポレーション | 30,300 | 1,199.00 | 36,329,700 | |
| 6070 | キャリアリンク | 13,300 | 2,566.00 | 34,127,800 | |
| 6071 | I B J | 27,800 | 706.00 | 19,626,800 | 貸付有価証券 2,900株 |
| 6073 | アサンテ | 18,000 | 1,685.00 | 30,330,000 | |
| 6078 | バリューHR | 31,800 | 1,454.00 | 46,237,200 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 6080 | M&Aキャピタルパートナーズ | 29,400 | 2,411.00 | 70,883,400 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 6082 | ライドオンエクスプレスホールディングス | 14,400 | 1,028.00 | 14,803,200 | |
| 6083 | E R Iホールディングス | 3,900 | 1,782.00 | 6,949,800 | |
| 6087 | アビスト | 2,400 | 3,100.00 | 7,440,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 6088 | シグマクシス・ホールディングス | 49,100 | 1,368.00 | 67,168,800 | |
| 6089 | ウィルグループ | 30,400 | 1,193.00 | 36,267,200 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 6093 | エスクロー・エージェント・ジャパン | 17,100 | 140.00 | 2,394,000 | |
| 6095 | メドピア | 32,000 | 702.00 | 22,464,000 | |
| 6096 | レアジョブ | 2,900 | 909.00 | 2,636,100 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6098 | リクルートホールディングス | 2,695,800 | 5,896.00 | 15,894,436,800 | |
| 6099 | エラン | 48,200 | 1,021.00 | 49,212,200 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 6171 | 土木管理総合試験所 | 6,700 | 327.00 | 2,190,900 | |
| 6178 | 日本郵政 | 4,278,900 | 1,396.00 | 5,973,344,400 | 貸付有価証券 168,700株 |
| 6183 | ベルシステム24ホールディングス | 39,100 | 1,772.00 | 69,285,200 | |
| 6184 | 鎌倉新書 | 31,000 | 613.00 | 19,003,000 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 6185 | SMN | 2,900 | 293.00 | 849,700 | |
| 6186 | 一蔵 | 2,000 | 616.00 | 1,232,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 6189 | グローバルキッズCOMPANY | 2,500 | 658.00 | 1,645,000 | |
| 6191 | エアトリ | 26,700 | 1,805.00 | 48,193,500 | 貸付有価証券 1,900株 |

| | | | | | |
|------|-----------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| 6194 | アトラエ | 21,500 | 700.00 | 15,050,000 | |
| 6196 | ストライク | 15,400 | 4,550.00 | 70,070,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 6197 | ソラスト | 100,400 | 590.00 | 59,236,000 | |
| 6199 | セラク | 11,100 | 1,183.00 | 13,131,300 | |
| 6200 | インソース | 79,000 | 836.00 | 66,044,000 | |
| 6532 | ベイカレント・コンサルティング | 267,600 | 3,465.00 | 927,234,000 | 貸付有価証券 26,000株 |
| 6533 | Orchestra Holdings | 7,800 | 1,012.00 | 7,893,600 | |
| 6535 | アイモバイル | 48,600 | 456.00 | 22,161,600 | |
| 6538 | キャリアインデックス | 5,200 | 210.00 | 1,092,000 | |
| 6539 | MS-Japan | 11,600 | 1,221.00 | 14,163,600 | 貸付有価証券 300株 |
| 6540 | 船場 | 2,700 | 863.00 | 2,330,100 | 貸付有価証券 700株 |
| 6544 | ジャパンエレベーターサービスホールディング | 118,000 | 2,230.00 | 263,140,000 | |
| 6546 | フルテック | 2,100 | 1,151.00 | 2,417,100 | 貸付有価証券 300株 |
| 6547 | グリーンズ | 5,600 | 1,964.00 | 10,998,400 | |
| 6551 | ツナググループ・ホールディングス | 4,300 | 898.00 | 3,861,400 | |
| 6552 | GameWith | 4,600 | 339.00 | 1,559,400 | 貸付有価証券 900株 |
| 6555 | MS&Consulting | 2,000 | 610.00 | 1,220,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 6556 | ウェルビー | 18,300 | 848.00 | 15,518,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 6560 | エル・ティー・エス | 4,200 | 2,954.00 | 12,406,800 | |
| 6564 | ミダックホールディングス | 22,100 | 1,885.00 | 41,658,500 | 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 | 17,400 | 1,523.00 | 26,500,200 | |
| 6572 | RPAホールディングス | 49,300 | 258.00 | 12,719,400 | |
| 7030 | スプリックス | 4,400 | 822.00 | 3,616,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 7033 | マネジメントソリューションズ | 15,600 | 3,025.00 | 47,190,000 | |
| 7034 | プロレド・パートナーズ | 8,900 | 357.00 | 3,177,300 | |
| 7035 | and factory | 4,500 | 330.00 | 1,485,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 7037 | テノ.ホールディングス | 2,000 | 509.00 | 1,018,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 7038 | フロンティア・マネジメント | 9,100 | 1,553.00 | 14,132,300 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 7044 | ピアラ | 2,700 | 297.00 | 801,900 | 貸付有価証券 700株 |

| | | | | | |
|------|--------------------|---------|-----------|-------------|-------------------|
| 7059 | コプロ・ホールディングス | 5,100 | 1,615.00 | 8,236,500 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 7060 | ギークス | 2,000 | 501.00 | 1,002,000 | |
| 7071 | アンビスホールディングス | 39,000 | 2,706.00 | 105,534,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 7085 | カーブスホールディングス | 99,500 | 698.00 | 69,451,000 | |
| 7088 | フォーラムエンジニアリング | 49,500 | 805.00 | 39,847,500 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 7092 | Fast Fitness Japan | 12,400 | 1,100.00 | 13,640,000 | 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 | 37,500 | 447.00 | 16,762,500 | |
| 7358 | ポピンズ | 5,400 | 1,145.00 | 6,183,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 7366 | LITALICO | 28,400 | 1,869.00 | 53,079,600 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 7374 | コンフィデンス・インターワークス | 1,800 | 1,625.00 | 2,925,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 8769 | アドバンテッジリスクマネジメント | 7,900 | 462.00 | 3,649,800 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 8876 | リログループ | 182,400 | 1,560.50 | 284,635,200 | 貸付有価証券 16,500株 |
| 8920 | 東祥 | 25,400 | 919.00 | 23,342,600 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 9161 | ID&Eホールディングス | 22,000 | 3,510.00 | 77,220,000 | |
| 9216 | ビーウィズ | 9,200 | 1,931.00 | 17,765,200 | 貸付有価証券 400株 |
| 9247 | TREホールディングス | 69,700 | 1,276.00 | 88,937,200 | |
| 9248 | 人・夢・技術グループ | 13,700 | 1,865.00 | 25,550,500 | |
| 9332 | NISSOホールディングス | 31,500 | 843.00 | 26,554,500 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 9336 | 大栄環境 | 66,200 | 2,584.00 | 171,060,800 | 貸付有価証券 800株 |
| 9347 | 日本管財ホールディングス | 38,200 | 2,615.00 | 99,893,000 | |
| 9552 | M&A総研ホールディングス | 17,500 | 4,700.00 | 82,250,000 | |
| 9603 | エイチ・アイ・エス | 105,800 | 1,775.00 | 187,795,000 | 貸付有価証券 6,600株 |
| 9612 | ラックランド | 16,500 | 2,601.00 | 42,916,500 | 貸付有価証券 800株 |
| 9616 | 共立メンテナンス | 57,100 | 5,966.00 | 340,658,600 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 9619 | イチネンホールディングス | 38,600 | 1,551.00 | 59,868,600 | |
| 9621 | 建設技術研究所 | 18,800 | 5,900.00 | 110,920,000 | |
| 9622 | スペース | 23,800 | 940.00 | 22,372,000 | |
| 9628 | 燦ホールディングス | 34,100 | 1,119.00 | 38,157,900 | |
| 9632 | スバル興業 | 2,000 | 15,530.00 | 31,060,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|------|--------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| | | | | | 100株 |
| 9633 | 東京テアトル | 5,700 | 1,120.00 | 6,384,000 | |
| 9644 | タナベコンサルティンググループ | 11,000 | 1,049.00 | 11,539,000 | |
| 9663 | ナガワ | 11,400 | 7,330.00 | 83,562,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 9672 | 東京都競馬 | 30,500 | 4,605.00 | 140,452,500 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 9675 | 常磐興産 | 5,700 | 1,232.00 | 7,022,400 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 9678 | カナモト | 56,400 | 2,860.00 | 161,304,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 9699 | ニシオホールディングス | 33,800 | 4,005.00 | 135,369,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 9704 | アゴーラ ホスピタリティー グループ | 90,100 | 23.00 | 2,072,300 | 貸付有価証券 27,100株 |
| 9715 | トランス・コスモス | 45,200 | 3,125.00 | 141,250,000 | |
| 9716 | 乃村工藝社 | 158,800 | 867.00 | 137,679,600 | 貸付有価証券 6,200株 |
| 9722 | 藤田観光 | 14,600 | 6,300.00 | 91,980,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 9726 | KNT-CTホールディングス | 21,700 | 1,346.00 | 29,208,200 | 貸付有価証券 800株 |
| 9729 | トーカイ | 32,200 | 2,095.00 | 67,459,000 | |
| 9731 | 白洋舎 | 1,500 | 2,734.00 | 4,101,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 9735 | セコム | 370,800 | 10,625.00 | 3,939,750,000 | 貸付有価証券 59,200株 |
| 9740 | セントラル警備保障 | 19,600 | 2,511.00 | 49,215,600 | |
| 9743 | 丹青社 | 70,600 | 864.00 | 60,998,400 | |
| 9744 | メイテックグループホールディングス | 131,100 | 2,892.00 | 379,141,200 | |
| 9755 | 応用地質 | 34,000 | 2,211.00 | 75,174,000 | |
| 9757 | 船井総研ホールディングス | 75,800 | 2,611.00 | 197,913,800 | |
| 9760 | 進学会ホールディングス | 4,100 | 255.00 | 1,045,500 | |
| 9765 | オオバ | 9,600 | 1,001.00 | 9,609,600 | |
| 9768 | いであ | 3,500 | 1,796.00 | 6,286,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 9769 | 学究社 | 14,500 | 2,040.00 | 29,580,000 | |
| 9783 | ベネッセホールディングス | 122,400 | 2,604.00 | 318,729,600 | |
| 9787 | イオンディライト | 39,100 | 3,700.00 | 144,670,000 | |
| 9788 | ナック | 15,400 | 1,061.00 | 16,339,400 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 9793 | ダイセキ | 74,300 | 4,200.00 | 312,060,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 9795 | ステップ | 13,200 | 1,987.00 | 26,228,400 | |

| | | |
|-----|-------------|-------------------|
| 合 計 | 547,528,400 | 1,255,140,150,820 |
|-----|-------------|-------------------|

(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1月26日現在]

| | |
|-------------|-------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 53,562,175,962 |
| コール・ローン | 7,942,118,152 |
| 株式 | 3,915,150,753,773 |
| 投資証券 | 78,801,918,919 |
| 派生商品評価勘定 | 2,144,928,159 |
| 未収入金 | 7,309,679 |
| 未収配当金 | 2,490,415,177 |
| 差入委託証拠金 | 57,271,124,409 |
| 流動資産合計 | 4,117,370,744,230 |
| 資産合計 | 4,117,370,744,230 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 44,762,205 |
| 未払金 | 179,160,593 |
| 未払解約金 | 1,097,566,801 |
| 未払利息 | 2,030 |
| 流動負債合計 | 1,321,491,629 |
| 負債合計 | 1,321,491,629 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 660,378,109,832 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 3,455,671,142,769 |
| 元本等合計 | 4,116,049,252,601 |
| 純資産合計 | 4,116,049,252,601 |
| 負債純資産合計 | 4,117,370,744,230 |

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1月26日現在] |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2023年1月27日 |
| 期首元本額 | 447,735,229,199円 |
| 期中追加設定元本額 | 293,510,844,137円 |
| 期中一部解約元本額 | 80,867,963,504円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 191,895,316円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 939,715,115円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 872,534,140円 |
| MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信 | 2,959,119,871円 |
| MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信 | 5,100,071,838円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 1,450,762,967円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 8,883,083,533円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 10,243,754,855円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 45,881,980円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 122,384,441円 |
| ファンド・マネジャー(海外株式) | 778,347円 |
| eMAXIS 先進国株式インデックス | 13,812,111,330円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 994,880,868円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 96,518,422円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 1,737,894,819円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 212,817,433円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 280,469,416円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 255,806,046円 |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス | 99,273,511,131円 |
| 海外株式セレクション(ラップ向け) | 2,579,280,739円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 5,005,695,492円 |
| つみたて先進国株式 | 30,935,804,994円 |
| つみたて8資産均等バランス | 2,461,844,106円 |
| つみたて4資産均等バランス | 874,380,430円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,959,065円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 3,474,054円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 5,862,823円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 176,196,547円 |

| | |
|---|------------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 223,385,181円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 157,257,323円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15) | 67,814,693円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式40) | 515,771,135円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65) | 1,387,983,171円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本) | 55,936,340,668円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型) | 584,338,848円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式) | 4,408,475,757円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー) | 301,763,188,540円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 146,265,580円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 44,678,341円 |
| つみたて全世界株式 | 1,051,120,913円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 66,211,301円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式 | 2,632,159,984円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 48,873,996円 |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け) | 3,487,397,371円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド | 73,103,642円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金) | 405,764円 |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド | 32,492,624,774円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 5,613,745,500円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型) | 548,312,043円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型) | 1,314,160,034円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 216,755,117円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) | 684,521,732円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型) | 163,404,478円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 347,901,774円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 79,736,746円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 111,555,236円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 470,474,739円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 385,029,925円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 751,709,815円 |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定) | 1,258,273,659円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定) | 152円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 4,790,818円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 3,188,453,595円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 34,699,107円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 638,902,835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) | 8,652,283,913円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 64,889円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 508,021,364円 |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定) | 5,043,815,593円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 9,265,241円 |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 58,809,658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) | 1,693,982,924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） | 530,108,430円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付） | 176,899,287円 |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定） | 53,264,324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） | 1,664,951,960円 |
| MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付） | 88,203,913円 |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定） | 2,291,981,933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） | 112,119,822円 |
| MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定） | 8,553,149,276円 |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付） | 46,879,277円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 225,828円 |
| 外国株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定） | 2,934,838,875円 |
| 海外株式インデックスファンドS | 6,306,259,282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） | 109,841,511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） | 56,203,509円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド | 2,864,901,659円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA | 681,516円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA | 1,721,302円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA | 424,751円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA | 1,889,113円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA | 20,762,215円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定） | 763,333円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定） | 6,288,227円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定） | 713,836円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定） | 7,279,105円 |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド | 6,947,302,773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） | 81,649,487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） | 350,627,224円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型） | 387,880,035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） | 395,740,042円 |
| 合計 | 660,378,109,832円 |
| 2. 受益権の総数 | 660,378,109,832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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和 26 年法律第 198 号）第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 |

| | |
|-------------------|---|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |
|-------------------|---|

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [2024年 1月 26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年 1月 26日現在] |
|------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 429,659,191,149 |
| 投資証券 | 2,387,515,857 |
| 合計 | 432,046,707,006 |

(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 1月 26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|----------|-----------------|-------|-----------------|---------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 133,192,596,964 | — | 135,301,790,306 | 2,109,193,342 |
| 合計 | | 133,192,596,964 | — | 135,301,790,306 | 2,109,193,342 |

(注) 時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[2024年1月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|---------------|----------------|---------------|----------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカドル | 15,202,477,890 | — | 15,197,212,591 | △5,265,299 |
| | カナダドル | 598,122,006 | — | 598,761,281 | 639,275 |
| | オーストラリアドル | 512,602,646 | — | 512,455,262 | △147,384 |
| | イギリスポンド | 833,575,372 | — | 833,138,607 | △436,765 |
| | スイスフラン | 554,870,036 | — | 554,018,966 | △851,070 |
| | 香港ドル | 151,730,363 | — | 151,659,199 | △71,164 |
| | シンガポールドル | 67,315,953 | — | 67,284,849 | △31,104 |
| | スウェーデンクローネ | 180,218,771 | — | 180,137,878 | △80,893 |
| | ノルウェークローネ | 31,929,168 | — | 31,927,588 | △1,580 |
| | デンマーククローネ | 194,391,128 | — | 194,146,653 | △244,475 |
| ユーロ | 1,782,856,640 | — | 1,780,319,711 | △2,536,929 | |
| 合計 | | 20,110,089,973 | — | 20,101,062,585 | △9,027,388 |

(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1月26日現在] |
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 6.2329円 (62,329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 | 129,903 | 32.04 | 4,162,092.12 | |
| | BAKER HUGHES CO | 468,653 | 30.30 | 14,200,185.90 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 112,190 | 164.24 | 18,426,085.60 | |
| | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 58,377 | 77.35 | 4,515,460.95 | |
| | CHEVRON CORP | 858,123 | 148.57 | 127,491,334.11 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 569,000 | 112.05 | 63,756,450.00 | |
| | COTERRA ENERGY INC | 360,467 | 25.26 | 9,105,396.42 | |
| | DEVON ENERGY CORP | 301,043 | 42.49 | 12,791,317.07 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 79,274 | 156.32 | 12,392,111.68 | |
| | EOG RESOURCES INC | 279,785 | 114.85 | 32,133,307.25 | |
| | EQT CORP | 170,428 | 36.06 | 6,145,633.68 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 1,893,734 | 102.13 | 193,407,053.42 | |
| | HALLIBURTON CO | 419,092 | 37.00 | 15,506,404.00 | |
| | HESS CORP | 129,005 | 144.03 | 18,580,590.15 | |
| | HF SINCLAIR CORP | 77,822 | 53.72 | 4,180,597.84 | |
| | KINDER MORGAN INC | 921,714 | 17.33 | 15,973,303.62 | |
| | MARATHON OIL CORP | 273,045 | 23.13 | 6,315,530.85 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 185,199 | 157.27 | 29,126,246.73 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 307,139 | 58.01 | 17,817,133.39 | |
| | ONEOK INC | 269,279 | 70.29 | 18,927,620.91 | |
| | OVINTIV INC | 113,361 | 42.88 | 4,860,919.68 | |
| | PHILLIPS 66 | 205,968 | 137.65 | 28,351,495.20 | |
| | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 108,031 | 228.27 | 24,660,236.37 | |
| | SCHLUMBERGER LTD | 681,579 | 52.47 | 35,762,450.13 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 115,380 | 85.99 | 9,921,526.20 | | |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 2,458 | 1,494.42 | 3,673,284.36 | | |
| VALERO ENERGY CORP | 163,915 | 134.46 | 22,040,010.90 | | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| WILLIAMS COS INC | 562,162 | 34.44 | 19,360,859.28 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 102,901 | 263.65 | 27,129,848.65 |
| ALBEMARLE CORP | 56,123 | 118.45 | 6,647,769.35 |
| AMCOR PLC | 709,256 | 9.47 | 6,716,654.32 |
| AVERY DENNISON CORP | 35,066 | 200.41 | 7,027,577.06 |
| BALL CORP | 149,564 | 56.87 | 8,505,704.68 |
| CELANESE CORP | 46,361 | 145.37 | 6,739,498.57 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 101,273 | 76.95 | 7,792,957.35 |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 275,888 | 18.41 | 5,079,098.08 |
| CORTEVA INC | 336,921 | 45.24 | 15,242,306.04 |
| CROWN HOLDINGS INC | 50,366 | 90.51 | 4,558,626.66 |
| DOW INC | 327,275 | 54.94 | 17,980,488.50 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 213,273 | 64.11 | 13,672,932.03 |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 59,297 | 84.62 | 5,017,712.14 |
| ECOLAB INC | 118,537 | 198.62 | 23,543,818.94 |
| FMC CORP | 66,809 | 57.47 | 3,839,513.23 |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 670,214 | 39.44 | 26,433,240.16 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 159,887 | 37.65 | 6,019,745.55 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 121,459 | 82.37 | 10,004,577.83 |
| LINDE PLC | 230,976 | 403.47 | 93,191,886.72 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 120,993 | 95.39 | 11,541,522.27 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 29,074 | 504.82 | 14,677,136.68 |
| MOSAIC CO/THE | 145,017 | 32.05 | 4,647,794.85 |
| NEWMONT CORP | 536,739 | 34.49 | 18,512,128.11 |
| NUCOR CORP | 117,630 | 174.70 | 20,549,961.00 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 39,261 | 171.68 | 6,740,328.48 |
| PPG INDUSTRIES INC | 109,500 | 142.79 | 15,635,505.00 |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM | 26,220 | 280.41 | 7,352,350.20 |
| RPM INTERNATIONAL INC | 57,533 | 107.52 | 6,185,948.16 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 116,862 | 303.91 | 35,515,530.42 |
| STEEL DYNAMICS INC | 78,999 | 115.90 | 9,155,984.10 |
| VULCAN MATERIALS CO | 62,541 | 223.41 | 13,972,284.81 |
| WESTLAKE CORP | 17,817 | 138.38 | 2,465,516.46 |
| WESTROCK CO | 125,922 | 42.43 | 5,342,870.46 |
| 3M CO | 255,830 | 95.98 | 24,554,563.40 |
| AECOM | 58,145 | 88.75 | 5,160,368.75 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| AERCAP HOLDINGS NV | 88,868 | 77.62 | 6,897,934.16 |
| ALLEGION PLC | 47,118 | 125.76 | 5,925,559.68 |
| AMETEK INC | 107,243 | 164.12 | 17,600,721.16 |
| AXON ENTERPRISE INC | 35,700 | 252.70 | 9,021,390.00 |
| BOEING CO/THE | 272,491 | 201.88 | 55,010,483.08 |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 59,216 | 169.80 | 10,054,876.80 |
| CARLISLE COS INC | 25,792 | 310.21 | 8,000,936.32 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 389,084 | 56.31 | 21,909,320.04 |
| CATERPILLAR INC | 242,433 | 300.77 | 72,916,573.41 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 438,944 | 11.94 | 5,240,991.36 |
| CUMMINS INC | 66,361 | 238.85 | 15,850,324.85 |
| DEERE & CO | 130,113 | 393.01 | 51,135,710.13 |
| DOVER CORP | 67,630 | 149.96 | 10,141,794.80 |
| EATON CORP PLC | 190,902 | 245.82 | 46,927,529.64 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 265,443 | 96.24 | 25,546,234.32 |
| FASTENAL CO | 265,499 | 69.21 | 18,375,185.79 |
| FERGUSON PLC | 95,088 | 188.81 | 17,953,565.28 |
| FORTIVE CORP | 166,508 | 74.29 | 12,369,879.32 |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I | 59,589 | 78.83 | 4,697,400.87 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 107,291 | 265.86 | 28,524,385.26 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 516,998 | 129.93 | 67,173,550.14 |
| GRACO INC | 88,867 | 84.57 | 7,515,482.19 |
| HEICO CORP | 18,379 | 184.73 | 3,395,152.67 |
| HEICO CORP-CLASS A | 34,856 | 144.46 | 5,035,297.76 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 314,217 | 202.56 | 63,647,795.52 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 185,591 | 55.27 | 10,257,614.57 |
| HUBBELL INC | 25,853 | 333.82 | 8,630,248.46 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 20,277 | 254.40 | 5,158,468.80 |
| IDEX CORP | 34,302 | 207.78 | 7,127,269.56 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 144,560 | 262.18 | 37,900,740.80 |
| INGERSOLL-RAND INC | 191,346 | 79.25 | 15,164,170.50 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 62,100 | 40.65 | 2,524,365.00 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 315,657 | 55.70 | 17,582,094.90 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 88,994 | 204.64 | 18,211,732.16 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 15,354 | 439.48 | 6,747,775.92 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 106,710 | 431.04 | 45,996,278.40 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| MASCO CORP | 116,358 | 67.18 | 7,816,930.44 |
| NORDSON CORP | 23,401 | 254.05 | 5,945,024.05 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 66,755 | 434.55 | 29,008,385.25 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 190,773 | 88.98 | 16,974,981.54 |
| OWENS CORNING | 40,184 | 149.72 | 6,016,348.48 |
| PACCAR INC | 242,575 | 102.01 | 24,745,075.75 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 62,598 | 471.80 | 29,533,736.40 |
| PENTAIR PLC | 73,174 | 72.16 | 5,280,235.84 |
| QUANTA SERVICES INC | 68,033 | 197.99 | 13,469,853.67 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 53,811 | 304.24 | 16,371,458.64 |
| RTX CORP | 695,934 | 90.94 | 63,288,237.96 |
| SMITH (A. O.) CORP | 60,973 | 81.27 | 4,955,275.71 |
| SNAP-ON INC | 23,090 | 288.55 | 6,662,619.50 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 73,888 | 95.05 | 7,023,054.40 |
| TEXTRON INC | 87,158 | 86.16 | 7,509,533.28 |
| TORO CO | 51,819 | 93.77 | 4,859,067.63 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 105,526 | 252.12 | 26,605,215.12 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 25,655 | 1,078.87 | 27,678,409.85 |
| UNITED RENTALS INC | 32,025 | 651.64 | 20,868,771.00 |
| VERTIV HOLDINGS CO-A | 150,485 | 53.31 | 8,022,355.35 |
| WABTEC CORP | 85,505 | 129.82 | 11,100,259.10 |
| WATSCO INC | 15,087 | 388.37 | 5,859,338.19 |
| WW GRAINGER INC | 20,934 | 881.45 | 18,452,274.30 |
| XYLEM INC | 118,330 | 112.98 | 13,368,923.40 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 196,166 | 236.72 | 46,436,415.52 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 66,512 | 128.88 | 8,572,066.56 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 55,598 | 208.25 | 11,578,283.50 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 63,385 | 68.60 | 4,348,211.00 |
| CINTAS CORP | 42,190 | 598.51 | 25,251,136.90 |
| COPART INC | 401,600 | 48.99 | 19,674,384.00 |
| EQUIFAX INC | 57,597 | 248.43 | 14,308,822.71 |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 60,243 | 135.71 | 8,175,577.53 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 57,281 | 110.73 | 6,342,725.13 |
| PAYCHEX INC | 150,266 | 121.01 | 18,183,688.66 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 27,679 | 192.78 | 5,335,957.62 |
| PAYLOCITY HOLDING CORP | 19,837 | 158.56 | 3,145,354.72 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| REPUBLIC SERVICES INC | 101,991 | 170.28 | 17,367,027.48 |
| ROBERT HALF INC | 46,823 | 81.13 | 3,798,749.99 |
| ROLLINS INC | 124,555 | 43.01 | 5,357,110.55 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 109,026 | 61.13 | 6,664,759.38 |
| TRANSUNION | 93,628 | 69.45 | 6,502,464.60 |
| VERALTO CORP | 104,122 | 76.70 | 7,986,157.40 |
| VERISK ANALYTICS INC | 67,386 | 243.48 | 16,407,143.28 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 119,965 | 153.43 | 18,406,229.95 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 186,270 | 185.10 | 34,478,577.00 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 56,990 | 86.92 | 4,953,570.80 |
| CSX CORP | 923,002 | 35.00 | 32,305,070.00 |
| DELTA AIR LINES INC | 63,959 | 40.18 | 2,569,872.62 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 74,240 | 129.98 | 9,649,715.20 |
| FEDEX CORP | 110,520 | 253.13 | 27,975,927.60 |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A | 833,326 | 3.16 | 2,633,310.16 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 42,716 | 206.26 | 8,810,602.16 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 70,638 | 57.90 | 4,089,940.20 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 105,227 | 237.85 | 25,028,241.95 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 45,766 | 395.44 | 18,097,707.04 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 70,510 | 30.39 | 2,142,798.90 |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING | 55,698 | 65.20 | 3,631,509.60 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 874,176 | 66.00 | 57,695,616.00 |
| UNION PACIFIC CORP | 289,173 | 241.57 | 69,855,521.61 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 344,500 | 159.71 | 55,020,095.00 |
| APTIV PLC | 134,381 | 84.52 | 11,357,882.12 |
| BORGWARNER INC | 121,246 | 33.79 | 4,096,902.34 |
| FORD MOTOR CO | 1,830,738 | 11.34 | 20,760,568.92 |
| GENERAL MOTORS CO | 640,209 | 35.16 | 22,509,748.44 |
| LEAR CORP | 36,593 | 132.33 | 4,842,351.69 |
| LUCID GROUP INC | 324,874 | 2.66 | 864,164.84 |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 276,586 | 15.00 | 4,148,790.00 |
| TESLA INC | 1,350,282 | 182.63 | 246,602,001.66 |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 11,616 | 761.01 | 8,839,892.16 |
| DR HORTON INC | 141,977 | 141.57 | 20,099,683.89 |
| GARMIN LTD | 77,502 | 125.04 | 9,690,850.08 |
| HASBRO INC | 51,810 | 50.08 | 2,594,644.80 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| LENNAR CORP-A | 117,158 | 149.12 | 17,470,600.96 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 53,453 | 474.30 | 25,352,757.90 |
| NIKE INC -CL B | 582,418 | 100.77 | 58,690,261.86 |
| NVR INC | 1,554 | 7,019.11 | 10,907,696.94 |
| PULTEGROUP INC | 105,057 | 105.13 | 11,044,642.41 |
| VF CORP | 191,608 | 17.05 | 3,266,916.40 |
| AIRBNB INC-CLASS A | 197,486 | 142.11 | 28,064,735.46 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 16,969 | 3,503.25 | 59,446,649.25 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 96,290 | 44.90 | 4,323,421.00 |
| CARNIVAL CORP | 478,591 | 16.47 | 7,882,393.77 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 12,770 | 2,311.77 | 29,521,302.90 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 57,227 | 162.12 | 9,277,641.24 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 16,546 | 418.08 | 6,917,551.68 |
| DOORDASH INC - A | 126,356 | 107.52 | 13,585,797.12 |
| DRAFTKINGS INC-CL A | 180,722 | 38.69 | 6,992,134.18 |
| EXPEDIA GROUP INC | 65,362 | 152.30 | 9,954,632.60 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 121,717 | 191.77 | 23,341,669.09 |
| HYATT HOTELS CORP - CL A | 24,388 | 131.14 | 3,198,242.32 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 179,569 | 50.15 | 9,005,385.35 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 117,345 | 242.52 | 28,458,509.40 |
| MCDONALD'S CORP | 344,373 | 297.21 | 102,351,099.33 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 154,928 | 43.62 | 6,757,959.36 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 113,941 | 127.71 | 14,551,405.11 |
| STARBUCKS CORP | 545,479 | 92.61 | 50,516,810.19 |
| VAIL RESORTS INC | 15,472 | 225.93 | 3,495,588.96 |
| WYNN RESORTS LTD | 45,962 | 96.41 | 4,431,196.42 |
| YUM! BRANDS INC | 129,818 | 130.22 | 16,904,899.96 |
| ALPHABET INC-CL A | 3,501,102 | 151.87 | 531,712,360.74 |
| ALPHABET INC-CL C | 1,769,297 | 153.64 | 271,834,791.08 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 45,578 | 369.07 | 16,821,472.46 |
| COMCAST CORP-CLASS A | 1,949,760 | 45.27 | 88,265,635.20 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 119,837 | 138.94 | 16,650,152.78 |
| FOX CORP - CLASS A | 120,205 | 32.13 | 3,862,186.65 |
| FOX CORP - CLASS B | 50,847 | 29.71 | 1,510,664.37 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 200,600 | 32.92 | 6,603,752.00 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 64,383 | 78.34 | 5,043,764.22 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C | 96,984 | 68.22 | 6,616,248.48 |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW | 66,027 | 30.94 | 2,042,875.38 |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 70,934 | 89.78 | 6,368,454.52 |
| MATCH GROUP INC | 134,711 | 38.05 | 5,125,753.55 |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 1,049,767 | 393.18 | 412,747,389.06 |
| NETFLIX INC | 209,772 | 562.00 | 117,891,864.00 |
| NEWS CORP - CLASS A | 205,514 | 24.70 | 5,076,195.80 |
| OMNICOM GROUP | 85,179 | 90.98 | 7,749,585.42 |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B | 226,588 | 13.96 | 3,163,168.48 |
| PINTEREST INC- CLASS A | 275,110 | 36.99 | 10,176,318.90 |
| ROBLOX CORP -CLASS A | 211,776 | 41.32 | 8,750,584.32 |
| ROKU INC | 59,908 | 88.83 | 5,321,627.64 |
| SEA LTD-ADR | 157,094 | 39.40 | 6,189,503.60 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 334,269 | 5.37 | 1,795,024.53 |
| SNAP INC - A | 457,200 | 16.29 | 7,447,788.00 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 80,240 | 168.50 | 13,520,440.00 |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 209,742 | 69.12 | 14,497,367.04 |
| WALT DISNEY CO/THE | 868,428 | 94.86 | 82,379,080.08 |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 1,104,254 | 10.58 | 11,683,007.32 |
| AMAZON.COM INC | 4,384,223 | 157.75 | 691,611,178.25 |
| AUTOZONE INC | 8,322 | 2,748.61 | 22,873,932.42 |
| BATH & BODY WORKS INC | 105,296 | 41.66 | 4,386,631.36 |
| BEST BUY CO INC | 102,296 | 75.21 | 7,693,682.16 |
| BURLINGTON STORES INC | 31,307 | 197.05 | 6,169,044.35 |
| CARMAX INC | 67,362 | 69.08 | 4,653,366.96 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 25,400 | 153.15 | 3,890,010.00 |
| EBAY INC | 252,373 | 42.16 | 10,640,045.68 |
| ETSY INC | 60,720 | 69.56 | 4,223,683.20 |
| GENUINE PARTS CO | 68,207 | 142.52 | 9,720,861.64 |
| GLOBAL-E ONLINE LTD | 34,400 | 37.30 | 1,283,120.00 |
| HOME DEPOT INC | 473,511 | 350.97 | 166,188,155.67 |
| LKQ CORP | 132,517 | 47.51 | 6,295,882.67 |
| LOWE'S COS INC | 274,755 | 212.08 | 58,270,040.40 |
| MERCADOLIBRE INC | 20,908 | 1,738.80 | 36,354,830.40 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 27,976 | 1,024.04 | 28,648,543.04 |
| POOL CORP | 19,048 | 378.56 | 7,210,810.88 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| ROSS STORES INC | 157,794 | 140.81 | 22,218,973.14 |
| TJX COMPANIES INC | 544,222 | 95.51 | 51,978,643.22 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 54,243 | 226.33 | 12,276,818.19 |
| ULTA BEAUTY INC | 24,363 | 493.22 | 12,016,318.86 |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A | 129,336 | 21.81 | 2,820,818.16 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 209,445 | 679.90 | 142,401,655.50 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 102,960 | 132.88 | 13,681,324.80 |
| DOLLAR TREE INC | 97,610 | 132.23 | 12,906,970.30 |
| KROGER CO | 318,193 | 46.43 | 14,773,700.99 |
| SYSCO CORP | 234,054 | 75.27 | 17,617,244.58 |
| TARGET CORP | 214,074 | 142.18 | 30,437,041.32 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 350,405 | 23.11 | 8,097,859.55 |
| WALMART INC | 699,788 | 162.84 | 113,953,477.92 |
| ALTRIA GROUP INC | 816,141 | 40.21 | 32,817,029.61 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 249,543 | 51.38 | 12,821,519.34 |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 159,753 | 55.71 | 8,899,839.63 |
| BUNGE GLOBAL SA | 71,945 | 88.45 | 6,363,535.25 |
| CAMPBELL SOUP CO | 79,341 | 44.24 | 3,510,045.84 |
| CELSIUS HOLDINGS INC | 66,588 | 53.30 | 3,549,140.40 |
| COCA-COLA CO/THE | 1,939,177 | 59.16 | 114,721,711.32 |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 100,867 | 68.22 | 6,881,146.74 |
| CONAGRA BRANDS INC | 235,853 | 29.68 | 7,000,117.04 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 76,807 | 250.21 | 19,217,879.47 |
| DARLING INGREDIENTS INC | 61,326 | 43.83 | 2,687,918.58 |
| GENERAL MILLS INC | 272,350 | 64.47 | 17,558,404.50 |
| HERSHEY CO/THE | 70,637 | 189.36 | 13,375,822.32 |
| HORMEL FOODS CORP | 152,101 | 30.42 | 4,626,912.42 |
| JM SMUCKER CO/THE | 47,902 | 131.55 | 6,301,508.10 |
| KELLANOVA | 134,376 | 54.63 | 7,340,960.88 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 488,593 | 31.59 | 15,434,652.87 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 400,266 | 37.26 | 14,913,911.16 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 69,547 | 105.04 | 7,305,216.88 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 120,387 | 68.60 | 8,258,548.20 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 81,614 | 62.88 | 5,131,888.32 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 646,336 | 74.50 | 48,152,032.00 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 364,459 | 55.14 | 20,096,269.26 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| PEPSICO INC | 649,426 | 166.56 | 108,168,394.56 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 734,167 | 91.21 | 66,963,372.07 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 144,659 | 54.04 | 7,817,372.36 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 116,953 | 98.07 | 11,469,580.71 |
| CLOROX COMPANY | 62,251 | 144.15 | 8,973,481.65 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 361,455 | 81.22 | 29,357,375.10 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 109,823 | 128.66 | 14,129,827.18 |
| KENVUE INC | 809,317 | 20.75 | 16,793,327.75 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 157,123 | 120.49 | 18,931,750.27 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 1,113,158 | 155.62 | 173,229,647.96 |
| ABBOTT LABORATORIES | 820,999 | 112.45 | 92,321,337.55 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 36,172 | 262.11 | 9,481,042.92 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 251,287 | 38.99 | 9,797,680.13 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 134,157 | 236.57 | 31,737,521.49 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 698,399 | 60.83 | 42,483,611.17 |
| CARDINAL HEALTH INC | 116,021 | 105.71 | 12,264,579.91 |
| CENCORA INC | 79,861 | 218.84 | 17,476,781.24 |
| CENTENE CORP | 252,779 | 73.55 | 18,591,895.45 |
| COOPER COS INC/THE | 23,886 | 379.29 | 9,059,720.94 |
| CVS HEALTH CORP | 610,950 | 71.99 | 43,982,290.50 |
| DAVITA INC | 22,235 | 107.43 | 2,388,706.05 |
| DEXCOM INC | 180,833 | 126.50 | 22,876,278.66 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 285,205 | 73.55 | 20,976,827.75 |
| ELEVANCE HEALTH INC | 111,967 | 480.31 | 53,778,869.77 |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY | 191,178 | 72.87 | 13,931,140.86 |
| HCA HEALTHCARE INC | 94,247 | 286.02 | 26,956,526.94 |
| HENRY SCHEIN INC | 55,674 | 74.04 | 4,122,102.96 |
| HOLOGIC INC | 108,472 | 74.14 | 8,042,114.08 |
| HUMANA INC | 57,461 | 355.36 | 20,419,340.96 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 38,629 | 522.44 | 20,181,334.76 |
| INSULET CORP | 33,794 | 198.67 | 6,713,853.98 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 167,451 | 374.97 | 62,789,101.47 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 38,741 | 226.65 | 8,780,647.65 |
| MCKESSON CORP | 62,517 | 486.33 | 30,403,892.61 |
| MEDTRONIC PLC | 631,690 | 85.79 | 54,192,685.10 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 29,135 | 350.07 | 10,199,289.45 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 53,597 | 130.15 | 6,975,649.55 |
| RESMED INC | 70,379 | 186.35 | 13,115,126.65 |
| STERIS PLC | 46,847 | 216.68 | 10,150,807.96 |
| STRYKER CORP | 162,493 | 311.91 | 50,683,191.63 |
| TELEFLEX INC | 21,664 | 244.88 | 5,305,080.32 |
| THE CIGNA GROUP | 141,762 | 298.57 | 42,325,880.34 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 437,657 | 493.40 | 215,939,963.80 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 24,352 | 156.98 | 3,822,776.96 |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 71,343 | 208.20 | 14,853,612.60 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 99,295 | 121.96 | 12,110,018.20 |
| ABBVIE INC | 833,355 | 165.13 | 137,611,911.15 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 136,910 | 129.88 | 17,781,870.80 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 58,878 | 183.93 | 10,829,430.54 |
| AMGEN INC | 252,730 | 310.26 | 78,412,009.80 |
| AVANTOR INC | 338,278 | 21.94 | 7,421,819.32 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 9,607 | 316.30 | 3,038,694.10 |
| BIO-TECHNE CORP | 73,060 | 71.12 | 5,196,027.20 |
| BIOGEN INC | 67,078 | 246.21 | 16,515,274.38 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 89,283 | 91.25 | 8,147,073.75 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 992,455 | 49.61 | 49,235,692.55 |
| CATALENT INC | 70,521 | 50.41 | 3,554,963.61 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 25,059 | 213.03 | 5,338,318.77 |
| DANAHER CORP | 332,522 | 227.39 | 75,612,177.58 |
| ELI LILLY & CO | 381,237 | 627.62 | 239,271,965.94 |
| EXACT SCIENCES CORP | 85,934 | 64.26 | 5,522,118.84 |
| GILEAD SCIENCES INC | 588,457 | 80.23 | 47,211,905.11 |
| ILLUMINA INC | 75,364 | 142.76 | 10,758,964.64 |
| INCYTE CORP | 92,287 | 60.92 | 5,622,124.04 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 85,523 | 215.50 | 18,430,206.50 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 24,964 | 122.82 | 3,066,078.48 |
| JOHNSON & JOHNSON | 1,135,612 | 159.56 | 181,198,250.72 |
| MERCK & CO. INC. | 1,197,192 | 120.13 | 143,818,674.96 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 10,428 | 1,202.45 | 12,539,148.60 |
| MODERNA INC | 151,325 | 102.81 | 15,557,723.25 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 46,801 | 141.01 | 6,599,409.01 |
| PFIZER INC | 2,676,489 | 27.47 | 73,523,152.83 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 50,452 | 948.87 | 47,872,389.24 |
| REPLIGEN CORP | 27,634 | 185.51 | 5,126,383.34 |
| REVVITY INC | 64,189 | 108.69 | 6,976,702.41 |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 163,958 | 29.11 | 4,772,817.38 |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 537,553 | 11.83 | 6,359,251.99 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 182,783 | 538.21 | 98,375,638.43 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 20,488 | 219.32 | 4,493,428.16 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 122,352 | 429.96 | 52,606,465.92 |
| VIATRIS INC | 571,447 | 11.74 | 6,708,787.78 |
| WATERS CORP | 28,250 | 312.00 | 8,814,000.00 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 34,752 | 354.22 | 12,309,853.44 |
| ZOETIS INC | 218,455 | 187.32 | 40,920,990.60 |
| BANK OF AMERICA CORP | 3,395,483 | 33.39 | 113,375,177.37 |
| CITIGROUP INC | 918,277 | 53.73 | 49,339,023.21 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 215,044 | 33.60 | 7,225,478.40 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 323,273 | 34.90 | 11,282,227.70 |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 4,692 | 1,412.41 | 6,627,027.72 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 784,804 | 12.94 | 10,155,363.76 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 1,372,815 | 172.94 | 237,414,626.10 |
| KEYCORP | 425,764 | 14.54 | 6,190,608.56 |
| M & T BANK CORP | 77,940 | 142.04 | 11,070,597.60 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 184,875 | 151.25 | 27,962,343.75 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 451,758 | 19.13 | 8,642,130.54 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 617,004 | 37.51 | 23,143,820.04 |
| US BANCORP | 738,867 | 42.81 | 31,630,896.27 |
| WELLS FARGO & CO | 1,736,643 | 49.88 | 86,623,752.84 |
| ALLY FINANCIAL INC | 150,075 | 36.90 | 5,537,767.50 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 297,670 | 188.07 | 55,982,796.90 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 47,423 | 391.38 | 18,560,413.74 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 221,134 | 19.64 | 4,343,071.76 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 185,785 | 99.98 | 18,574,784.30 |
| ARES MANAGEMENT CORP - A | 78,272 | 120.67 | 9,445,082.24 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 359,883 | 55.34 | 19,915,925.22 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 617,271 | 380.85 | 235,087,660.35 |
| BLACKROCK INC | 71,039 | 790.46 | 56,153,487.94 |
| BLACKSTONE INC | 340,601 | 123.49 | 42,060,817.49 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|----------------|
| BLOCK INC | 257,486 | 62.71 | 16,146,947.06 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 177,252 | 132.55 | 23,494,752.60 |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 100,944 | 40.96 | 4,134,666.24 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 50,535 | 188.69 | 9,535,449.15 |
| CME GROUP INC | 165,902 | 205.61 | 34,111,110.22 |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 80,152 | 121.01 | 9,699,193.52 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 125,220 | 103.74 | 12,990,322.80 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 161,103 | 33.32 | 5,367,951.96 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 16,770 | 471.08 | 7,900,011.60 |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 277,419 | 62.25 | 17,269,332.75 |
| FISERV INC | 290,471 | 140.66 | 40,857,650.86 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 33,282 | 293.80 | 9,778,251.60 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 152,703 | 27.48 | 4,196,278.44 |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 20,000 | 49.02 | 980,400.00 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 121,284 | 131.38 | 15,934,291.92 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 156,808 | 382.70 | 60,010,421.60 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 273,218 | 127.29 | 34,777,919.22 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 32,205 | 168.29 | 5,419,779.45 |
| KKR & CO INC | 267,580 | 85.35 | 22,837,953.00 |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 37,429 | 240.68 | 9,008,411.72 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 18,161 | 273.37 | 4,964,672.57 |
| MASTERCARD INC - A | 397,104 | 436.80 | 173,455,027.20 |
| MOODY'S CORP | 76,058 | 392.60 | 29,860,370.80 |
| MORGAN STANLEY | 593,456 | 88.02 | 52,235,997.12 |
| MSCI INC | 36,664 | 554.77 | 20,340,087.28 |
| NASDAQ INC | 162,267 | 58.37 | 9,471,524.79 |
| NORTHERN TRUST CORP | 106,892 | 81.79 | 8,742,696.68 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 483,824 | 60.71 | 29,372,955.04 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 94,006 | 113.85 | 10,702,583.10 |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A | 164,032 | 10.70 | 1,755,142.40 |
| S&P GLOBAL INC | 154,852 | 449.34 | 69,581,197.68 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 716,696 | 63.71 | 45,660,702.16 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 49,468 | 63.92 | 3,161,994.56 |
| STATE STREET CORP | 141,914 | 74.68 | 10,598,137.52 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 202,115 | 38.46 | 7,773,342.90 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 106,409 | 111.38 | 11,851,834.42 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------|
| TOAST INC-CLASS A | 133,334 | 16.60 | 2,213,344.40 |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 44,347 | 98.28 | 4,358,423.16 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 758,046 | 272.61 | 206,650,920.06 |
| AFLAC INC | 258,788 | 84.89 | 21,968,513.32 |
| ALLSTATE CORP | 121,559 | 159.06 | 19,335,174.54 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 36,267 | 120.27 | 4,361,832.09 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 328,535 | 68.98 | 22,662,344.30 |
| AON PLC-CLASS A | 93,695 | 299.71 | 28,081,328.45 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 175,032 | 79.60 | 13,932,547.20 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 99,987 | 237.75 | 23,771,909.25 |
| ASSURANT INC | 21,769 | 171.33 | 3,729,682.77 |
| BROWN & BROWN INC | 115,015 | 77.19 | 8,878,007.85 |
| CHUBB LTD | 195,240 | 241.21 | 47,093,840.40 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 69,403 | 112.30 | 7,793,956.90 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 12,973 | 337.54 | 4,378,906.42 |
| EVEREST GROUP LTD | 20,718 | 376.56 | 7,801,570.08 |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 125,557 | 49.77 | 6,248,971.89 |
| GLOBE LIFE INC | 42,612 | 123.50 | 5,262,582.00 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 152,913 | 87.12 | 13,321,780.56 |
| LOEWS CORP | 91,815 | 72.98 | 6,700,658.70 |
| MARKEL GROUP INC | 6,496 | 1,471.93 | 9,561,657.28 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 235,195 | 191.09 | 44,943,412.55 |
| METLIFE INC | 295,036 | 70.39 | 20,767,584.04 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 114,836 | 80.16 | 9,205,253.76 |
| PROGRESSIVE CORP | 278,569 | 178.01 | 49,588,067.69 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 168,031 | 105.77 | 17,772,638.87 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 105,266 | 211.52 | 22,265,864.32 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 49,085 | 250.72 | 12,306,591.20 |
| WR BERKLEY CORP | 90,046 | 83.27 | 7,498,130.42 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 297,278 | 371.94 | 110,569,579.32 |
| ADOBE INC | 215,651 | 622.58 | 134,259,999.58 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 67,049 | 123.66 | 8,291,279.34 |
| ANSYS INC | 41,166 | 339.42 | 13,972,563.72 |
| ASPEN TECHNOLOGY INC | 10,737 | 202.05 | 2,169,410.85 |
| ATLASSIAN CORP-CL A | 72,442 | 244.35 | 17,701,202.70 |
| AUTODESK INC | 99,848 | 251.75 | 25,136,734.00 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|------------------|
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 115,702 | 50.05 | 5,790,885.10 |
| BILL HOLDINGS INC | 41,762 | 73.97 | 3,089,135.14 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 126,200 | 291.19 | 36,748,178.00 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 45,465 | 158.89 | 7,223,933.85 |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 131,715 | 81.86 | 10,782,189.90 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 234,999 | 78.30 | 18,400,421.70 |
| CONFLUENT INC-CLASS A | 64,138 | 22.53 | 1,445,029.14 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 105,632 | 293.46 | 30,998,766.72 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 18,427 | 231.34 | 4,262,902.18 |
| DATADOG INC - CLASS A | 120,112 | 122.19 | 14,676,485.28 |
| DOCUSIGN INC | 99,141 | 62.47 | 6,193,338.27 |
| DROPBOX INC-CLASS A | 143,057 | 32.38 | 4,632,185.66 |
| DYNATRACE INC | 122,316 | 58.19 | 7,117,568.04 |
| EPAM SYSTEMS INC | 25,272 | 285.13 | 7,205,805.36 |
| FAIR ISAAC CORP | 11,675 | 1,284.27 | 14,993,852.25 |
| FORTINET INC | 312,243 | 65.55 | 20,467,528.65 |
| GARTNER INC | 36,967 | 461.19 | 17,048,810.73 |
| GEN DIGITAL INC | 292,070 | 23.84 | 6,962,948.80 |
| GODADDY INC - CLASS A | 71,554 | 107.45 | 7,688,477.30 |
| HUBSPOT INC | 22,670 | 585.73 | 13,278,499.10 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 430,927 | 190.43 | 82,061,428.61 |
| INTUIT INC | 133,340 | 641.49 | 85,536,276.60 |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC | 27,717 | 218.28 | 6,050,066.76 |
| MICROSOFT CORP | 3,331,712 | 404.87 | 1,348,910,237.44 |
| MONDAY.COM LTD | 10,500 | 208.00 | 2,184,000.00 |
| MONGODB INC | 33,633 | 400.30 | 13,463,289.90 |
| OKTA INC | 67,338 | 84.51 | 5,690,734.38 |
| ORACLE CORP | 779,704 | 115.00 | 89,665,960.00 |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 868,060 | 16.46 | 14,288,267.60 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 147,110 | 340.19 | 50,045,350.90 |
| PTC INC | 59,696 | 180.03 | 10,747,070.88 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 49,247 | 551.70 | 27,169,569.90 |
| SALESFORCE INC | 461,365 | 279.03 | 128,734,675.95 |
| SERVICENOW INC | 97,420 | 766.69 | 74,690,939.80 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 130,503 | 206.01 | 26,884,923.03 |
| SPLUNK INC | 78,731 | 153.30 | 12,069,462.30 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|------------------|
| SYNOPSYS INC | 70,546 | 536.68 | 37,860,627.28 |
| TWILIO INC - A | 83,044 | 72.50 | 6,020,690.00 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 21,498 | 429.25 | 9,228,016.50 |
| UIPATH INC - CLASS A | 163,403 | 22.83 | 3,730,490.49 |
| UNITY SOFTWARE INC | 98,085 | 32.88 | 3,225,034.80 |
| VERISIGN INC | 44,067 | 203.04 | 8,947,363.68 |
| WIX.COM LTD | 21,919 | 126.89 | 2,781,301.91 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 96,589 | 292.36 | 28,238,760.04 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 121,952 | 67.42 | 8,222,003.84 |
| ZSCALER INC | 42,277 | 238.30 | 10,074,609.10 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 275,050 | 100.81 | 27,727,790.50 |
| APPLE INC | 7,378,330 | 194.17 | 1,432,650,336.10 |
| ARISTA NETWORKS INC | 122,073 | 264.42 | 32,278,542.66 |
| CDW CORP/DE | 62,792 | 228.99 | 14,378,740.08 |
| CISCO SYSTEMS INC | 1,921,822 | 52.33 | 100,568,945.26 |
| CORNING INC | 402,780 | 30.82 | 12,413,679.60 |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 120,098 | 83.04 | 9,972,937.92 |
| F5 INC | 28,851 | 184.64 | 5,327,048.64 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 607,105 | 15.92 | 9,665,111.60 |
| HP INC | 415,071 | 29.71 | 12,331,759.41 |
| JABIL INC | 66,575 | 124.18 | 8,267,283.50 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 146,230 | 37.23 | 5,444,142.90 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 83,926 | 155.60 | 13,058,885.60 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 77,096 | 328.59 | 25,332,974.64 |
| NETAPP INC | 99,621 | 89.24 | 8,890,178.04 |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 93,900 | 90.99 | 8,543,961.00 |
| SUPER MICRO COMPUTER INC | 20,822 | 475.58 | 9,902,526.76 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 146,164 | 144.26 | 21,085,618.64 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 22,495 | 424.91 | 9,558,350.45 |
| TRIMBLE INC | 130,417 | 51.69 | 6,741,254.73 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 154,930 | 60.33 | 9,346,926.90 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 23,205 | 256.99 | 5,963,452.95 |
| AT&T INC | 3,397,864 | 17.18 | 58,375,303.52 |
| LIBERTY GLOBAL LTD-C | 110,741 | 20.83 | 2,306,735.03 |
| T-MOBILE US INC | 252,540 | 162.56 | 41,052,902.40 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 1,990,703 | 42.29 | 84,186,829.87 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------|
| AES CORP | 301,072 | 17.13 | 5,157,363.36 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 111,263 | 48.75 | 5,424,071.25 |
| AMEREN CORPORATION | 126,787 | 69.68 | 8,834,518.16 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 237,861 | 78.09 | 18,574,565.49 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 97,628 | 123.98 | 12,103,919.44 |
| ATMOS ENERGY CORP | 70,614 | 113.92 | 8,044,346.88 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 304,623 | 27.52 | 8,383,224.96 |
| CMS ENERGY CORP | 149,917 | 56.46 | 8,464,313.82 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 159,223 | 89.67 | 14,277,526.41 |
| CONSTELLATION ENERGY | 149,416 | 120.55 | 18,012,098.80 |
| DOMINION ENERGY INC | 390,210 | 45.19 | 17,633,589.90 |
| DTE ENERGY COMPANY | 97,464 | 103.80 | 10,116,763.20 |
| DUKE ENERGY CORP | 366,352 | 95.73 | 35,070,876.96 |
| EDISON INTERNATIONAL | 179,463 | 67.04 | 12,031,199.52 |
| ENTERGY CORP | 105,812 | 99.08 | 10,483,852.96 |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 117,465 | 36.37 | 4,272,202.05 |
| EVERGY INC | 112,565 | 50.08 | 5,637,255.20 |
| EVERSOURCE ENERGY | 168,362 | 54.86 | 9,236,339.32 |
| EXELON CORP | 462,658 | 34.90 | 16,146,764.20 |
| FIRSTENERGY CORP | 258,340 | 36.50 | 9,429,410.00 |
| NEXTERA ENERGY INC | 973,941 | 57.98 | 56,469,099.18 |
| NISOURCE INC | 183,411 | 25.56 | 4,687,985.16 |
| NRG ENERGY INC | 109,791 | 53.69 | 5,894,678.79 |
| P G & E CORP | 943,499 | 16.76 | 15,813,043.24 |
| PPL CORP | 371,135 | 25.83 | 9,586,417.05 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 231,120 | 57.47 | 13,282,466.40 |
| SEMPRA | 289,474 | 70.73 | 20,474,496.02 |
| SOUTHERN CO/THE | 518,699 | 69.24 | 35,914,718.76 |
| VISTRA CORP | 168,052 | 40.43 | 6,794,342.36 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 148,259 | 80.01 | 11,862,202.59 |
| XCEL ENERGY INC | 255,738 | 58.89 | 15,060,410.82 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 765,356 | 180.33 | 138,016,647.48 |
| ANALOG DEVICES INC | 236,722 | 197.30 | 46,705,250.60 |
| APPLIED MATERIALS INC | 395,578 | 172.63 | 68,288,630.14 |
| BROADCOM INC | 209,674 | 1,230.00 | 257,899,020.00 |
| ENPHASE ENERGY INC | 58,680 | 106.83 | 6,268,784.40 |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|-------------|--------|--|--|
| | ENTEGRIS INC | 75,432 | 123.43 | 9,310,571.76 | |
| | FIRST SOLAR INC | 47,986 | 149.23 | 7,160,950.78 | |
| | INTEL CORP | 1,982,305 | 49.55 | 98,223,212.75 | |
| | KLA CORP | 63,066 | 641.69 | 40,468,821.54 | |
| | LAM RESEARCH CORP | 62,630 | 865.60 | 54,212,528.00 | |
| | LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | 71,939 | 66.89 | 4,811,999.71 | |
| | MARVELL TECHNOLOGY INC | 400,898 | 70.00 | 28,062,860.00 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 251,780 | 89.65 | 22,572,077.00 | |
| | MICRON TECHNOLOGY INC | 521,616 | 89.20 | 46,528,147.20 | |
| | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 21,208 | 615.68 | 13,057,341.44 | |
| | NVIDIA CORP | 1,166,200 | 616.17 | 718,577,454.00 | |
| | NXP SEMICONDUCTORS NV | 119,135 | 219.41 | 26,139,410.35 | |
| | ON SEMICONDUCTOR | 201,205 | 72.69 | 14,625,591.45 | |
| | QORVO INC | 47,965 | 106.44 | 5,105,394.60 | |
| | QUALCOMM INC | 527,728 | 154.47 | 81,518,144.16 | |
| | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 75,631 | 107.03 | 8,094,785.93 | |
| | TERADYNE INC | 75,180 | 109.95 | 8,266,041.00 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 428,713 | 167.42 | 71,775,130.46 | |
| | CBRE GROUP INC - A | 154,213 | 86.75 | 13,377,977.75 | |
| | COSTAR GROUP INC | 191,216 | 84.61 | 16,178,785.76 | |
| | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 487,100 | 3.17 | 1,544,107.00 | |
| | ZILLOW GROUP INC - C | 61,585 | 55.09 | 3,392,717.65 | |
| | アメリカドル 小計 | 160,135,345 | | 19,947,684,412.13 (2,946,272,987,671) | |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD | 312,000 | 21.66 | 6,757,920.00 | |
| | CAMECO CORP | 206,900 | 61.97 | 12,821,593.00 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 527,400 | 86.81 | 45,783,594.00 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 680,600 | 21.37 | 14,544,422.00 | |
| | ENBRIDGE INC | 1,022,300 | 48.00 | 49,070,400.00 | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 86,400 | 76.49 | 6,608,736.00 | |
| | KEYERA CORP | 96,900 | 33.23 | 3,219,987.00 | |
| | MEG ENERGY CORP | 137,000 | 25.65 | 3,514,050.00 | |
| | PARKLAND CORP | 59,200 | 46.21 | 2,735,632.00 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 293,932 | 46.50 | 13,667,838.00 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 606,600 | 43.52 | 26,399,232.00 | |
| | TC ENERGY CORP | 477,900 | 52.41 | 25,046,739.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| TOURMALINE OIL CORP | 156,500 | 59.28 | 9,277,320.00 | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 250,940 | 67.08 | 16,833,055.20 | |
| BARRICK GOLD CORP | 835,800 | 21.03 | 17,576,874.00 | |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 62,000 | 58.15 | 3,605,300.00 | |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 254,400 | 12.46 | 3,169,824.00 | |
| FRANCO-NEVADA CORP | 84,800 | 147.22 | 12,484,256.00 | |
| IVANHOE MINES LTD-CL A | 247,000 | 14.91 | 3,682,770.00 | |
| KINROSS GOLD CORP | 502,500 | 7.48 | 3,758,700.00 | |
| LUNDIN MINING CORP | 278,300 | 10.99 | 3,058,517.00 | |
| NUTRIEN LTD | 235,759 | 68.08 | 16,050,472.72 | |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 166,900 | 18.85 | 3,146,065.00 | |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 203,400 | 54.50 | 11,085,300.00 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 26,600 | 109.86 | 2,922,276.00 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 219,800 | 63.04 | 13,856,192.00 | |
| CAE INC | 166,100 | 26.95 | 4,476,395.00 | |
| STANTEC INC | 52,200 | 108.72 | 5,675,184.00 | |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 34,700 | 116.29 | 4,035,263.00 | |
| WSP GLOBAL INC | 60,900 | 193.33 | 11,773,797.00 | |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 158,500 | 22.77 | 3,609,045.00 | |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 120,300 | 45.03 | 5,417,109.00 | |
| RB GLOBAL INC | 77,500 | 83.61 | 6,479,775.00 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 75,232 | 200.66 | 15,096,053.12 | |
| AIR CANADA | 62,200 | 18.83 | 1,171,226.00 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 256,600 | 166.67 | 42,767,522.00 | |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | 432,700 | 106.14 | 45,926,778.00 | |
| TFI INTERNATIONAL INC | 36,700 | 181.36 | 6,655,912.00 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 134,500 | 74.60 | 10,033,700.00 | |
| BRP INC/CA- SUB VOTING | 15,700 | 89.24 | 1,401,068.00 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 74,300 | 43.91 | 3,262,513.00 | |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 143,710 | 103.51 | 14,875,422.10 | |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 25,300 | 147.89 | 3,741,617.00 | |
| DOLLARAMA INC | 137,800 | 99.99 | 13,778,622.00 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 359,800 | 80.59 | 28,996,282.00 | |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 55,300 | 35.00 | 1,935,500.00 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 70,200 | 134.17 | 9,418,734.00 | |
| METRO INC/CN | 119,000 | 70.96 | 8,444,240.00 | |

| | | | |
|-----------------------------|---------|----------|---------------|
| WESTON (GEORGE) LTD | 36,011 | 173.33 | 6,241,786.63 |
| SAPUTO INC | 95,600 | 28.43 | 2,717,908.00 |
| BANK OF MONTREAL | 348,000 | 130.29 | 45,340,920.00 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 586,600 | 61.86 | 36,287,076.00 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 431,300 | 61.87 | 26,684,531.00 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 160,900 | 102.29 | 16,458,461.00 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 661,700 | 132.34 | 87,569,378.00 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 867,200 | 82.52 | 71,561,344.00 |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A | 157,388 | 54.27 | 8,541,446.76 |
| BROOKFIELD CORP | 651,050 | 55.12 | 35,885,876.00 |
| IGM FINANCIAL INC | 39,400 | 36.24 | 1,427,856.00 |
| ONEX CORPORATION | 41,700 | 105.39 | 4,394,763.00 |
| TMX GROUP LTD | 127,600 | 33.70 | 4,300,120.00 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 10,700 | 1,337.03 | 14,306,221.00 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 133,600 | 44.10 | 5,891,760.00 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 41,300 | 91.83 | 3,792,579.00 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 85,200 | 208.29 | 17,746,308.00 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 835,600 | 29.53 | 24,675,268.00 |
| POWER CORP OF CANADA | 259,900 | 39.41 | 10,242,659.00 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 272,500 | 69.11 | 18,832,475.00 |
| CGI INC | 101,200 | 147.13 | 14,889,556.00 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 9,400 | 3,661.86 | 34,421,484.00 |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE | 35,400 | 121.00 | 4,283,400.00 |
| OPEN TEXT CORP | 122,700 | 58.10 | 7,128,870.00 |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 574,500 | 108.49 | 62,327,505.00 |
| BCE INC | 22,600 | 54.58 | 1,233,508.00 |
| QUEBECOR INC -CL B | 55,600 | 32.85 | 1,826,460.00 |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 175,400 | 63.63 | 11,160,702.00 |
| TELUS CORP | 231,200 | 24.45 | 5,652,840.00 |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 241,500 | 8.21 | 1,982,715.00 |
| ALTAGAS LTD | 126,100 | 28.48 | 3,591,328.00 |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 54,950 | 38.13 | 2,095,243.50 |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 58,500 | 31.07 | 1,817,595.00 |
| EMERA INC | 124,600 | 48.94 | 6,097,924.00 |
| FORTIS INC | 246,200 | 53.64 | 13,206,168.00 |
| HYDRO ONE LTD | 169,900 | 39.71 | 6,746,729.00 |

| | | | | | |
|---------------------------|------------------------------|------------|--------------|---------------------------------------|--|
| | NORTHLAND POWER INC | 103,200 | 24.92 | 2,571,744.00 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 18,100 | 223.72 | 4,049,332.00 | |
| | カナダドル 小計 | 19,015,372 | | 1,207,630,662.03 (132,356,320,558) | |
| オーストラリア ドル | AMPOL LTD | 111,261 | 35.92 | 3,996,495.12 | |
| | SANTOS LTD | 1,632,935 | 7.67 | 12,524,611.45 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 884,097 | 31.18 | 27,566,144.46 | |
| | BHP GROUP LTD | 2,410,339 | 47.54 | 114,587,516.06 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 195,782 | 23.33 | 4,567,594.06 | |
| | FORTESCUE LTD | 810,336 | 28.97 | 23,475,433.92 | |
| | IGO LTD | 302,734 | 7.47 | 2,261,422.98 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 196,297 | 55.56 | 10,906,261.32 | |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 76,336 | 59.39 | 4,533,595.04 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 568,880 | 12.90 | 7,338,552.00 | |
| | ORICA LTD | 225,412 | 16.02 | 3,611,100.24 | |
| | PILBARA MINERALS LTD | 1,540,998 | 3.53 | 5,439,722.94 | |
| | RIO TINTO LTD | 173,289 | 132.63 | 22,983,320.07 | |
| | SOUTH32 LTD | 2,068,849 | 3.35 | 6,930,644.15 | |
| | REECE LTD | 81,800 | 22.40 | 1,832,320.00 | |
| | BRAMBLES LTD | 723,076 | 14.70 | 10,629,217.20 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 288,146 | 25.55 | 7,362,130.30 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 799,349 | 3.72 | 2,973,578.28 | |
| | QANTAS AIRWAYS LTD | 318,258 | 5.48 | 1,744,053.84 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 1,478,983 | 13.19 | 19,507,785.77 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 283,649 | 43.59 | 12,364,259.91 | |
| | IDP EDUCATION LTD | 98,033 | 19.67 | 1,928,309.11 | |
| | LOTTERY CORP LTD/THE | 1,165,622 | 4.88 | 5,688,235.36 | |
| | CAR GROUP LTD | 174,947 | 32.82 | 5,741,760.54 | |
| | REA GROUP LTD | 22,035 | 184.15 | 4,057,745.25 | |
| | SEEK LTD | 146,470 | 25.56 | 3,743,773.20 | |
| | WESFARMERS LTD | 530,618 | 58.45 | 31,014,622.10 | |
| | COLES GROUP LTD | 583,356 | 15.58 | 9,088,686.48 | |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 584,671 | 5.52 | 3,227,383.92 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 573,470 | 36.20 | 20,759,614.00 | |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 311,138 | 10.29 | 3,201,610.02 | | |
| COCHLEAR LTD | 32,214 | 299.50 | 9,648,093.00 | | |

| | | | | |
|---------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 89,028 | 51.08 | 4,547,550.24 |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 195,410 | 31.56 | 6,167,139.60 |
| | CSL LTD | 229,497 | 293.00 | 67,242,621.00 |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 1,389,796 | 26.67 | 37,065,859.32 |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 795,482 | 114.86 | 91,369,062.52 |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 1,448,173 | 31.79 | 46,037,419.67 |
| | WESTPAC BANKING CORP | 1,621,244 | 23.70 | 38,423,482.80 |
| | ASX LTD | 89,482 | 66.17 | 5,921,023.94 |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 171,380 | 186.60 | 31,979,508.00 |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 138,803 | 33.30 | 4,622,139.90 |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 1,221,541 | 5.99 | 7,317,030.59 |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 1,155,175 | 3.74 | 4,320,354.50 |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 722,295 | 15.79 | 11,405,038.05 |
| | SUNCORP GROUP LTD | 581,731 | 14.27 | 8,301,301.37 |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 85,300 | 73.21 | 6,244,813.00 |
| | XERO LTD | 63,997 | 112.54 | 7,202,222.38 |
| | TELSTRA GROUP LTD | 1,847,864 | 4.00 | 7,391,456.00 |
| | APA GROUP | 737,148 | 8.20 | 6,044,613.60 |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 844,040 | 8.28 | 6,988,651.20 |
| | オーストラリアドル 小計 | 32,820,766 | | 803,826,879.77 (78,156,087,520) |
| イギリスポンド | BP PLC | 8,113,208 | 4.55 | 36,967,832.25 |
| | SHELL PLC | 3,135,090 | 23.91 | 74,960,001.90 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 604,877 | 18.25 | 11,040,215.00 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 229,746 | 16.72 | 3,841,353.12 |
| | CRH PLC | 329,524 | 55.20 | 18,189,724.80 |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 61,968 | 45.17 | 2,799,094.56 |
| | ENDEAVOUR MINING PLC | 64,300 | 14.33 | 921,419.00 |
| | GLENCORE PLC | 4,862,584 | 4.16 | 20,235,643.31 |
| | MONDI PLC | 263,786 | 14.60 | 3,851,275.60 |
| | RIO TINTO PLC | 521,901 | 54.81 | 28,605,393.81 |
| | ASHTREAD GROUP PLC | 207,593 | 51.96 | 10,786,532.28 |
| | BAE SYSTEMS PLC | 1,425,756 | 11.82 | 16,852,435.92 |
| | BUNZL PLC | 171,510 | 31.47 | 5,397,419.70 |
| | DCC PLC | 56,482 | 57.10 | 3,225,122.20 |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 662,878 | 5.81 | 3,851,321.18 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 3,949,490 | 3.06 | 12,105,186.85 |
| SMITHS GROUP PLC | 140,644 | 16.50 | 2,320,626.00 |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 35,331 | 96.22 | 3,399,548.82 |
| EXPERIAN PLC | 430,087 | 32.41 | 13,939,119.67 |
| INTERTEK GROUP PLC | 82,511 | 43.84 | 3,617,282.24 |
| RELX PLC | 903,378 | 32.57 | 29,423,021.46 |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 1,238,732 | 3.92 | 4,862,023.10 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 519,922 | 5.34 | 2,780,542.85 |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 65,065 | 48.05 | 3,126,373.25 |
| BURBERRY GROUP PLC | 144,568 | 12.78 | 1,848,301.88 |
| PERSIMMON PLC | 151,061 | 14.61 | 2,207,756.51 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 1,572,933 | 1.45 | 2,280,752.85 |
| COMPASS GROUP PLC | 796,308 | 21.44 | 17,072,843.52 |
| ENTAIN PLC | 318,737 | 9.52 | 3,035,651.18 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 84,165 | 160.10 | 13,474,816.50 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 75,690 | 74.88 | 5,667,667.20 |
| PEARSON PLC | 322,789 | 9.60 | 3,098,774.40 |
| WHITBREAD PLC | 109,945 | 36.01 | 3,959,119.45 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 416,016 | 7.30 | 3,036,916.80 |
| INFORMA PLC | 633,403 | 7.67 | 4,859,467.81 |
| WPP PLC | 481,002 | 7.66 | 3,684,475.32 |
| JD SPORTS FASHION PLC | 969,434 | 1.16 | 1,129,390.61 |
| KINGFISHER PLC | 1,064,697 | 2.21 | 2,361,497.94 |
| NEXT PLC | 54,333 | 84.94 | 4,615,045.02 |
| OCADO GROUP PLC | 232,705 | 5.68 | 1,322,229.81 |
| SAINSBURY (J) PLC | 864,017 | 2.81 | 2,431,343.83 |
| TESCO PLC | 3,342,831 | 2.98 | 9,988,379.02 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 178,973 | 23.54 | 4,213,024.42 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 982,145 | 22.92 | 22,515,674.12 |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 102,274 | 23.20 | 2,372,756.80 |
| DIAGEO PLC | 1,076,140 | 27.10 | 29,163,394.00 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 423,171 | 19.12 | 8,093,145.37 |
| HALEON PLC | 2,594,616 | 3.12 | 8,096,499.22 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 333,356 | 55.28 | 18,427,919.68 |
| UNILEVER PLC | 1,182,265 | 37.28 | 44,074,839.20 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 437,711 | 10.88 | 4,762,295.68 |

| | | | | |
|--------|-----------------------------|-------------|----------|-------------------------------------|
| | ASTRAZENECA PLC | 733,468 | 104.48 | 76,632,736.64 |
| | GSK PLC | 1,890,903 | 15.21 | 28,764,416.43 |
| | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 72,292 | 18.65 | 1,348,607.26 |
| | BARCLAYS PLC | 7,086,269 | 1.45 | 10,302,017.87 |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 9,247,274 | 6.04 | 55,936,760.42 |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 29,697,870 | 0.41 | 12,332,040.51 |
| | NATWEST GROUP PLC | 2,737,015 | 2.17 | 5,963,955.68 |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 1,015,012 | 5.92 | 6,014,961.11 |
| | 3I GROUP PLC | 456,215 | 23.74 | 10,830,544.10 |
| | ABRDN PLC | 805,516 | 1.71 | 1,383,070.97 |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 123,322 | 7.43 | 916,282.46 |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 193,266 | 90.86 | 17,560,148.76 |
| | M&G PLC | 928,249 | 2.25 | 2,094,129.74 |
| | SCHRODERS PLC | 321,906 | 4.17 | 1,342,348.02 |
| | ST JAMES' S PLACE PLC | 312,234 | 6.46 | 2,018,280.57 |
| | WISE PLC - A | 304,193 | 8.41 | 2,559,479.90 |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 117,270 | 25.10 | 2,943,477.00 |
| | AVIVA PLC | 1,237,039 | 4.34 | 5,368,749.26 |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 2,891,619 | 2.52 | 7,307,121.21 |
| | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 293,906 | 5.09 | 1,497,157.16 |
| | PRUDENTIAL PLC | 1,293,532 | 8.34 | 10,790,643.94 |
| | SAGE GROUP PLC/THE | 461,867 | 11.69 | 5,401,534.56 |
| | HALMA PLC | 162,680 | 21.65 | 3,522,022.00 |
| | BT GROUP PLC | 2,832,338 | 1.15 | 3,265,685.71 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 11,060,566 | 0.68 | 7,534,457.55 |
| | CENTRICA PLC | 2,355,857 | 1.44 | 3,398,323.72 |
| | NATIONAL GRID PLC | 1,699,858 | 10.26 | 17,440,543.08 |
| | SEVERN TRENT PLC | 124,470 | 24.98 | 3,109,260.60 |
| | SSE PLC | 513,218 | 17.39 | 8,924,861.02 |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 366,180 | 10.26 | 3,757,006.80 |
| | イギリスポンド 小計 | 128,357,052 | | 865,153,111.06 (162,320,026,697) |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 99,007 | 11.11 | 1,099,967.77 |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 3,236 | 647.50 | 2,095,310.00 |
| | GIVAUDAN-REG | 4,314 | 3,593.00 | 15,500,202.00 |
| | HOLCIM LTD | 241,980 | 64.24 | 15,544,795.20 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|------------|----------------|
| SIG GROUP AG | 122,800 | 18.52 | 2,274,256.00 |
| SIKA AG-REG | 71,276 | 237.60 | 16,935,177.60 |
| ABB LTD-REG | 777,543 | 36.58 | 28,442,522.94 |
| GEBERIT AG-REG | 16,014 | 501.20 | 8,026,216.80 |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 9,410 | 203.00 | 1,910,230.00 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 18,836 | 211.20 | 3,978,163.20 |
| VAT GROUP AG | 11,903 | 412.90 | 4,914,748.70 |
| ADECCO GROUP AG-REG | 67,953 | 36.73 | 2,495,913.69 |
| SGS SA-REG | 79,187 | 75.06 | 5,943,776.22 |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 25,931 | 290.10 | 7,522,583.10 |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 252,575 | 121.00 | 30,561,575.00 |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR | 15,105 | 195.80 | 2,957,559.00 |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG | 14,795 | 37.80 | 559,251.00 |
| AVOLTA AG | 36,100 | 31.96 | 1,153,756.00 |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 1,816 | 1,245.00 | 2,260,920.00 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 401 | 11,050.00 | 4,431,050.00 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 61 | 110,200.00 | 6,722,200.00 |
| NESTLE SA-REG | 1,261,390 | 96.20 | 121,345,718.00 |
| ALCON INC | 234,148 | 66.30 | 15,524,012.40 |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 22,022 | 276.40 | 6,086,880.80 |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG | 49,846 | 130.65 | 6,512,379.90 |
| BACHEM HOLDING AG | 12,632 | 55.75 | 704,234.00 |
| LONZA GROUP AG-REG | 35,188 | 370.30 | 13,030,116.40 |
| NOVARTIS AG-REG | 967,334 | 92.75 | 89,720,228.50 |
| ROCHE HOLDING AG-BR | 17,136 | 258.40 | 4,427,942.40 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 329,150 | 242.00 | 79,654,300.00 |
| SANDOZ GROUP AG | 196,209 | 28.77 | 5,644,932.93 |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 14,828 | 109.80 | 1,628,114.40 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 101,083 | 46.11 | 4,660,937.13 |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 10,659 | 1,141.00 | 12,161,919.00 |
| UBS GROUP AG-REG | 1,570,773 | 25.71 | 40,384,573.83 |
| BALOISE HOLDING AG - REG | 19,933 | 136.70 | 2,724,841.10 |
| HELVETIA HOLDING AG-REG | 20,883 | 123.90 | 2,587,403.70 |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 14,049 | 606.40 | 8,519,313.60 |
| SWISS RE AG | 141,186 | 98.84 | 13,954,824.24 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 69,917 | 441.80 | 30,889,330.60 |

| | | | | | |
|------|------------------------------|-----------|--------|-------------------------------------|--|
| | TEMENOS AG - REG | 22,921 | 86.70 | 1,987,250.70 | |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 78,349 | 74.28 | 5,819,763.72 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 12,427 | 516.00 | 6,412,332.00 | |
| | BKW AG | 9,300 | 136.30 | 1,267,590.00 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 41,126 | 87.85 | 3,612,919.10 | |
| | スイスフラン 小計 | 7,122,732 | | 644,592,032.67 (109,735,347,641) | |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 1,304,368 | 40.20 | 52,435,593.60 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 696,000 | 89.00 | 61,944,000.00 | |
| | XINYI GLASS HOLDINGS LTD | 656,000 | 7.17 | 4,703,520.00 | |
| | MTR CORP | 706,500 | 26.20 | 18,510,300.00 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 622,000 | 12.48 | 7,762,560.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 1,031,000 | 40.60 | 41,858,600.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 1,265,600 | 21.50 | 27,210,400.00 | |
| | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 894,300 | 11.92 | 10,660,056.00 | |
| | WH GROUP LTD | 3,953,000 | 4.85 | 19,172,050.00 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 1,548,000 | 19.22 | 29,752,560.00 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 379,500 | 82.95 | 31,479,525.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 569,900 | 245.00 | 139,625,500.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 5,538,000 | 65.05 | 360,246,900.00 | |
| | HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 1,589,000 | 9.45 | 15,016,050.00 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 253,000 | 46.00 | 11,638,000.00 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 706,000 | 61.95 | 43,736,700.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 5,821,348 | 5.62 | 32,715,975.76 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 675,500 | 46.00 | 31,073,000.00 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 978,868 | 35.75 | 34,994,531.00 | |
| | ESR GROUP LTD | 1,052,000 | 10.28 | 10,814,560.00 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 724,000 | 9.84 | 7,124,160.00 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 559,641 | 21.10 | 11,808,425.10 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 552,250 | 10.50 | 5,798,625.00 | |
| | SINO LAND CO | 1,247,400 | 8.13 | 10,141,362.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 663,500 | 76.05 | 50,459,175.00 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 221,500 | 61.80 | 13,688,700.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 500,800 | 15.50 | 7,762,400.00 | |
| | WHARF HOLDINGS LTD | 527,000 | 23.55 | 12,410,850.00 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 639,000 | 23.00 | 14,697,000.00 | |

| | | | | |
|-----------------------|------------------------------|------------|--------------|--------------------------------------|
| | 香港ドル 小計 | 35,874,975 | | 1,119,241,078.46 (21,142,463,972) |
| シンガポールドル | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 30,200 | 27.15 | 819,930.00 |
| | KEPPEL LTD | 801,600 | 6.90 | 5,531,040.00 |
| | SEATRIM LTD | 15,794,803 | 0.10 | 1,658,454.31 |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 754,200 | 3.86 | 2,911,212.00 |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 860,940 | 6.64 | 5,716,641.60 |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 2,772,500 | 0.97 | 2,703,187.50 |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 897,000 | 3.32 | 2,978,040.00 |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 839,600 | 31.92 | 26,800,032.00 |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 1,669,900 | 12.90 | 21,541,710.00 |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 593,000 | 28.15 | 16,692,950.00 |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 409,000 | 9.65 | 3,946,850.00 |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 3,586,960 | 2.40 | 8,608,704.00 |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 348,700 | 5.47 | 1,907,389.00 |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 1,026,100 | 2.92 | 2,996,212.00 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 224,100 | 6.19 | 1,387,179.00 | |
| UOL GROUP LTD | 194,000 | 6.20 | 1,202,800.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | 30,802,603 | | 107,402,331.41 (11,832,514,851) |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 743,217 | 8.52 | 6,332,208.84 |
| | EBOS GROUP LTD | 54,700 | 37.00 | 2,023,900.00 |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 253,197 | 23.70 | 6,000,768.90 |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 788,533 | 5.34 | 4,214,708.88 |
| | MERCURY NZ LTD | 288,052 | 6.54 | 1,883,860.08 |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 765,945 | 5.75 | 4,404,183.75 |
| | ニュージーランドドル 小計 | 2,893,644 | | 24,859,630.45 (2,242,338,666) |
| スウェーデンクローネ | BOLIDEN AB | 142,133 | 279.20 | 39,683,533.60 |
| | HOLMEN AB-B SHARES | 33,017 | 408.10 | 13,474,237.70 |
| | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 304,602 | 135.50 | 41,273,571.00 |
| | ALFA LAVAL AB | 125,173 | 372.90 | 46,677,011.70 |
| | ASSA ABLOY AB-B | 472,179 | 286.80 | 135,420,937.20 |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 1,246,081 | 163.90 | 204,232,675.90 |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 728,300 | 143.50 | 104,511,050.00 |
| | BEIJER REF AB | 158,800 | 126.10 | 20,024,680.00 |

| | | | | |
|------------------------------|------------|----------|--------------------------------------|--|
| EPIROC AB-A | 337,627 | 183.75 | 62,038,961.25 | |
| EPIROC AB-B | 163,208 | 164.50 | 26,847,716.00 | |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 159,232 | 80.54 | 12,824,545.28 | |
| INDUTRADE AB | 117,500 | 249.00 | 29,257,500.00 | |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 58,459 | 262.40 | 15,339,641.60 | |
| LIFCO AB-B SHS | 96,300 | 254.20 | 24,479,460.00 | |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 745,899 | 61.62 | 45,962,296.38 | |
| SAAB AB-B | 28,000 | 678.80 | 19,006,400.00 | |
| SANDVIK AB | 513,330 | 220.00 | 112,932,600.00 | |
| SKANSKA AB-B SHS | 145,633 | 172.95 | 25,187,227.35 | |
| SKF AB-B SHARES | 141,090 | 200.90 | 28,344,981.00 | |
| VOLVO AB-A SHS | 93,930 | 257.00 | 24,140,010.00 | |
| VOLVO AB-B SHS | 701,377 | 250.95 | 176,010,558.15 | |
| SECURITAS AB-B SHS | 235,929 | 100.95 | 23,817,032.55 | |
| VOLVO CAR AB-B | 207,500 | 26.76 | 5,552,700.00 | |
| EVOLUTION AB | 92,625 | 1,217.80 | 112,798,725.00 | |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 296,852 | 165.76 | 49,206,187.52 | |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 262,793 | 236.80 | 62,229,382.40 | |
| GETINGE AB-B SHS | 85,916 | 222.80 | 19,142,084.80 | |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 93,763 | 289.20 | 27,116,259.60 | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 801,012 | 151.85 | 121,633,672.20 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 699,118 | 115.60 | 80,818,040.80 | |
| SWEDBANK AB - A SHARES | 427,225 | 212.60 | 90,828,035.00 | |
| EQT AB | 179,352 | 277.00 | 49,680,504.00 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 44,871 | 327.00 | 14,672,817.00 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 89,196 | 327.20 | 29,184,931.20 | |
| INVESTOR AB-B SHS | 804,042 | 242.50 | 194,980,185.00 | |
| LUNDBERGS AB-B SHS | 43,685 | 536.20 | 23,423,897.00 | |
| ERICSSON LM-B SHS | 1,391,963 | 60.72 | 84,519,993.36 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 1,050,335 | 115.10 | 120,893,558.50 | |
| TELE2 AB-B SHS | 198,238 | 87.18 | 17,282,388.84 | |
| TELIA CO AB | 1,284,253 | 27.00 | 34,674,831.00 | |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 296,348 | 66.96 | 19,843,462.08 | |
| SAGAX AB-B | 105,140 | 251.00 | 26,390,140.00 | |
| スウェーデンクローネ 小計 | 15,202,026 | | 2,416,358,421.96 (34,143,144,502) | |

| | | | | |
|--------------|---------------------------|-----------|---------------|--------------------------------------|
| ノルウェークローネ | AKER BP ASA | 166,028 | 277.90 | 46,139,181.20 |
| | EQUINOR ASA | 448,379 | 298.85 | 133,998,064.15 |
| | NORSK HYDRO ASA | 701,222 | 61.92 | 43,419,666.24 |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 83,488 | 344.60 | 28,769,964.80 |
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 32,500 | 533.50 | 17,338,750.00 |
| | ADEVINTA ASA | 106,857 | 113.00 | 12,074,841.00 |
| | MOWI ASA | 204,936 | 186.25 | 38,169,330.00 |
| | ORKLA ASA | 312,992 | 82.82 | 25,921,997.44 |
| | SALMAR ASA | 25,891 | 580.00 | 15,016,780.00 |
| | DNB BANK ASA | 455,082 | 214.70 | 97,706,105.40 |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 69,251 | 172.70 | 11,959,647.70 |
| | TELENOR ASA | 333,379 | 121.35 | 40,455,541.65 |
| ノルウェークローネ 小計 | | 2,940,005 | | 510,969,869.58 (7,235,333,353) |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 52,601 | 556.00 | 29,246,156.00 |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 104,436 | 365.90 | 38,213,132.40 |
| | ROCKWOOL A/S-B SHS | 3,501 | 1,844.00 | 6,455,844.00 |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 476,792 | 195.18 | 93,060,262.56 |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-A | 2,050 | 12,820.00 | 26,281,000.00 |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 1,814 | 13,120.00 | 23,799,680.00 |
| | DSV A/S | 87,928 | 1,240.50 | 109,074,684.00 |
| | PANDORA A/S | 36,319 | 1,004.00 | 36,464,276.00 |
| | CARLSBERG AS-B | 43,500 | 875.80 | 38,097,300.00 |
| | COLOPLAST-B | 70,770 | 770.80 | 54,549,516.00 |
| | DEMANT A/S | 34,228 | 319.30 | 10,929,000.40 |
| | GENMAB A/S | 31,588 | 1,925.50 | 60,822,694.00 |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 1,543,411 | 723.90 | 1,117,275,222.90 |
| | DANSKE BANK A/S | 330,101 | 190.25 | 62,801,715.25 |
| | TRYG A/S | 186,282 | 148.40 | 27,644,248.80 |
| ORSTED A/S | 94,899 | 378.90 | 35,957,231.10 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 3,100,220 | | 1,770,671,963.41 (38,034,033,774) |
| イスラエルシェケル | ICL GROUP LTD | 299,785 | 17.25 | 5,171,291.25 |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 10,169 | 756.00 | 7,687,764.00 |
| | BANK HAPOALIM BM | 615,641 | 30.68 | 18,887,865.88 |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 662,777 | 27.00 | 17,894,979.00 |

| | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 759,946 | 17.02 | 12,934,280.92 |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 63,104 | 130.40 | 8,228,761.60 |
| | NICE LTD | 28,581 | 814.60 | 23,282,082.60 |
| | AZRIELI GROUP LTD | 14,806 | 238.70 | 3,534,192.20 |
| | イスラエルシェケル 小計 | 2,454,809 | | 97,621,217.45 (3,890,674,097) |
| ユーロ | ENI SPA | 1,100,840 | 14.56 | 16,034,835.44 |
| | GALP ENERGIA SGPS SA | 199,355 | 14.08 | 2,806,918.40 |
| | NESTE OYJ | 202,883 | 31.91 | 6,473,996.53 |
| | OMV AG | 76,362 | 39.23 | 2,995,681.26 |
| | REPSOL SA | 612,515 | 13.20 | 8,085,198.00 |
| | TENARIS SA | 206,256 | 14.97 | 3,088,683.60 |
| | TOTALENERGIES SE | 1,082,543 | 58.94 | 63,805,084.42 |
| | AIR LIQUIDE SA | 248,333 | 171.84 | 42,673,542.72 |
| | AKZO NOBEL N. V. | 78,085 | 70.36 | 5,494,060.60 |
| | ARCELORMITTAL | 211,797 | 25.32 | 5,362,700.04 |
| | ARKEMA | 35,633 | 100.85 | 3,593,588.05 |
| | BASF SE | 418,747 | 44.95 | 18,824,771.38 |
| | COVESTRO AG | 86,995 | 47.84 | 4,161,840.80 |
| | DSM-FIRMENICH AG | 88,644 | 95.11 | 8,430,930.84 |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 123,314 | 17.17 | 2,117,917.95 |
| | HEIDELBERG MATERIALS AG | 64,181 | 83.66 | 5,369,382.46 |
| | OCI NV | 34,955 | 25.10 | 877,370.50 |
| | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 112,656 | 36.25 | 4,083,780.00 |
| | STORA ENSO OYJ-R SHS | 298,391 | 11.84 | 3,532,949.44 |
| | SYENSCO SA | 42,756 | 82.16 | 3,512,832.96 |
| | SYMRISE AG | 58,459 | 95.26 | 5,568,804.34 |
| | UMICORE | 118,677 | 21.50 | 2,551,555.50 |
| | UPM-KYMMENE OYJ | 271,685 | 33.51 | 9,104,164.35 |
| | VOESTALPINE AG | 62,408 | 27.80 | 1,734,942.40 |
| | WACKER CHEMIE AG | 6,600 | 99.74 | 658,284.00 |
| | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 99,597 | 39.50 | 3,934,081.50 |
| | AIRBUS SE | 283,106 | 148.48 | 42,035,578.88 |
| | ALSTOM | 108,862 | 11.36 | 1,236,672.32 |
| | BOUYGUES SA | 83,366 | 35.12 | 2,927,813.92 |
| | BRENTAG SE | 71,852 | 79.20 | 5,690,678.40 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 212,659 | 63.44 | 13,491,086.96 |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 234,394 | 32.78 | 7,683,435.32 |
| DASSAULT AVIATION SA | 9,266 | 172.10 | 1,594,678.60 |
| EIFFAGE | 38,587 | 98.40 | 3,796,960.80 |
| FERROVIAL SE | 265,630 | 35.08 | 9,318,300.40 |
| GEA GROUP AG | 66,562 | 36.08 | 2,401,556.96 |
| IMCD NV | 29,880 | 141.45 | 4,226,526.00 |
| KINGSPAN GROUP PLC | 69,503 | 74.66 | 5,189,093.98 |
| KNORR-BREMSE AG | 40,814 | 56.92 | 2,323,132.88 |
| KONE OYJ-B | 163,769 | 44.73 | 7,325,387.37 |
| LEGRAND SA | 126,050 | 90.30 | 11,382,315.00 |
| LEONARDO SPA | 188,516 | 16.40 | 3,091,662.40 |
| METSO CORP | 279,500 | 9.25 | 2,586,493.00 |
| MTU AERO ENGINES AG | 22,956 | 218.90 | 5,025,068.40 |
| PRYSMIAN SPA | 139,842 | 40.55 | 5,670,593.10 |
| RATIONAL AG | 2,060 | 725.00 | 1,493,500.00 |
| RHEINMETALL AG | 18,567 | 327.80 | 6,086,262.60 |
| SAFRAN SA | 158,925 | 171.92 | 27,322,386.00 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 260,058 | 182.70 | 47,512,596.60 |
| SIEMENS AG-REG | 361,904 | 167.20 | 60,510,348.80 |
| SIEMENS ENERGY AG | 300,754 | 13.48 | 4,054,163.92 |
| THALES SA | 52,989 | 135.20 | 7,164,112.80 |
| VINCI SA | 232,766 | 117.80 | 27,419,834.80 |
| WARTSILA OYJ ABP | 210,609 | 13.35 | 2,812,683.19 |
| BUREAU VERITAS SA | 155,284 | 24.40 | 3,788,929.60 |
| RANDSTAD NV | 52,875 | 52.10 | 2,754,787.50 |
| TELEPERFORMANCE | 29,501 | 143.75 | 4,240,768.75 |
| WOLTERS KLUWER | 116,141 | 139.10 | 16,155,213.10 |
| ADP | 17,115 | 124.00 | 2,122,260.00 |
| AENA SME SA | 33,377 | 163.05 | 5,442,119.85 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 227,150 | 7.77 | 1,765,864.10 |
| DHL GROUP | 460,969 | 45.27 | 20,870,371.47 |
| GETLINK SE | 172,576 | 16.21 | 2,798,319.84 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 149,908 | 93.69 | 14,044,880.52 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 27,087 | 87.75 | 2,376,884.25 |
| CONTINENTAL AG | 51,684 | 73.10 | 3,778,100.40 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|---------------|
| DR ING HC F PORSCHE AG | 48,570 | 73.98 | 3,593,208.60 |
| FERRARI NV | 59,116 | 306.30 | 18,107,230.80 |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 373,608 | 59.75 | 22,323,078.00 |
| MICHELIN (CGDE) | 320,149 | 31.14 | 9,969,439.86 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 65,951 | 45.24 | 2,983,623.24 |
| RENAULT SA | 87,484 | 34.21 | 2,992,827.64 |
| STELLANTIS NV | 1,035,189 | 19.42 | 20,105,440.75 |
| VOLKSWAGEN AG | 12,382 | 124.90 | 1,546,511.80 |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 106,660 | 114.84 | 12,248,834.40 |
| ADIDAS AG | 76,347 | 175.68 | 13,412,640.96 |
| HERMES INTERNATIONAL | 15,244 | 1,844.00 | 28,109,936.00 |
| KERING | 35,172 | 361.00 | 12,697,092.00 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 131,366 | 685.30 | 90,025,119.80 |
| MONCLER SPA | 104,582 | 51.86 | 5,423,622.52 |
| PUMA SE | 43,656 | 37.70 | 1,645,831.20 |
| SEB SA | 9,694 | 107.40 | 1,041,135.60 |
| ACCOR SA | 103,418 | 36.77 | 3,802,679.86 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 213,500 | 65.54 | 13,992,790.00 |
| DELIVERY HERO SE | 67,819 | 23.35 | 1,583,912.74 |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 37,870 | 37.50 | 1,420,125.00 |
| SODEXO SA | 38,147 | 100.40 | 3,829,958.80 |
| BOLLORE SE | 416,392 | 5.90 | 2,456,712.80 |
| PUBLICIS GROUPE | 108,739 | 91.96 | 9,999,638.44 |
| SCOUT24 SE | 41,543 | 66.98 | 2,782,550.14 |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 387,646 | 27.80 | 10,776,558.80 |
| VIVENDI SE | 296,979 | 10.05 | 2,984,638.95 |
| D'IETTEREN GROUP | 8,226 | 185.50 | 1,525,923.00 |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 509,506 | 39.14 | 19,942,064.84 |
| PROSUS NV | 681,830 | 28.10 | 19,162,832.15 |
| ZALANDO SE | 89,391 | 18.48 | 1,651,945.68 |
| CARREFOUR SA | 266,829 | 15.99 | 4,267,929.85 |
| HELLOFRESH SE | 67,988 | 12.95 | 880,784.54 |
| JERONIMO MARTINS | 116,013 | 20.78 | 2,410,750.14 |
| KESKO OYJ-B SHS | 133,348 | 17.08 | 2,278,250.58 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 473,580 | 25.79 | 12,215,996.10 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 402,757 | 57.20 | 23,037,700.40 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| DANONE | 299,604 | 61.10 | 18,305,804.40 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 367,895 | 8.98 | 3,303,697.10 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 65,661 | 75.60 | 4,963,971.60 |
| HEINEKEN NV | 135,072 | 90.72 | 12,253,731.84 |
| JDE PEET'S NV | 53,600 | 22.26 | 1,193,136.00 |
| KERRY GROUP PLC-A | 67,171 | 80.40 | 5,400,548.40 |
| LOTUS BAKERIES | 163 | 7,800.00 | 1,271,400.00 |
| PERNOD RICARD SA | 96,309 | 145.15 | 13,979,251.35 |
| REMY COINTREAU | 9,646 | 87.92 | 848,076.32 |
| BEIERSDORF AG | 49,302 | 133.15 | 6,564,561.30 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 57,972 | 63.52 | 3,682,381.44 |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 74,805 | 71.50 | 5,348,557.50 |
| L'OREAL | 114,320 | 432.40 | 49,431,968.00 |
| AMPLIFON SPA | 42,891 | 29.85 | 1,280,296.35 |
| BIOMERIEUX | 22,555 | 104.20 | 2,350,231.00 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 15,246 | 98.48 | 1,501,426.08 |
| DIASORIN SPA | 9,103 | 84.64 | 770,477.92 |
| ESSILORLUXOTTICA | 136,282 | 178.34 | 24,304,531.88 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG | 102,446 | 36.33 | 3,721,863.18 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 203,543 | 26.60 | 5,414,243.80 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 348,313 | 21.19 | 7,382,494.03 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 135,148 | 51.38 | 6,943,904.24 |
| ARGENX SE | 29,300 | 346.90 | 10,164,170.00 |
| BAYER AG-REG | 462,145 | 32.62 | 15,077,480.62 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 69,815 | 56.34 | 3,933,377.10 |
| GRIFOLS SA | 126,564 | 9.40 | 1,189,701.60 |
| IPSEN | 13,860 | 107.00 | 1,483,020.00 |
| MERCK KGAA | 63,907 | 147.10 | 9,400,719.70 |
| ORION OYJ-CLASS B | 50,154 | 43.78 | 2,195,742.12 |
| QIAGEN N. V. | 109,292 | 40.58 | 4,435,069.36 |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 42,431 | 49.98 | 2,120,701.38 |
| SANOFI | 539,583 | 91.68 | 49,468,969.44 |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 12,941 | 301.90 | 3,906,887.90 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 13,983 | 227.50 | 3,181,132.50 |
| UCB SA | 56,484 | 85.60 | 4,835,030.40 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 220,601 | 13.69 | 3,021,130.69 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|---------------|
| AIB GROUP PLC | 598,464 | 3.99 | 2,392,659.07 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 2,773,197 | 8.09 | 22,435,163.73 |
| BANCO BPM SPA | 558,757 | 4.86 | 2,715,559.02 |
| BANCO SANTANDER SA | 7,500,284 | 3.63 | 27,226,030.92 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 523,076 | 8.20 | 4,290,269.35 |
| BNP PARIBAS | 507,121 | 61.69 | 31,284,294.49 |
| CAIXABANK SA | 1,977,800 | 3.83 | 7,592,774.20 |
| COMMERZBANK AG | 473,485 | 10.54 | 4,992,899.32 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 530,480 | 13.42 | 7,119,041.60 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 176,125 | 39.97 | 7,039,716.25 |
| FINECOBANK SPA | 345,273 | 13.77 | 4,754,409.21 |
| ING GROEP NV | 1,675,175 | 13.00 | 21,783,975.70 |
| INTESA SANPAOLO | 7,250,838 | 2.80 | 20,360,353.10 |
| KBC GROUP NV | 121,247 | 59.94 | 7,267,545.18 |
| MEDIOBANCA SPA | 227,881 | 12.07 | 2,750,523.67 |
| NORDEA BANK ABP | 1,484,195 | 11.47 | 17,035,590.21 |
| SOCIETE GENERALE SA | 349,442 | 23.57 | 8,236,347.94 |
| UNICREDIT SPA | 748,981 | 26.52 | 19,862,976.12 |
| ADYEN NV | 10,255 | 1,147.60 | 11,768,638.00 |
| AMUNDI SA | 42,569 | 64.15 | 2,730,801.35 |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 914,013 | 12.08 | 11,041,277.04 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 89,168 | 185.35 | 16,527,288.80 |
| EDENRED | 121,828 | 56.62 | 6,897,901.36 |
| EURAZEO SE | 19,619 | 76.65 | 1,503,796.35 |
| EURONEXT NV | 35,304 | 81.50 | 2,877,276.00 |
| EXOR NV | 41,814 | 86.28 | 3,607,711.92 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV | 40,261 | 69.58 | 2,801,360.38 |
| NEXI SPA | 224,714 | 7.25 | 1,629,625.92 |
| SOFINA | 5,291 | 222.20 | 1,175,660.20 |
| WORLDLINE SA | 93,323 | 13.78 | 1,285,990.94 |
| AEGON LTD | 703,492 | 5.55 | 3,905,787.58 |
| AGEAS | 64,112 | 39.47 | 2,530,500.64 |
| ALLIANZ SE-REG | 192,387 | 246.85 | 47,490,730.95 |
| ASR NEDERLAND NV | 90,641 | 43.45 | 3,938,351.45 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 510,440 | 20.35 | 10,387,454.00 |
| AXA SA | 825,398 | 30.75 | 25,380,988.50 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| HANNOVER RUECK SE | 29,464 | 223.20 | 6,576,364.80 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 63,381 | 396.00 | 25,098,876.00 |
| NN GROUP NV | 133,570 | 37.69 | 5,034,253.30 |
| POSTE ITALIANE SPA | 269,406 | 10.27 | 2,766,799.62 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 216,081 | 38.35 | 8,287,786.75 |
| TALANX AG | 40,850 | 66.35 | 2,710,397.50 |
| BECHTLE AG | 39,938 | 48.61 | 1,941,386.18 |
| CAPGEMINI SE | 76,299 | 206.00 | 15,717,594.00 |
| DASSAULT SYSTEMES SE | 314,049 | 47.75 | 14,997,409.99 |
| NEMETSCHEK SE | 20,683 | 86.52 | 1,789,493.16 |
| SAP SE | 496,370 | 160.76 | 79,796,441.20 |
| NOKIA OYJ | 2,388,442 | 3.50 | 8,365,518.10 |
| CELLNEX TELECOM SA | 270,592 | 35.15 | 9,511,308.80 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 1,496,387 | 23.24 | 34,783,515.81 |
| ELISA OYJ | 64,406 | 43.66 | 2,811,965.96 |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 180,053 | 11.19 | 2,014,793.07 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 1,430,285 | 3.15 | 4,515,409.74 |
| ORANGE | 885,440 | 11.22 | 9,939,949.44 |
| TELECOM ITALIA SPA | 3,630,827 | 0.28 | 1,025,708.62 |
| TELEFONICA SA | 2,489,293 | 3.79 | 9,446,866.93 |
| ACCIONA SA | 13,178 | 120.60 | 1,589,266.80 |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA | 19,200 | 24.14 | 463,488.00 |
| E.ON SE | 1,059,449 | 12.42 | 13,158,356.58 |
| EDP RENOVAVEIS SA | 131,444 | 15.39 | 2,023,580.38 |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 1,417,284 | 4.20 | 5,961,096.50 |
| ELIA GROUP SA/NV | 10,658 | 109.00 | 1,161,722.00 |
| ENAGAS SA | 120,868 | 15.11 | 1,826,315.48 |
| ENDESA SA | 138,773 | 18.65 | 2,588,116.45 |
| ENEL SPA | 3,753,747 | 6.29 | 23,633,591.11 |
| ENGIE | 849,060 | 15.16 | 12,875,145.84 |
| FORTUM OYJ | 180,538 | 12.61 | 2,277,486.87 |
| IBERDROLA SA | 2,920,996 | 11.07 | 32,335,425.72 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 45,200 | 25.32 | 1,144,464.00 |
| REDEIA CORP SA | 164,909 | 14.86 | 2,451,372.28 |
| RWE AG | 297,867 | 36.63 | 10,910,868.21 |
| SNAM SPA | 1,023,585 | 4.49 | 4,602,038.16 |

| | | | | | |
|--|------------------------------|-------------|--------|--|--|
| | TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA | 620,192 | 7.67 | 4,759,353.40 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 322,215 | 29.29 | 9,437,677.35 | |
| | VERBUND AG | 28,497 | 75.50 | 2,151,523.50 | |
| | ASM INTERNATIONAL NV | 22,765 | 532.10 | 12,113,256.50 | |
| | ASML HOLDING NV | 190,528 | 811.80 | 154,670,630.40 | |
| | BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES | 37,508 | 148.85 | 5,583,065.80 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 608,411 | 34.64 | 21,078,399.09 | |
| | STMICROELECTRONICS NV | 318,885 | 42.40 | 13,522,318.42 | |
| | LEG IMMOBILIEN SE | 30,299 | 74.64 | 2,261,517.36 | |
| | VONOVIA SE | 351,637 | 27.48 | 9,662,984.76 | |
| | ユーロ 小計 | 83,734,837 | | 2,296,244,493.17 (367,789,480,471) | |
| | 合 計 | 524,454,386 | | 3,915,150,753,773 (3,915,150,753,773) | |

(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 | 79,058 | 9,757,338.36 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 145,112 | 5,055,702.08 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 222,042 | 44,455,028.82 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 65,840 | 11,595,740.80 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 73,566 | 5,259,969.00 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 53,715 | 5,149,119.90 | |
| | | CROWN CASTLE INC | 200,910 | 22,262,837.10 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 140,398 | 19,963,191.62 | |
| | | EQUINIX INC | 44,658 | 36,410,113.98 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 76,761 | 5,093,092.35 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 167,784 | 9,875,766.24 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 32,716 | 7,652,926.72 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 98,497 | 14,659,308.51 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 109,823 | 5,057,349.15 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 255,134 | 4,939,394.24 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 308,081 | 6,029,145.17 | |

| | | | | | |
|-------------|------|------------------------------|------------|------------------------------------|--|
| | | INVITATION HOMES INC | 287,206 | 9,552,471.56 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 147,169 | 10,070,774.67 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 326,157 | 6,806,896.59 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 56,210 | 7,418,595.80 | |
| | | PROLOGIS INC | 441,468 | 55,713,261.60 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 73,090 | 21,318,891.20 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 392,395 | 21,746,530.90 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 73,940 | 4,729,941.80 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 50,841 | 11,823,074.55 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 150,503 | 21,496,343.49 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 64,459 | 8,048,350.74 | |
| | | UDR INC | 153,355 | 5,602,058.15 | |
| | | VENTAS INC | 188,835 | 8,958,332.40 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 466,185 | 14,227,966.20 | |
| | | WELLTOWER INC | 239,095 | 20,853,865.90 | |
| | | WEYERHAEUSER CO | 342,960 | 11,427,427.20 | |
| | | WP CAREY INC | 102,063 | 6,477,938.61 | |
| アメリカドル合計 | | | 5,630,026 | 459,488,745.40 (67,866,487,695) | |
| カナダドル | 投資証券 | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 36,100 | 1,685,148.00 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 58,600 | 1,075,310.00 | |
| カナダドル合計 | | | 94,700 | 2,760,458.00 (302,546,196) | |
| オーストラリアドル | 投資証券 | DEXUS/AU | 603,939 | 4,457,069.82 | |
| | | GOODMAN GROUP | 846,882 | 21,104,299.44 | |
| | | GPT GROUP | 891,183 | 3,930,117.03 | |
| | | MIRVAC GROUP | 2,214,980 | 4,629,308.20 | |
| | | SCENTRE GROUP | 2,622,903 | 7,606,418.70 | |
| | | STOCKLAND | 1,030,265 | 4,461,047.45 | |
| | | VICINITY CENTRES | 1,843,215 | 3,594,269.25 | |
| オーストラリアドル合計 | | | 10,053,367 | 49,782,529.89 (4,840,355,381) | |
| イギリスポンド | 投資証券 | LAND SECURITIES GROUP PLC | 352,124 | 2,302,890.96 | |
| | | SEGRO PLC | 575,702 | 4,900,375.42 | |
| イギリスポンド合計 | | | 927,826 | 7,203,266.38 (1,351,476,838) | |

| | | | | | |
|------------|------|------------------------------|-----------|------------------------------------|--|
| 香港ドル | 投資証券 | LINK REIT | 1,142,000 | 44,766,400.00 | |
| 香港ドル合計 | | | 1,142,000 | 44,766,400.00 (845,637,296) | |
| シンガポールドル | 投資証券 | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 1,488,200 | 4,330,662.00 | |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 2,977,171 | 5,835,255.16 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,470,700 | 2,294,292.00 | |
| | | MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 1,782,700 | 2,549,261.00 | |
| シンガポールドル合計 | | | 7,718,771 | 15,009,470.16 (1,653,593,327) | |
| ユーロ | 投資証券 | COVIVIO | 26,523 | 1,199,900.52 | |
| | | GECINA SA | 24,517 | 2,544,864.60 | |
| | | KLEPIERRE | 90,686 | 2,143,817.04 | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 64,908 | 4,367,010.24 | |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 70,808 | 1,867,915.04 | |
| ユーロ合計 | | | 277,442 | 12,123,507.44 (1,941,822,186) | |
| 合計 | | | | 78,801,918,919 (78,801,918,919) | |

(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 589 銘柄 | 97.75% | — | 73.77% |
| | 投資証券 33 銘柄 | — | 2.25% | 1.70% |
| カナダドル | 株式 86 銘柄 | 99.77% | — | 3.31% |
| | 投資証券 2 銘柄 | — | 0.23% | 0.01% |
| オーストラリアドル | 株式 51 銘柄 | 94.17% | — | 1.96% |
| | 投資証券 7 銘柄 | — | 5.83% | 0.12% |
| イギリスポンド | 株式 81 銘柄 | 99.17% | — | 4.06% |
| | 投資証券 2 銘柄 | — | 0.83% | 0.03% |
| スイスフラン | 株式 45 銘柄 | 100.00% | — | 2.75% |
| 香港ドル | 株式 29 銘柄 | 96.15% | — | 0.53% |
| | 投資証券 1 銘柄 | — | 3.85% | 0.02% |
| シンガポールドル | 株式 16 銘柄 | 87.74% | — | 0.30% |
| | 投資証券 4 銘柄 | — | 12.26% | 0.04% |
| ニュージーランドドル | 株式 6 銘柄 | 100.00% | — | 0.06% |

| | | | | | |
|------------|------|--------|---------|-------|-------|
| スウェーデンクローネ | 株式 | 42 銘柄 | 100.00% | — | 0.85% |
| ノルウェークローネ | 株式 | 12 銘柄 | 100.00% | — | 0.18% |
| デンマーククローネ | 株式 | 16 銘柄 | 100.00% | — | 0.95% |
| イスラエルシェケル | 株式 | 8 銘柄 | 100.00% | — | 0.10% |
| ユーロ | 株式 | 220 銘柄 | 99.47% | — | 9.21% |
| | 投資証券 | 5 銘柄 | — | 0.53% | 0.05% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

| | |
|-------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 19,396,038,261 |
| コール・ローン | 1,630,072,450 |
| 株式 | 593,681,414,280 |
| 投資証券 | 816,157,511 |
| 派生商品評価勘定 | 99,489,243 |
| 未収配当金 | 698,863,967 |
| 差入委託証拠金 | 4,024,357,627 |
| 流動資産合計 | 620,346,393,339 |
| 資産合計 | 620,346,393,339 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 216,898,654 |
| 未払金 | 1,458,218,177 |
| 未払解約金 | 225,594,314 |
| 未払利息 | 416 |
| 流動負債合計 | 1,900,711,561 |
| 負債合計 | 1,900,711,561 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 179,683,584,344 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 438,762,097,434 |
| 元本等合計 | 618,445,681,778 |
| 純資産合計 | 618,445,681,778 |
| 負債純資産合計 | 620,346,393,339 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

1. ロシア株式（以下、「当該株式」）の時価の算定

(1) 当期の財務諸表に計上した金額

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

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

① 当期の財務諸表に計上した金額の算出方法及び算出に用いた主要な仮定

2022 年 2 月 24 日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構や SWIFT からの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。

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

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

② 翌期の財務諸表への影響

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

(貸借対照表に関する注記)

| | | [2024 年 1 月 26 日現在] |
|-----------------------------|--|---------------------|
| 1. 期首 | | 2023 年 1 月 27 日 |
| 期首元本額 | | 126,395,162,676 円 |
| 期中追加設定元本額 | | 75,059,257,681 円 |
| 期中一部解約元本額 | | 21,770,836,013 円 |
| 元本の内訳※ | | |
| MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信 | | 1,100,156,670 円 |
| eMAXIS 新興国株式インデックス | | 10,506,528,385 円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型） | | 1,767,483,527 円 |
| eMAXIS バランス（波乗り型） | | 54,786,673 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金） | | 601,956,890 円 |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型） | | 8,884,890,161 円 |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス | | 38,273,046,058 円 |
| つみたて新興国株式 | | 8,304,027,934 円 |

| | |
|-----------------------------------|------------------|
| つみたて8資産均等バランス | 4,348,198,825円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 597,226円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 1,746,946円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 7,336,977円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本) | 12,070,632,706円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型) | 1,069,741,242円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カンントリー) | 65,102,683,575円 |
| 新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け) | 2,949,018,252円 |
| つみたて全世界株式 | 226,786,084円 |
| ラップ向けインデックスf 新興国株式 | 943,928,101円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 47,918,887円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型) | 1,257,630,099円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型) | 1,000,310,649円 |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド | 16,601,657,230円 |
| 新興国株式インデックスオープン | 434,421,412円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 1,211,403,025円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 140,834,201円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 35,478,076円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 209,703,466円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 225,272,658円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 933,195,358円 |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定) | 1,086,853,447円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 18,449,234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) | 12,122,599円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 54,049,359円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 52,940,703円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定) | 53,411,773円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 47,269,664円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定) | 47,116,272円 |
| 合計 | 179,683,584,344円 |
| 2. 受益権の総数 | 179,683,584,344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1月27日 至 2024年1月26日 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有してお</p> |

| | |
|-------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |
|-------------------|--|

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [2024年 1月 26日現在] |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年 1月 26日現在] | |
|------|--------------------|--|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | |
| 株式 | 12,186,759,164 | |
| 投資証券 | 82,683,756 | |
| 合計 | 12,269,442,920 | |

(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 1月 26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|----------|----------------|-------|----------------|--------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 24,932,305,752 | — | 24,816,223,152 | △116,082,600 |
| 合計 | | 24,932,305,752 | — | 24,816,223,152 | △116,082,600 |

(注) 時価の算定方法

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

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[2024年1月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|------------------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 アメリカドル | 2,253,155,749 | — | 2,251,828,938 | △1,326,811 |
| 合計 | | 2,253,155,749 | — | 2,251,828,938 | △1,326,811 |

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| | [2024年1月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 3.4419円 |
| (1万口当たり純資産額) | (34,419円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|--------|-----------------------------|-----------|------|------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | GAZPROM PJSC | 3,587,358 | — | — | |
| | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 535,200 | 1.71 | 917,868.00 | |
| | LUKOIL PJSC | 122,600 | — | — | |
| | NOVATEK PJSC | 282,700 | — | — | |
| | ROSNEFT OIL CO PJSC | 384,962 | — | — | |
| | SURGUTNEFTEGAS PJSC | 2,405,300 | — | — | |

| | | | |
|-------------------------------|---------------|--------|---------------|
| SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE | 2,315,000 | — | — |
| TATNEFT PJSC | 455,759 | — | — |
| ALROSA PJSC | 745,960 | — | — |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 130,323 | 14.86 | 1,936,599.78 |
| MMC NORILSK NICKEL PJSC | 19,483 | — | — |
| NOVOLIPETSK STEEL PJSC | 439,080 | — | — |
| PHOSAGRO PJSC-GDR REG S | 53,979 | — | — |
| POLYUS PJSC | 10,871 | — | — |
| SEVERSTAL PJSC | 62,882 | — | — |
| SOUTHERN COPPER CORP | 44,613 | 83.82 | 3,739,461.66 |
| UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL | 1,071,810 | — | — |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 257,421 | 17.24 | 4,437,938.04 |
| NIO INC - ADR | 840,560 | 6.04 | 5,076,982.40 |
| H WORLD GROUP LTD-ADR | 113,799 | 33.77 | 3,842,992.23 |
| TAL EDUCATION GROUP- ADR | 267,204 | 11.94 | 3,190,415.76 |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 247,154 | 35.64 | 8,808,568.56 |
| AUTOHOME INC-ADR | 38,791 | 25.00 | 969,775.00 |
| IQIYI INC-ADR | 241,668 | 3.58 | 865,171.44 |
| JOYY INC-ADR | 22,862 | 31.59 | 722,210.58 |
| KANZHUN LTD - ADR | 114,579 | 14.13 | 1,619,001.27 |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 454,971 | 8.91 | 4,053,791.61 |
| WEIBO CORP-SPON ADR | 33,274 | 8.52 | 283,494.48 |
| YANDEX NV-A | 92,564 | — | — |
| OZON HOLDINGS PLC - ADR | 20,405 | — | — |
| PDD HOLDINGS INC | 352,077 | 144.43 | 50,850,481.11 |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 210,499 | 15.95 | 3,357,459.05 |
| MAGNIT PJSC | 23,556 | — | — |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 34,286 | — | — |
| LEGEND BIOTECH CORP-ADR | 39,400 | 58.13 | 2,290,322.00 |
| COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 2,642,213 | 1.09 | 2,880,012.17 |
| CREDICORP LTD | 41,945 | 148.93 | 6,246,868.85 |
| SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 796,628 | — | — |
| TCS GROUP HOLDING-GDR REG S | 38,258 | — | — |
| VTB BANK PJSC | 1,305,990,000 | — | — |
| LUFAX HOLDING LTD-ADR | 112,919 | 2.52 | 284,555.88 |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 425,170 | — | — |

| | | | | | |
|------|------------------------------|---------------|-------|------------------------------------|--|
| | QIFU TECHNOLOGY INC | 54,200 | 14.84 | 804,328.00 | |
| | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 320,772 | 2.05 | 659,507.23 | |
| | VK IPJSC | 34,689 | — | — | |
| | MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO | 172,850 | — | — | |
| | INTER RAO UES PJSC | 12,239,000 | — | — | |
| | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR | 30,320 | 19.66 | 596,091.20 | |
| | KE HOLDINGS INC-ADR | 393,483 | 14.43 | 5,677,959.69 | |
| | アメリカドル 小計 | 1,339,365,397 | | 114,111,855.99 (16,854,321,129) | |
| 香港ドル | CHINA COAL ENERGY CO-H | 1,149,000 | 8.57 | 9,846,930.00 | |
| | CHINA OILFIELD SERVICES-H | 1,104,000 | 7.28 | 8,037,120.00 | |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 14,700,000 | 4.14 | 60,858,000.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 1,996,000 | 29.55 | 58,981,800.00 | |
| | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H | 628,000 | 7.98 | 5,011,440.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-H | 14,125,000 | 5.67 | 80,088,750.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO-H | 1,301,000 | 16.36 | 21,284,360.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 2,018,000 | 3.85 | 7,769,300.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 628,000 | 16.24 | 10,198,720.00 | |
| | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 1,420,500 | 5.90 | 8,380,950.00 | |
| | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 2,036,000 | 2.95 | 6,006,200.00 | |
| | CMOC GROUP LTD-H | 2,154,000 | 4.41 | 9,499,140.00 | |
| | GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H | 185,120 | 24.60 | 4,553,952.00 | |
| | JIANGXI COPPER CO LTD-H | 679,000 | 11.36 | 7,713,440.00 | |
| | NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 722,000 | 3.08 | 2,223,760.00 | |
| | SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 465,250 | 11.84 | 5,508,560.00 | |
| | ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H | 660,000 | 8.04 | 5,306,400.00 | |
| | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 3,256,000 | 12.36 | 40,244,160.00 | |
| | AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 1,247,000 | 3.06 | 3,815,820.00 | |
| | BOC AVIATION LTD | 97,300 | 59.40 | 5,779,620.00 | |
| | CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 1,132,000 | 3.24 | 3,667,680.00 | |
| | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 2,285,000 | 3.67 | 8,385,950.00 | |
| | CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 570,000 | 8.60 | 4,902,000.00 | |
| | CITIC LTD | 3,377,000 | 7.46 | 25,192,420.00 | |
| | CRRC CORP LTD - H | 2,519,000 | 3.65 | 9,194,350.00 | |
| | FOSUN INTERNATIONAL LTD | 1,324,500 | 4.42 | 5,854,290.00 | |
| | HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 339,000 | 17.22 | 5,837,580.00 | |

| | | | |
|-------------------------------|-----------|--------|----------------|
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL | 537,000 | 5.61 | 3,012,570.00 |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 316,000 | 17.24 | 5,447,840.00 |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 982,800 | 14.10 | 13,857,480.00 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H | 268,300 | 20.70 | 5,553,810.00 |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 1,958,111 | 2.77 | 5,423,967.47 |
| AIR CHINA LTD-H | 1,220,000 | 4.71 | 5,746,200.00 |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 788,000 | 10.28 | 8,100,640.00 |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 1,190,000 | 3.17 | 3,772,300.00 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 1,515,600 | 8.38 | 12,700,728.00 |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 654,000 | 5.55 | 3,629,700.00 |
| JD LOGISTICS INC | 1,037,800 | 7.76 | 8,053,328.00 |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 806,000 | 7.76 | 6,254,560.00 |
| ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 68,000 | 118.00 | 8,024,000.00 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 1,034,000 | 5.98 | 6,183,320.00 |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 1,694,000 | 4.45 | 7,538,300.00 |
| BYD CO LTD-H | 646,000 | 198.40 | 128,166,400.00 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 1,236,000 | 3.19 | 3,942,840.00 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 319,200 | 36.00 | 11,491,200.00 |
| GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 3,323,000 | 7.94 | 26,384,620.00 |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-H | 1,278,000 | 8.50 | 10,863,000.00 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 1,458,945 | 3.29 | 4,799,929.05 |
| LI AUTO INC-CLASS A | 686,044 | 111.30 | 76,356,697.20 |
| MINTH GROUP LTD | 364,000 | 12.16 | 4,426,240.00 |
| XPENG INC - CLASS A SHARES | 662,824 | 35.95 | 23,828,522.80 |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 604,000 | 11.72 | 7,078,880.00 |
| ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG | 289,400 | 21.65 | 6,265,510.00 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 890,800 | 70.65 | 62,935,020.00 |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 2,144,000 | 3.66 | 7,847,040.00 |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | 1,487,000 | 22.40 | 33,308,800.00 |
| LI NING CO LTD | 1,506,500 | 17.30 | 26,062,450.00 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 502,400 | 73.00 | 36,675,200.00 |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS | 876,500 | 4.15 | 3,637,475.00 |
| EAST BUY HOLDING LTD | 237,500 | 24.20 | 5,747,500.00 |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 879,000 | 13.56 | 11,919,240.00 |
| MEITUAN-CLASS B | 2,971,220 | 69.40 | 206,202,668.00 |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 889,780 | 62.50 | 55,611,250.00 |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|--------|------------------|--|
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT | 630,000 | 16.64 | 10,483,200.00 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 548,000 | 8.64 | 4,734,720.00 | |
| TRIP.COM GROUP LTD | 344,229 | 290.20 | 99,895,255.80 | |
| BAIDU INC-CLASS A | 1,362,674 | 106.80 | 145,533,583.20 | |
| BILIBILI INC-CLASS Z | 101,435 | 77.80 | 7,891,643.00 | |
| CHINA LITERATURE LTD | 220,600 | 27.30 | 6,022,380.00 | |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD | 2,556,000 | 1.60 | 4,089,600.00 | |
| KINGSOFT CORP LTD | 568,000 | 20.75 | 11,786,000.00 | |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | 1,403,000 | 44.60 | 62,573,800.00 | |
| NETEASE INC | 1,146,895 | 161.50 | 185,223,542.50 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 3,933,700 | 290.80 | 1,143,919,960.00 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 9,602,200 | 73.35 | 704,321,370.00 | |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H | 62,300 | 75.40 | 4,697,420.00 | |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 1,037,600 | 11.40 | 11,828,640.00 | |
| JD.COM INC-CLASS A | 1,411,533 | 93.50 | 131,978,335.50 | |
| MINISO GROUP HOLDING LTD | 187,832 | 39.55 | 7,428,755.60 | |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP | 231,000 | 19.04 | 4,398,240.00 | |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 970,000 | 5.32 | 5,160,400.00 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 638,500 | 15.28 | 9,756,280.00 | |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 2,846,000 | 3.26 | 9,277,960.00 | |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 702,550 | 29.15 | 20,479,332.50 | |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 308,400 | 13.60 | 4,194,240.00 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 66,063 | 104.53 | 6,905,565.39 | |
| CHINA FEIHE LTD | 2,716,000 | 3.84 | 10,429,440.00 | |
| CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS | 372,000 | — | — | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 1,996,000 | 17.26 | 34,450,960.00 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 1,016,000 | 30.15 | 30,632,400.00 | |
| NONGFU SPRING CO LTD-H | 1,184,000 | 42.15 | 49,905,600.00 | |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 1,128,000 | 5.67 | 6,395,760.00 | |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 1,138,000 | 7.62 | 8,671,560.00 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 350,000 | 45.55 | 15,942,500.00 | |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 1,231,000 | 4.62 | 5,687,220.00 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 2,514,000 | 4.41 | 11,086,740.00 | |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 483,000 | 25.15 | 12,147,450.00 | |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 175,000 | 23.05 | 4,033,750.00 | |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 170,600 | 29.00 | 4,947,400.00 | |

| | | | |
|------------------------------|------------|-------|----------------|
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 459,800 | 6.41 | 2,947,318.00 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 1,232,000 | 5.66 | 6,973,120.00 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 265,300 | 11.66 | 3,093,398.00 |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 728,800 | 20.00 | 14,576,000.00 |
| 3SBIO INC | 1,073,500 | 6.05 | 6,494,675.00 |
| AKESO INC | 274,000 | 44.10 | 12,083,400.00 |
| BEIGENE LTD | 419,623 | 96.65 | 40,556,562.95 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 781,000 | 12.08 | 9,434,480.00 |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 847,500 | 5.04 | 4,271,400.00 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 1,486,000 | 3.04 | 4,517,440.00 |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 5,445,840 | 6.10 | 33,219,624.00 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 628,000 | 16.52 | 10,374,560.00 |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 696,000 | 12.46 | 8,672,160.00 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 744,000 | 36.00 | 26,784,000.00 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 240,500 | 14.84 | 3,569,020.00 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 6,275,500 | 2.94 | 18,449,970.00 |
| WUXI APPTEC CO LTD-H | 196,040 | 77.30 | 15,153,892.00 |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 2,297,500 | 30.00 | 68,925,000.00 |
| ZAI LAB LTD | 534,210 | 17.82 | 9,519,622.20 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 15,072,000 | 3.04 | 45,818,880.00 |
| BANK OF CHINA LTD-H | 48,864,000 | 2.99 | 146,103,360.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 4,902,900 | 4.68 | 22,945,572.00 |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 4,673,000 | 3.84 | 17,944,320.00 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 57,581,550 | 4.66 | 268,330,023.00 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 1,464,000 | 2.33 | 3,411,120.00 |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 2,095,050 | 28.85 | 60,442,192.50 |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 3,850,820 | 2.64 | 10,166,164.80 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 39,911,350 | 3.83 | 152,860,470.50 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 4,414,000 | 3.79 | 16,729,060.00 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 5,572,000 | 0.77 | 4,290,440.00 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 1,749,000 | 4.02 | 7,030,980.00 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 768,000 | 10.08 | 7,741,440.00 |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 1,676,500 | 16.16 | 27,092,240.00 |
| FAR EAST HORIZON LTD | 1,246,000 | 6.11 | 7,613,060.00 |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 442,400 | 8.37 | 3,702,888.00 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 1,531,200 | 3.91 | 5,986,992.00 |

| | | | | |
|------------------------------|------------|-------|----------------|--|
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 574,200 | 10.04 | 5,764,968.00 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 4,462,000 | 9.36 | 41,764,320.00 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 1,463,800 | 15.10 | 22,103,380.00 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 723,200 | 6.72 | 4,859,904.00 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 445,900 | 14.52 | 6,474,468.00 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 4,392,000 | 2.54 | 11,155,680.00 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 4,140,000 | 9.95 | 41,193,000.00 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 4,004,000 | 34.60 | 138,538,400.00 | |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 422,100 | 13.96 | 5,892,516.00 | |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | 1,324,000 | 5.13 | 6,792,120.00 | |
| GDS HOLDINGS LTD-CL A | 571,276 | 5.96 | 3,404,804.96 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 1,487,000 | 9.23 | 13,725,010.00 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 383,500 | 20.25 | 7,765,875.00 | |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 439,000 | 30.25 | 13,279,750.00 | |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 409,000 | 15.28 | 6,249,520.00 | |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 449,500 | 5.45 | 2,449,775.00 | |
| LENOVO GROUP LTD | 4,414,000 | 10.26 | 45,287,640.00 | |
| SUNNY OPTICAL TECH | 390,200 | 60.05 | 23,431,510.00 | |
| XIAOMI CORP-CLASS B | 9,141,800 | 13.74 | 125,608,332.00 | |
| ZTE CORP-H | 409,531 | 15.06 | 6,167,536.86 | |
| CHINA TOWER CORP LTD-H | 26,118,000 | 0.77 | 20,110,860.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 288,500 | 29.00 | 8,366,500.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 1,930,000 | 1.96 | 3,782,800.00 | |
| CGN POWER CO LTD-H | 5,163,000 | 2.24 | 11,565,120.00 | |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 1,904,200 | 7.55 | 14,376,710.00 | |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 1,903,000 | 5.02 | 9,553,060.00 | |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 2,292,000 | 3.04 | 6,967,680.00 | |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 617,000 | 23.75 | 14,653,750.00 | |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 1,110,000 | 16.04 | 17,804,400.00 | |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 450,000 | 62.05 | 27,922,500.00 | |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD | 2,154,000 | 5.88 | 12,665,520.00 | |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 2,348,000 | 4.53 | 10,636,440.00 | |
| KUNLUN ENERGY CO LTD | 1,992,000 | 7.00 | 13,944,000.00 | |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD-H | 146,000 | 14.02 | 2,046,920.00 | |
| GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD | 14,212,000 | 1.07 | 15,206,840.00 | |
| HANERGY THIN FILM POWER GROU | 960,000 | 3.91 | 3,753,600.00 | |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|-------------|--------|---------------------------------------|--|
| | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 382,000 | 17.00 | 6,494,000.00 | |
| | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 3,406,000 | 3.96 | 13,487,760.00 | |
| | C&D INTERNATIONAL INVESTMENT | 434,000 | 13.66 | 5,928,440.00 | |
| | CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 2,089,500 | 12.22 | 25,533,690.00 | |
| | CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 610,000 | 5.18 | 3,159,800.00 | |
| | CHINA RESOURCES LAND LTD | 2,250,000 | 24.30 | 54,675,000.00 | |
| | CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 423,800 | 23.45 | 9,938,110.00 | |
| | CHINA VANKE CO LTD-H | 1,072,551 | 6.50 | 6,971,581.50 | |
| | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 5,470,232 | 0.72 | 3,938,567.04 | |
| | COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 1,239,000 | 5.76 | 7,136,640.00 | |
| | GREENTOWN CHINA HOLDINGS | 525,500 | 6.40 | 3,363,200.00 | |
| | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 1,011,000 | 9.61 | 9,715,710.00 | |
| | YUEXIU PROPERTY CO LTD | 800,000 | 5.08 | 4,064,000.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 488,577,678 | | 6,065,399,474.32 (114,575,396,069) | |
| マレーシアリン ギット | DIALOG GROUP BHD | 1,972,480 | 1.86 | 3,668,812.80 | |
| | PETRONAS DAGANGAN BHD | 149,300 | 21.38 | 3,192,034.00 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 1,815,500 | 6.75 | 12,254,625.00 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 2,265,100 | 4.85 | 10,985,735.00 | |
| | GAMUDA BHD | 1,012,100 | 4.96 | 5,020,016.00 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 1,697,300 | 2.50 | 4,243,250.00 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 554,900 | 7.61 | 4,222,789.00 | |
| | MISC BHD | 744,800 | 7.32 | 5,451,936.00 | |
| | GENTING BHD | 1,154,400 | 4.70 | 5,425,680.00 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 1,757,300 | 2.69 | 4,727,137.00 | |
| | MR DIY GROUP M BHD | 1,949,000 | 1.43 | 2,787,070.00 | |
| | IOI CORP BHD | 1,440,600 | 4.01 | 5,776,806.00 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 337,100 | 22.70 | 7,652,170.00 | |
| | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 39,900 | 119.50 | 4,768,050.00 | |
| | PPB GROUP BERHAD | 371,240 | 14.72 | 5,464,652.80 | |
| | QL RESOURCES BHD | 521,250 | 5.86 | 3,054,525.00 | |
| | SIME DARBY PLANTATION BHD | 967,000 | 4.38 | 4,235,460.00 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 1,220,300 | 6.07 | 7,407,221.00 | |
| | AMMB HOLDINGS BHD | 1,376,300 | 4.25 | 5,849,275.00 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 3,586,000 | 6.12 | 21,946,320.00 | |
| | HONG LEONG BANK BERHAD | 366,400 | 19.18 | 7,027,552.00 | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
| | MALAYAN BANKING BHD | 3,414,700 | 9.10 | 31,073,770.00 | |
| | PUBLIC BANK BERHAD | 8,440,900 | 4.37 | 36,886,733.00 | |
| | RHB BANK BHD | 1,098,049 | 5.61 | 6,160,054.89 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 1,195,000 | 2.63 | 3,142,850.00 | |
| | CELCOMDIGI BHD | 1,763,800 | 4.25 | 7,496,150.00 | |
| | MAXIS BHD | 1,122,400 | 3.82 | 4,287,568.00 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 653,000 | 5.92 | 3,865,760.00 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 447,000 | 17.64 | 7,885,080.00 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 1,554,000 | 10.52 | 16,348,080.00 | |
| | INARI AMERTRON BHD | 1,618,200 | 3.21 | 5,194,422.00 | |
| | マレーシアリングイト 小計 | 46,605,319 | | 257,501,584.49 (8,024,727,878) | |
| タイパーツ | BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR | 5,993,000 | 6.50 | 38,954,500.00 | |
| | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 873,500 | 149.50 | 130,588,250.00 | |
| | PTT PCL-NVDR | 5,421,900 | 34.25 | 185,700,075.00 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 757,900 | 53.25 | 40,358,175.00 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 787,000 | 24.30 | 19,124,100.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 2,231,461 | 34.50 | 76,985,404.50 | |
| | SCG PACKAGING PCL-NVDR | 561,600 | 31.75 | 17,830,800.00 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 439,550 | 267.00 | 117,359,850.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 3,107,700 | 59.75 | 185,685,075.00 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR | 3,539,400 | 7.40 | 26,191,560.00 | |
| | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 4,492,200 | 6.75 | 30,322,350.00 | |
| | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR | 3,667,900 | 3.88 | 14,231,452.00 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 1,806,900 | 29.50 | 53,303,550.00 | |
| | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 955,517 | 34.75 | 33,204,215.75 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 9,757,701 | 10.80 | 105,383,170.80 | |
| | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 1,787,200 | 18.30 | 32,705,760.00 | |
| | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR | 593,600 | 24.30 | 14,424,480.00 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 3,206,400 | 53.00 | 169,939,200.00 | |
| | CP AXTRA PCL-NVDR | 1,119,100 | 29.25 | 32,733,675.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 1,996,400 | 18.00 | 35,935,200.00 | |
| | OSOTSPA PCL-NVDR | 931,700 | 21.60 | 20,124,720.00 | |
| | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 6,214,800 | 27.75 | 172,460,700.00 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 318,900 | 240.00 | 76,536,000.00 | |
| | KASIKORNBANK PCL-NVDR | 304,300 | 123.00 | 37,428,900.00 | |

| | | | | | |
|---------------|------------------------------|------------|-----------|-------------------------------------|--|
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 1,770,600 | 16.30 | 28,860,780.00 | |
| | SCB X PCL-NVDR | 472,000 | 106.00 | 50,032,000.00 | |
| | TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR | 12,000,000 | 1.80 | 21,600,000.00 | |
| | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 493,000 | 44.00 | 21,692,000.00 | |
| | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 402,800 | 41.75 | 16,816,900.00 | |
| | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 1,742,200 | 82.50 | 143,731,500.00 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 690,100 | 218.00 | 150,441,800.00 | |
| | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 513,100 | 73.75 | 37,841,125.00 | |
| | TRUE CORP PCL/NEW-NVDR | 5,276,828 | 5.95 | 31,397,126.60 | |
| | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 943,600 | 38.25 | 36,092,700.00 | |
| | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 372,600 | 49.00 | 18,257,400.00 | |
| | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 1,556,200 | 43.75 | 68,083,750.00 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 1,146,200 | 65.25 | 74,789,550.00 | |
| | LAND & HOUSES PUB - NVDR | 5,245,100 | 7.70 | 40,387,270.00 | |
| | タイパーツ 小計 | 93,489,957 | | 2,407,535,064.65 (9,967,195,167) | |
| フィリピンペン | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 924,980 | 49.10 | 45,416,518.00 | |
| | AYALA CORPORATION | 129,305 | 680.00 | 87,927,400.00 | |
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 1,371,849 | 38.05 | 52,198,854.45 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 150,555 | 904.00 | 136,101,720.00 | |
| | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 640,250 | 241.00 | 154,300,250.00 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORP | 261,310 | 270.20 | 70,605,962.00 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 536,200 | 114.80 | 61,555,760.00 | |
| | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 1,250,397 | 111.20 | 139,044,146.40 | |
| | BDO UNIBANK INC | 1,344,416 | 143.90 | 193,461,462.40 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 1,349,456 | 57.50 | 77,593,720.00 | |
| | PLDT INC | 35,425 | 1,288.00 | 45,627,400.00 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 169,260 | 380.00 | 64,318,800.00 | |
| | AYALA LAND INC | 4,129,620 | 34.15 | 141,026,523.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 5,640,100 | 33.60 | 189,507,360.00 | |
| | フィリピンペン 小計 | 17,933,123 | | 1,458,685,876.25 (3,809,504,034) | |
| インドネシアル ピア | ADARO ENERGY INDONESIA TBK P | 9,845,800 | 2,360.00 | 23,236,088,000.00 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 821,600 | 23,125.00 | 18,999,500,000.00 | |
| | AMMAN MINERAL INTERNASIONAL | 3,732,100 | 7,525.00 | 28,084,052,500.00 | |
| | ANEKA TAMBANG TBK | 3,302,400 | 1,555.00 | 5,135,232,000.00 | |

| | | | | | |
|--------|-------------------------------|-------------|-----------|--|--|
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 13,337,270 | 1,065.00 | 14,204,192,550.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 1,329,300 | 7,600.00 | 10,102,680,000.00 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 4,827,300 | 2,760.00 | 13,323,348,000.00 | |
| | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK | 1,836,700 | 6,150.00 | 11,295,705,000.00 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 11,331,300 | 5,050.00 | 57,223,065,000.00 | |
| | GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT | 475,281,400 | 84.00 | 39,923,637,600.00 | |
| | SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P | 10,376,500 | 2,670.00 | 27,705,255,000.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 4,136,800 | 4,590.00 | 18,987,912,000.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 1,153,300 | 11,400.00 | 13,147,620,000.00 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | 2,112,200 | 6,400.00 | 13,518,080,000.00 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 4,456,700 | 3,160.00 | 14,083,172,000.00 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 11,171,100 | 1,575.00 | 17,594,482,500.00 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 32,283,300 | 9,500.00 | 306,691,350,000.00 | |
| | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | 21,884,900 | 6,275.00 | 137,327,747,500.00 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 13,768,700 | 5,400.00 | 74,350,980,000.00 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 40,004,500 | 5,525.00 | 221,024,862,500.00 | |
| | SARANA MENARA NUSANTARA PT | 11,186,200 | 920.00 | 10,291,304,000.00 | |
| | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 29,076,600 | 3,980.00 | 115,724,868,000.00 | |
| | インドネシアルピア 小計 | 707,255,970 | | 1,191,975,134,150.00 (11,204,566,261) | |
| メキシコペン | CEMEX SAB-CPO | 8,314,268 | 13.99 | 116,316,609.32 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 1,820,770 | 87.83 | 159,918,229.10 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 102,805 | 220.21 | 22,638,689.05 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 673,098 | 33.58 | 22,602,630.84 | |
| | ALFA S. A. B. -A | 1,531,900 | 13.14 | 20,129,166.00 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 301,200 | 161.24 | 48,565,488.00 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 224,200 | 266.28 | 59,699,976.00 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B | 175,290 | 491.67 | 86,184,834.30 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT | 183,300 | 156.23 | 28,636,959.00 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 106,465 | 169.74 | 18,071,369.10 | |
| | WALMART DE MEXICO SAB DE CV | 3,227,100 | 69.21 | 223,347,591.00 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 263,866 | 183.57 | 48,437,881.62 | |
| | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 270,100 | 156.66 | 42,313,866.00 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 1,183,600 | 233.01 | 275,790,636.00 | |
| | GRUMA S. A. B. -B | 108,475 | 305.54 | 33,143,451.50 | |
| | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 682,000 | 77.10 | 52,582,200.00 | |

| | | | | | |
|---------|------------------------------|------------|--------|--------------------------------------|--|
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 819,500 | 37.79 | 30,968,905.00 | |
| | BANCO DEL BAJIO SA | 469,600 | 63.60 | 29,866,560.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 1,621,600 | 169.42 | 274,731,472.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 991,400 | 48.50 | 48,082,900.00 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B | 10,735,400 | 15.31 | 164,358,974.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | 33,805,937 | | 1,806,388,387.83 (15,512,360,280) | |
| ブラジルリアル | COSAN SA | 655,100 | 18.46 | 12,093,146.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 2,253,400 | 41.06 | 92,524,604.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 2,752,500 | 39.28 | 108,118,200.00 | |
| | PRIIO SA | 483,200 | 44.80 | 21,647,360.00 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 394,700 | 27.95 | 11,031,865.00 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 421,200 | 17.92 | 7,547,904.00 | |
| | GERDAU SA-PREF | 663,000 | 21.78 | 14,440,140.00 | |
| | KLABIN SA - UNIT | 397,200 | 21.78 | 8,651,016.00 | |
| | SUZANO SA | 472,422 | 51.85 | 24,495,080.70 | |
| | VALE SA | 2,000,529 | 68.36 | 136,756,162.44 | |
| | WEG SA | 991,388 | 33.25 | 32,963,651.00 | |
| | CCR SA | 527,800 | 13.31 | 7,025,018.00 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 509,713 | 58.36 | 29,746,850.68 | |
| | RUMO SA | 1,023,000 | 22.45 | 22,966,350.00 | |
| | LOJAS RENNEN S. A. | 503,122 | 16.15 | 8,125,420.30 | |
| | MAGAZINE LUIZA SA | 1,497,500 | 2.07 | 3,099,825.00 | |
| | VIBRA ENERGIA SA | 653,400 | 23.34 | 15,250,356.00 | |
| | ATACADA0 SA | 343,900 | 10.98 | 3,776,022.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 755,812 | 26.00 | 19,651,112.00 | |
| | SENDAS DISTRIBUIDORA SA | 832,500 | 14.00 | 11,655,000.00 | |
| | AMBEV SA | 2,716,700 | 13.20 | 35,860,440.00 | |
| | JBS SA | 399,800 | 24.20 | 9,675,160.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 525,900 | 16.20 | 8,519,580.00 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 2,830,971 | 4.01 | 11,352,193.71 | |
| | REDE D'OR SAO LUIZ SA | 340,500 | 27.17 | 9,251,385.00 | |
| | HYPERA SA | 205,800 | 31.59 | 6,501,222.00 | |
| | BANCO BRADESCO S. A. | 1,313,437 | 13.70 | 17,994,086.90 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 2,930,386 | 15.36 | 45,010,728.96 | |
| | BANCO DO BRASIL S. A. | 502,500 | 56.58 | 28,431,450.00 | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|-------------|-----------|--------------------------------------|--|
| | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 177,400 | 29.18 | 5,176,532.00 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 2,902,230 | 32.33 | 93,829,095.90 | |
| | ITAUSA SA | 3,020,162 | 9.94 | 30,020,410.28 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 3,789,225 | 13.43 | 50,889,291.75 | |
| | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 662,700 | 37.00 | 24,519,900.00 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 368,000 | 33.74 | 12,416,320.00 | |
| | TOTVS SA | 313,600 | 30.90 | 9,690,240.00 | |
| | TELEFONICA BRASIL S. A. | 219,375 | 50.75 | 11,133,281.25 | |
| | TIM SA | 494,977 | 17.39 | 8,607,650.03 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 142,400 | 46.13 | 6,568,912.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 717,100 | 41.13 | 29,494,323.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 721,390 | 11.66 | 8,411,407.40 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 184,700 | 77.09 | 14,238,523.00 | |
| | COMPANHIA PARANAENSE -PREF B | 616,900 | 10.05 | 6,199,845.00 | |
| | CPFL ENERGIA SA | 104,700 | 36.36 | 3,806,892.00 | |
| | ENERGISA SA-UNITS | 120,400 | 50.09 | 6,030,836.00 | |
| | ENEVA SA | 483,000 | 12.90 | 6,230,700.00 | |
| | ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 96,550 | 41.23 | 3,980,756.50 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 811,400 | 34.85 | 28,277,290.00 | |
| | ブラジルリアル 小計 | 45,843,589 | | 1,123,683,535.80 (33,725,113,959) | |
| チリペソ | EMPRESAS COPEC SA | 231,184 | 6,050.00 | 1,398,663,200.00 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 544,129 | 1,600.00 | 870,606,400.00 | |
| | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 80,619 | 42,755.00 | 3,446,865,345.00 | |
| | CIA SUD AMERICANA DE VAPORES | 11,707,800 | 69.98 | 819,311,844.00 | |
| | LATAM AIRLINES GROUP SA | 103,210,400 | 11.15 | 1,150,795,960.00 | |
| | FALABELLA SA | 447,714 | 2,110.00 | 944,676,540.00 | |
| | CENCOSUD SA | 686,091 | 1,575.00 | 1,080,593,325.00 | |
| | BANCO DE CHILE | 29,371,536 | 101.25 | 2,973,868,020.00 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 51,686 | 24,000.00 | 1,240,464,000.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 34,054,503 | 42.41 | 1,444,251,472.00 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 14,141,398 | 95.15 | 1,345,554,019.00 | |
| | ENEL CHILE SA | 13,798,839 | 54.40 | 750,656,841.00 | |
| | チリペソ 小計 | 208,325,899 | | 17,466,306,966.00 (2,834,344,962) | |
| 韓国ウォン | HD HYUNDAI | 23,432 | 67,400.00 | 1,579,316,800.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| S-OIL CORP | 32,311 | 67,000.00 | 2,164,837,000.00 | |
| SK INNOVATION CO LTD | 33,880 | 112,100.00 | 3,797,948,000.00 | |
| HANWHA SOLUTIONS CORP | 65,451 | 32,950.00 | 2,156,610,450.00 | |
| HYUNDAI STEEL CO | 47,819 | 33,800.00 | 1,616,282,200.00 | |
| KOREA ZINC CO LTD | 5,353 | 460,500.00 | 2,465,056,500.00 | |
| KUM YANG CO LTD | 18,000 | 75,100.00 | 1,351,800,000.00 | |
| KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD | 8,081 | 116,400.00 | 940,628,400.00 | |
| LG CHEM LTD | 31,597 | 404,500.00 | 12,780,986,500.00 | |
| LG CHEM LTD-PREFERENCE | 4,322 | 262,000.00 | 1,132,364,000.00 | |
| LOTTE CHEMICAL CORP | 9,469 | 136,900.00 | 1,296,306,100.00 | |
| POSCO HOLDINGS INC | 44,104 | 400,000.00 | 17,641,600,000.00 | |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 17,800 | 78,900.00 | 1,404,420,000.00 | |
| SKC CO LTD | 8,074 | 74,000.00 | 597,476,000.00 | |
| DOOSAN BOBCAT INC | 32,378 | 46,500.00 | 1,505,577,000.00 | |
| DOOSAN ENERBILITY CO LTD | 276,499 | 14,870.00 | 4,111,540,130.00 | |
| ECOPRO BM CO LTD | 29,449 | 227,000.00 | 6,684,923,000.00 | |
| ECOPRO CO LTD | 12,018 | 490,500.00 | 5,894,829,000.00 | |
| GS HOLDINGS | 27,669 | 41,650.00 | 1,152,413,850.00 | |
| HANWHA AEROSPACE CO LTD | 18,394 | 140,500.00 | 2,584,357,000.00 | |
| HANWHA OCEAN CO LTD | 37,899 | 22,200.00 | 841,357,800.00 | |
| HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES | 12,400 | 119,900.00 | 1,486,760,000.00 | |
| HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS | 22,448 | 115,900.00 | 2,601,723,200.00 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST | 43,467 | 32,050.00 | 1,393,117,350.00 | |
| HYUNDAI MIPO DOCKYARD | 17,626 | 70,400.00 | 1,240,870,400.00 | |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 41,812 | 53,800.00 | 2,249,485,600.00 | |
| L&F CO LTD | 16,089 | 157,500.00 | 2,534,017,500.00 | |
| LG CORP | 53,468 | 73,600.00 | 3,935,244,800.00 | |
| LG ENERGY SOLUTION | 30,392 | 368,000.00 | 11,184,256,000.00 | |
| POSCO FUTURE M CO LTD | 17,614 | 251,000.00 | 4,421,114,000.00 | |
| POSCO INTERNATIONAL CORP | 26,266 | 48,900.00 | 1,284,407,400.00 | |
| SAMSUNG C&T CORP | 45,199 | 119,700.00 | 5,410,320,300.00 | |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 83,943 | 24,450.00 | 2,052,406,350.00 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 354,731 | 7,570.00 | 2,685,313,670.00 | |
| SK INC | 18,812 | 160,800.00 | 3,024,969,600.00 | |
| SK SQUARE CO LTD | 49,040 | 49,850.00 | 2,444,644,000.00 | |
| HMM CO LTD | 132,330 | 20,000.00 | 2,646,600,000.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 11,173 | 170,700.00 | 1,907,231,100.00 | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 107,148 | 22,500.00 | 2,410,830,000.00 | |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 43,655 | 49,450.00 | 2,158,739,750.00 | |
| HANON SYSTEMS | 106,991 | 6,190.00 | 662,274,290.00 | |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD | 36,173 | 209,500.00 | 7,578,243,500.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 92,825 | 188,700.00 | 17,516,077,500.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 17,752 | 112,800.00 | 2,002,425,600.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF | 10,895 | 112,000.00 | 1,220,240,000.00 | |
| KIA CORP | 154,327 | 93,000.00 | 14,352,411,000.00 | |
| COWAY CO LTD | 30,042 | 57,000.00 | 1,712,394,000.00 | |
| F&F CO LTD / NEW | 9,200 | 71,600.00 | 658,720,000.00 | |
| LG ELECTRONICS INC | 58,937 | 94,000.00 | 5,540,078,000.00 | |
| KANGWON LAND INC | 47,178 | 15,110.00 | 712,859,580.00 | |
| HYBE CO LTD | 11,933 | 216,000.00 | 2,577,528,000.00 | |
| JYP ENTERTAINMENT CORP | 14,500 | 82,000.00 | 1,189,000,000.00 | |
| KAKAO CORP | 186,958 | 56,000.00 | 10,469,648,000.00 | |
| KRAFTON INC | 15,766 | 207,000.00 | 3,263,562,000.00 | |
| NAVER CORP | 80,161 | 213,500.00 | 17,114,373,500.00 | |
| NCSOFT CORP | 7,497 | 192,600.00 | 1,443,922,200.00 | |
| NETMARBLE CORP | 12,296 | 55,400.00 | 681,198,400.00 | |
| PEARL ABYSS CORP | 17,435 | 33,700.00 | 587,559,500.00 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 17,981 | 59,500.00 | 1,069,869,500.00 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 3,867 | 284,500.00 | 1,100,161,500.00 | |
| KT&G CORP | 57,530 | 87,900.00 | 5,056,887,000.00 | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 12,195 | 92,700.00 | 1,130,476,500.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 14,756 | 139,500.00 | 2,058,462,000.00 | |
| LG H&H | 5,202 | 315,000.00 | 1,638,630,000.00 | |
| HLB INC | 67,462 | 54,700.00 | 3,690,171,400.00 | |
| CELLTRION INC | 91,959 | 182,000.00 | 16,736,538,000.00 | |
| CELLTRION PHARM INC | 10,459 | 103,000.00 | 1,077,277,000.00 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 3,690 | 332,000.00 | 1,225,080,000.00 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 12,838 | 785,000.00 | 10,077,830,000.00 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 17,376 | 89,300.00 | 1,551,676,800.00 | |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 14,700 | 63,600.00 | 934,920,000.00 | |
| YUHAN CORP | 30,223 | 60,200.00 | 1,819,424,600.00 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 177,231 | 43,750.00 | 7,753,856,250.00 | |

| | | | | | |
|---------|------------------------------|-----------|------------|--|--|
| | INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 137,043 | 11,890.00 | 1,629,441,270.00 | |
| | KAKAObANK CORP | 103,900 | 29,250.00 | 3,039,075,000.00 | |
| | KB FINANCIAL GROUP INC | 227,235 | 52,900.00 | 12,020,731,500.00 | |
| | SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 261,996 | 39,650.00 | 10,388,141,400.00 | |
| | WOORI FINANCIAL GROUP INC | 346,472 | 13,030.00 | 4,514,530,160.00 | |
| | KAKAOPAY CORP | 11,248 | 51,500.00 | 579,272,000.00 | |
| | KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 20,102 | 58,200.00 | 1,169,936,400.00 | |
| | MERITZ FINANCIAL GROUP INC | 55,690 | 62,300.00 | 3,469,487,000.00 | |
| | MIRAE ASSET SECURITIES CO LT | 119,622 | 7,140.00 | 854,101,080.00 | |
| | NH INVESTMENT & SECURITIES C | 60,045 | 10,110.00 | 607,054,950.00 | |
| | SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 36,061 | 35,850.00 | 1,292,786,850.00 | |
| | DB INSURANCE CO LTD | 26,050 | 80,600.00 | 2,099,630,000.00 | |
| | SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 17,515 | 241,000.00 | 4,221,115,000.00 | |
| | SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 48,282 | 63,800.00 | 3,080,391,600.00 | |
| | POSCO DX CO LTD | 30,200 | 54,000.00 | 1,630,800,000.00 | |
| | SAMSUNG SDS CO LTD | 24,444 | 157,400.00 | 3,847,485,600.00 | |
| | COSMOAM&T CO LTD | 12,657 | 129,900.00 | 1,644,144,300.00 | |
| | LG DISPLAY CO LTD | 119,043 | 12,310.00 | 1,465,419,330.00 | |
| | LG INNOTEK CO LTD | 7,648 | 207,000.00 | 1,583,136,000.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 34,488 | 144,600.00 | 4,986,964,800.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 2,813,078 | 74,100.00 | 208,449,079,800.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 489,577 | 59,900.00 | 29,325,662,300.00 | |
| | SAMSUNG SDI CO LTD | 35,148 | 347,500.00 | 12,213,930,000.00 | |
| | KT CORP | 30,000 | 34,200.00 | 1,026,000,000.00 | |
| | LG UPLUS CORP | 107,515 | 9,970.00 | 1,071,924,550.00 | |
| | SK TELECOM | 31,200 | 49,400.00 | 1,541,280,000.00 | |
| | KOREA ELECTRIC POWER CORP | 145,027 | 19,160.00 | 2,778,717,320.00 | |
| | HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD | 22,700 | 57,700.00 | 1,309,790,000.00 | |
| | SK HYNIX INC | 322,545 | 137,400.00 | 44,317,683,000.00 | |
| | 韓国ウォン 小計 | 9,056,478 | | 643,134,167,580.00 (71,130,638,934) | |
| ニュー台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 597,150 | 73.20 | 43,711,380.00 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 1,312,281 | 40.00 | 52,491,240.00 | |
| | CHINA STEEL CORP | 7,062,947 | 25.10 | 177,279,969.70 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 1,926,430 | 56.60 | 109,035,938.00 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 2,802,600 | 71.70 | 200,946,420.00 | |

| | | | |
|------------------------------|------------|----------|----------------|
| NAN YA PLASTICS CORP | 2,815,557 | 60.50 | 170,341,198.50 |
| TAIWAN CEMENT | 4,058,696 | 32.70 | 132,719,359.20 |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 75,000 | 974.00 | 73,050,000.00 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 1,512,138 | 30.85 | 46,649,457.30 |
| VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 38,000 | 1,350.00 | 51,300,000.00 |
| WALSIN LIHWA CORP | 1,629,000 | 35.95 | 58,562,550.00 |
| CHINA AIRLINES LTD | 1,582,000 | 20.50 | 32,431,000.00 |
| EVA AIRWAYS CORP | 1,334,000 | 30.75 | 41,020,500.00 |
| EVERGREEN MARINE CORP LTD | 563,353 | 151.50 | 85,347,979.50 |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 1,077,000 | 29.60 | 31,879,200.00 |
| WAN HAI LINES LTD | 322,845 | 49.75 | 16,061,538.75 |
| YANG MING MARINE TRANSPORT | 1,065,000 | 49.25 | 52,451,250.00 |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 1,145,413 | 44.35 | 50,799,066.55 |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 100,728 | 552.00 | 55,601,856.00 |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 344,098 | 163.00 | 56,087,974.00 |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 132,000 | 334.50 | 44,154,000.00 |
| POU CHEN | 1,066,500 | 31.15 | 33,221,475.00 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 181,880 | 635.00 | 115,493,800.00 |
| MOMO.COM INC | 53,560 | 450.00 | 24,102,000.00 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 295,000 | 266.50 | 78,617,500.00 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 2,828,624 | 71.70 | 202,812,340.80 |
| PHARMAESSENTIA CORP | 136,000 | 321.00 | 43,656,000.00 |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 2,858,387 | 17.30 | 49,450,095.10 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 10,281,955 | 28.15 | 289,437,033.25 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 8,241,067 | 24.65 | 203,142,301.55 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 5,928,648 | 26.65 | 157,998,469.20 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 5,228,109 | 21.40 | 111,881,532.60 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 7,646,703 | 37.80 | 289,045,373.40 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 5,945,405 | 18.95 | 112,665,424.75 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 8,862,716 | 17.20 | 152,438,715.20 |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 3,048,448 | 13.30 | 40,544,358.40 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 5,564,572 | 25.50 | 141,896,586.00 |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 2,159,000 | 44.30 | 95,643,700.00 |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 918,275 | 179.50 | 164,830,362.50 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 5,647,117 | 26.75 | 151,060,379.75 |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 5,416,366 | 44.35 | 240,215,832.10 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 9,177,255 | 12.10 | 111,044,785.50 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 5,158,556 | 64.60 | 333,242,717.60 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 6,948,852 | 8.57 | 59,551,661.64 |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 280,000 | 513.00 | 143,640,000.00 |
| ACER INC | 1,664,168 | 47.60 | 79,214,396.80 |
| ADVANTECH CO LTD | 288,020 | 336.00 | 96,774,720.00 |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 424,774 | 458.00 | 194,546,492.00 |
| AUO CORP | 4,165,800 | 18.95 | 78,941,910.00 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 306,000 | 196.00 | 59,976,000.00 |
| COMPAL ELECTRONICS | 2,349,775 | 37.20 | 87,411,630.00 |
| DELTA ELECTRONICS INC | 1,268,220 | 284.00 | 360,174,480.00 |
| E INK HOLDINGS INC | 517,000 | 200.50 | 103,658,500.00 |
| GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD | 275,000 | 292.00 | 80,300,000.00 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 7,395,272 | 102.00 | 754,317,744.00 |
| INNOLUX CORP | 5,345,461 | 16.80 | 89,803,744.80 |
| INVENTEC CORP | 1,536,429 | 56.20 | 86,347,309.80 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 59,820 | 2,550.00 | 152,541,000.00 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 1,131,160 | 111.00 | 125,558,760.00 |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 432,000 | 185.00 | 79,920,000.00 |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 114,000 | 224.50 | 25,593,000.00 |
| PEGATRON CORP | 1,231,976 | 84.20 | 103,732,379.20 |
| QUANTA COMPUTER INC | 1,611,150 | 249.00 | 401,176,350.00 |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 631,193 | 72.70 | 45,887,731.10 |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 760,000 | 175.50 | 133,380,000.00 |
| WISTRON CORP | 1,576,000 | 115.00 | 181,240,000.00 |
| WIWYNN CORP | 59,000 | 2,095.00 | 123,605,000.00 |
| WPG HOLDINGS LTD | 1,540,168 | 89.00 | 137,074,952.00 |
| YAGEO CORPORATION | 182,738 | 556.00 | 101,602,328.00 |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 346,000 | 101.50 | 35,119,000.00 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 2,063,000 | 120.00 | 247,560,000.00 |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 962,000 | 79.70 | 76,671,400.00 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 896,400 | 97.60 | 87,488,640.00 |
| ALCHIP TECHNOLOGIES LTD | 45,000 | 3,720.00 | 167,400,000.00 |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 1,818,294 | 137.00 | 249,106,278.00 |
| EEMORY TECHNOLOGY INC | 35,000 | 2,620.00 | 91,700,000.00 |
| GLOBAL UNICHIP CORP | 46,000 | 1,555.00 | 71,530,000.00 |

| | | | | | |
|--------|------------------------------|-------------|-----------|---------------------------------------|--|
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 124,000 | 594.00 | 73,656,000.00 | |
| | MEDIATEK INC | 901,236 | 943.00 | 849,865,548.00 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 706,000 | 71.00 | 50,126,000.00 | |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 350,000 | 528.00 | 184,800,000.00 | |
| | PARADE TECHNOLOGIES LTD | 47,000 | 1,110.00 | 52,170,000.00 | |
| | POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU | 2,108,000 | 28.05 | 59,129,400.00 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 272,703 | 459.00 | 125,170,677.00 | |
| | SILERGY CORP | 184,000 | 400.50 | 73,692,000.00 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 14,505,000 | 642.00 | 9,312,210,000.00 | |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 7,099,000 | 52.30 | 371,277,700.00 | |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 473,000 | 76.30 | 36,089,900.00 | |
| | WINBOND ELECTRONICS CORP | 1,887,000 | 27.85 | 52,552,950.00 | |
| | RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 865,141 | 35.80 | 30,972,047.80 | |
| | ニュー台湾ドル 小計 | 205,968,129 | | 20,908,620,290.34 (98,565,326,910) | |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 425,063 | 474.40 | 201,649,887.20 | |
| | COAL INDIA LTD | 875,273 | 389.40 | 340,831,306.20 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 358,066 | 430.60 | 154,183,219.60 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 1,480,307 | 143.70 | 212,720,115.90 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 1,744,397 | 234.05 | 408,276,117.85 | |
| | PETRONET LNG LTD | 548,841 | 256.60 | 140,832,600.60 | |
| | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 1,787,301 | 2,706.15 | 4,836,704,601.15 | |
| | AMBUJA CEMENTS LTD | 355,073 | 560.15 | 198,894,140.95 | |
| | APL APOLLO TUBES LTD | 93,400 | 1,489.85 | 139,151,990.00 | |
| | ASIAN PAINTS LTD | 224,046 | 2,949.20 | 660,756,463.20 | |
| | BERGER PAINTS INDIA LTD | 170,784 | 554.70 | 94,733,884.80 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 146,062 | 2,076.50 | 303,297,743.00 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD-RIGHTS | 4,895 | 316.80 | 1,550,736.00 | |
| | HINDALCO INDUSTRIES LTD | 707,266 | 567.20 | 401,161,275.20 | |
| | JINDAL STEEL & POWER LTD | 179,644 | 716.30 | 128,678,997.20 | |
| | JSW STEEL LTD | 311,469 | 815.70 | 254,065,263.30 | |
| | PI INDUSTRIES LTD | 43,731 | 3,241.95 | 141,773,715.45 | |
| | PIDILITE INDUSTRIES LTD | 81,687 | 2,590.15 | 211,581,583.05 | |
| | SHREE CEMENT LTD | 4,903 | 27,948.80 | 137,032,966.40 | |
| | SRF LTD | 79,900 | 2,268.90 | 181,285,110.00 | |
| | SUPREME INDUSTRIES LTD | 38,100 | 4,014.85 | 152,965,785.00 | |

| | | | |
|------------------------------|-------------|--------------|----------------------|
| TATA STEEL LTD | 4, 278, 189 | 133. 75 | 572, 207, 778. 75 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 75, 858 | 9, 969. 35 | 756, 254, 952. 30 |
| UPL LTD | 237, 272 | 537. 30 | 127, 486, 245. 60 |
| VEDANTA LTD | 555, 382 | 263. 60 | 146, 398, 695. 20 |
| ABB INDIA LTD | 32, 000 | 4, 739. 30 | 151, 657, 600. 00 |
| ADANI ENTERPRISES LTD | 97, 587 | 2, 893. 60 | 282, 377, 743. 20 |
| ASHOK LEYLAND LTD | 810, 688 | 169. 75 | 137, 614, 288. 00 |
| ASTRAL LTD | 72, 159 | 1, 800. 05 | 129, 889, 807. 95 |
| BHARAT ELECTRONICS LTD | 2, 768, 047 | 189. 70 | 525, 098, 515. 90 |
| CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU | 334, 557 | 463. 10 | 154, 933, 346. 70 |
| CUMMINS INDIA LTD | 73, 700 | 2, 161. 90 | 159, 332, 030. 00 |
| HAVELLS INDIA LTD | 144, 146 | 1, 290. 35 | 185, 998, 791. 10 |
| HINDUSTAN AERONAUTICS LTD | 111, 154 | 2, 903. 80 | 322, 768, 985. 20 |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 411, 182 | 3, 593. 45 | 1, 477, 561, 957. 90 |
| POLYCAB INDIA LTD | 24, 700 | 4, 343. 85 | 107, 293, 095. 00 |
| SIEMENS LTD | 50, 469 | 4, 205. 40 | 212, 242, 332. 60 |
| SUZLON ENERGY LTD | 4, 883, 900 | 42. 55 | 207, 809, 945. 00 |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 128, 900 | 970. 30 | 125, 071, 670. 00 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 314, 258 | 1, 146. 30 | 360, 233, 945. 40 |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 131, 294 | 828. 65 | 108, 796, 773. 10 |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 71, 702 | 2, 863. 05 | 205, 286, 411. 10 |
| BAJAJ AUTO LTD | 36, 471 | 7, 597. 50 | 277, 088, 422. 50 |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 38, 519 | 2, 527. 00 | 97, 337, 513. 00 |
| BHARAT FORGE LTD | 133, 250 | 1, 200. 25 | 159, 933, 312. 50 |
| EICHER MOTORS LTD | 81, 325 | 3, 616. 45 | 294, 107, 796. 25 |
| HERO MOTOCORP LTD | 63, 559 | 4, 442. 15 | 282, 338, 611. 85 |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 591, 720 | 1, 635. 50 | 967, 758, 060. 00 |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 78, 705 | 9, 881. 00 | 777, 684, 105. 00 |
| MRF LTD | 969 | 136, 857. 95 | 132, 615, 353. 55 |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN | 1, 263, 368 | 115. 40 | 145, 792, 667. 20 |
| SONA BLW PRECISION FORGINGS | 213, 720 | 585. 40 | 125, 111, 688. 00 |
| TATA MOTORS LTD | 1, 083, 589 | 811. 85 | 879, 711, 729. 65 |
| TATA MOTORS LTD-A-DVR | 263, 600 | 537. 95 | 141, 803, 620. 00 |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT | 65, 000 | 3, 987. 90 | 259, 213, 500. 00 |
| TVS MOTOR CO LTD | 141, 207 | 1, 941. 10 | 274, 096, 907. 70 |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 4, 006 | 36, 711. 10 | 147, 064, 666. 60 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|------------------|
| TITAN CO LTD | 233,390 | 3,770.20 | 879,926,978.00 |
| INDIAN HOTELS CO LTD | 446,100 | 473.60 | 211,272,960.00 |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 240,560 | 508.25 | 122,264,620.00 |
| ZOMATO LTD | 2,839,600 | 136.15 | 386,611,540.00 |
| INFO EDGE INDIA LTD | 37,381 | 4,982.55 | 186,252,701.55 |
| TRENT LTD | 108,950 | 3,231.80 | 352,104,610.00 |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 89,907 | 3,734.25 | 335,735,214.75 |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 61,472 | 5,141.90 | 316,082,876.80 |
| ITC LTD | 1,730,831 | 455.65 | 788,653,145.15 |
| MARICO LTD | 303,092 | 525.10 | 159,153,609.20 |
| NESTLE INDIA LTD | 197,412 | 2,482.15 | 490,006,195.80 |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 451,186 | 1,136.75 | 512,885,685.50 |
| UNITED SPIRITS LTD | 167,525 | 1,096.00 | 183,607,400.00 |
| VARUN BEVERAGES LTD | 271,393 | 1,257.40 | 341,249,558.20 |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA) | 73,886 | 2,492.55 | 184,164,549.30 |
| DABUR INDIA LTD | 355,562 | 531.60 | 189,016,759.20 |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 227,574 | 1,157.30 | 263,371,390.20 |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 479,559 | 2,428.30 | 1,164,513,119.70 |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 74,763 | 6,168.85 | 461,201,732.55 |
| MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD | 472,438 | 732.50 | 346,060,835.00 |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 141,068 | 1,150.85 | 162,348,107.80 |
| CIPLA LTD | 293,561 | 1,369.65 | 402,075,823.65 |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 72,484 | 3,578.90 | 259,412,987.60 |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 65,279 | 5,855.50 | 382,241,184.50 |
| LUPIN LTD | 112,441 | 1,454.05 | 163,494,836.05 |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 554,566 | 1,368.30 | 758,812,657.80 |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 54,086 | 2,473.40 | 133,776,312.40 |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD | 80,800 | 707.85 | 57,194,280.00 |
| AXIS BANK LTD | 1,376,712 | 1,042.25 | 1,434,878,082.00 |
| BANDHAN BANK LTD | 404,531 | 220.95 | 89,381,124.45 |
| BANK OF BARODA | 527,808 | 227.05 | 119,838,806.40 |
| HDFC BANK LIMITED | 1,634,747 | 1,434.90 | 2,345,698,470.30 |
| ICICI BANK LTD | 2,995,481 | 1,009.95 | 3,025,286,035.95 |
| IDFC FIRST BANK LTD | 1,793,641 | 80.05 | 143,580,962.05 |
| INDUSIND BANK LTD | 161,100 | 1,512.00 | 243,583,200.00 |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 673,470 | 1,768.40 | 1,190,964,348.00 |

| | | | |
|------------------------------|-------------|------------|----------------------|
| STATE BANK OF INDIA | 1, 011, 660 | 612. 75 | 619, 894, 665. 00 |
| YES BANK LTD | 7, 091, 633 | 24. 85 | 176, 227, 080. 05 |
| BAJAJ FINANCE LTD | 160, 080 | 7, 085. 50 | 1, 134, 246, 840. 00 |
| BAJAJ FINSERV LTD | 219, 021 | 1, 630. 15 | 357, 037, 083. 15 |
| BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN | 16, 100 | 8, 194. 70 | 131, 934, 670. 00 |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 249, 500 | 1, 244. 70 | 310, 552, 650. 00 |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 46, 224 | 3, 428. 65 | 158, 485, 917. 60 |
| JIO FINANCIAL SERVICES LTD | 1, 900, 623 | 239. 85 | 455, 864, 426. 55 |
| MUTHOOT FINANCE LTD | 70, 100 | 1, 388. 15 | 97, 309, 315. 00 |
| ONE 97 COMMUNICATIONS LTD | 125, 900 | 763. 05 | 96, 067, 995. 00 |
| POWER FINANCE CORPORATION | 1, 073, 612 | 419. 00 | 449, 843, 428. 00 |
| REC LTD | 967, 835 | 470. 15 | 455, 027, 625. 25 |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 152, 600 | 759. 85 | 115, 953, 110. 00 |
| SHRIRAM FINANCE LTD | 170, 222 | 2, 307. 15 | 392, 727, 687. 30 |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 535, 235 | 579. 00 | 309, 901, 065. 00 |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 138, 845 | 1, 482. 20 | 205, 796, 059. 00 |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 194, 605 | 486. 30 | 94, 636, 411. 50 |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 251, 699 | 1, 380. 90 | 347, 571, 149. 10 |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 558, 651 | 1, 550. 25 | 866, 048, 712. 75 |
| INFOSYS LTD | 1, 956, 136 | 1, 669. 10 | 3, 264, 986, 597. 60 |
| LTIMINDTREE LTD | 48, 910 | 5, 494. 65 | 268, 743, 331. 50 |
| MPHASIS LTD | 43, 391 | 2, 522. 40 | 109, 449, 458. 40 |
| PERSISTENT SYSTEMS LTD | 28, 000 | 8, 378. 75 | 234, 605, 000. 00 |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 527, 525 | 3, 810. 30 | 2, 010, 028, 507. 50 |
| TATA ELXSI LTD | 19, 600 | 7, 667. 15 | 150, 276, 140. 00 |
| TECH MAHINDRA LTD | 322, 469 | 1, 322. 05 | 426, 320, 141. 45 |
| WIPRO LTD | 773, 095 | 470. 00 | 363, 354, 650. 00 |
| BHARTI AIRTEL LTD | 1, 367, 147 | 1, 160. 55 | 1, 586, 642, 450. 85 |
| TATA COMMUNICATIONS LTD | 66, 300 | 1, 716. 60 | 113, 810, 580. 00 |
| ADANI GREEN ENERGY LTD | 178, 388 | 1, 664. 80 | 296, 980, 342. 40 |
| ADANI POWER LTD | 465, 107 | 543. 30 | 252, 692, 633. 10 |
| GAIL INDIA LTD | 1, 369, 662 | 165. 40 | 226, 542, 094. 80 |
| INDRAPRASTHA GAS LTD | 213, 723 | 405. 15 | 86, 589, 873. 45 |
| NTPC LTD | 2, 832, 789 | 314. 75 | 891, 620, 337. 75 |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 2, 752, 060 | 245. 50 | 675, 630, 730. 00 |
| TATA POWER CO LTD | 777, 533 | 365. 10 | 283, 877, 298. 30 |

| | | | | | |
|------------|------------------------------|------------|-----------|--|--|
| | DLF LTD | 347,607 | 758.65 | 263,712,050.55 | |
| | GODREJ PROPERTIES LTD | 68,467 | 2,326.90 | 159,315,862.30 | |
| | MACROTECH DEVELOPERS LTD | 138,700 | 1,056.05 | 146,474,135.00 | |
| | インドルピー 小計 | 78,361,470 | | 58,093,581,170.90 (103,987,510,295) | |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS | 39,958 | 746.50 | 29,828,647.00 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 174,521 | 98.20 | 17,137,962.20 | |
| | CEZ AS | 90,512 | 883.00 | 79,922,096.00 | |
| | チェココルナ 小計 | 304,991 | | 126,888,705.20 (821,617,055) | |
| クウェートディナール | AGILITY | 847,283 | 0.57 | 482,951.31 | |
| | BOUBYAN BANK K.S.C | 782,041 | 0.63 | 499,724.19 | |
| | GULF BANK | 1,288,775 | 0.29 | 382,766.17 | |
| | KUWAIT FINANCE HOUSE | 5,051,805 | 0.78 | 3,970,718.73 | |
| | NATIONAL BANK OF KUWAIT | 4,423,098 | 0.98 | 4,365,597.72 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 1,118,010 | 0.53 | 592,545.30 | |
| | MABANEE CO KPSC | 345,094 | 0.77 | 268,483.13 | |
| | クウェートディナール 小計 | 13,856,106 | | 10,562,786.55 (5,080,172,191) | |
| コロンビアペソ | BANCOLOMBIA SA | 130,154 | 32,620.00 | 4,245,623,480.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 237,560 | 30,600.00 | 7,269,336,000.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 241,634 | 16,900.00 | 4,083,614,600.00 | |
| | コロンビアペソ 小計 | 609,348 | | 15,598,574,080.00 (584,073,007) | |
| ハンガリーフォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 235,486 | 2,858.00 | 673,018,988.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 78,795 | 9,500.00 | 748,552,500.00 | |
| | OTP BANK PLC | 141,641 | 16,990.00 | 2,406,480,590.00 | |
| | ハンガリーフォリント 小計 | 455,922 | | 3,828,052,078.00 (1,592,052,406) | |
| アラブディルハム | MULTIPLY GROUP | 2,382,334 | 2.99 | 7,123,178.66 | |
| | AMERICANA RESTAURANTS INTERN | 1,481,824 | 3.30 | 4,890,019.20 | |
| | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 1,942,280 | 3.56 | 6,914,516.80 | |
| | ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 1,802,409 | 9.22 | 16,618,210.98 | |
| | ABU DHABI ISLAMIC BANK | 944,352 | 11.16 | 10,538,968.32 | |
| | DUBAI ISLAMIC BANK | 2,117,807 | 6.25 | 13,236,293.75 | |
| | FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 2,703,694 | 15.20 | 41,096,148.80 | |

| | | | | | |
|-------------------------|------------------------------|------------|---------------|-----------------------------------|--|
| | EMIRATES TELECOM GROUP CO | 2,249,674 | 20.08 | 45,173,453.92 | |
| | ALDAR PROPERTIES PJSC | 2,874,678 | 5.07 | 14,574,617.46 | |
| | EMAAR PROPERTIES PJSC | 4,052,022 | 7.45 | 30,187,563.90 | |
| | アラブディルハム 小計 | 22,551,074 | | 190,352,971.79 (7,669,321,233) | |
| ポーランドズロチ | ORLEN SA | 342,553 | 60.47 | 20,714,179.91 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 79,255 | 111.85 | 8,864,671.75 | |
| | BUDIMEX | 7,879 | 650.00 | 5,121,350.00 | |
| | LPP SA | 672 | 15,000.00 | 10,080,000.00 | |
| | CD PROJEKT SA | 39,305 | 106.35 | 4,180,086.75 | |
| | CYFROWY POLSAT SA | 150,511 | 10.91 | 1,642,075.01 | |
| | ALLEGRO.EU SA | 294,056 | 30.20 | 8,880,491.20 | |
| | PEPCO GROUP NV | 65,200 | 21.64 | 1,410,928.00 | |
| | DINO POLSKA SA | 25,229 | 423.10 | 10,674,389.90 | |
| | BANK PEKAO SA | 113,342 | 146.45 | 16,598,935.90 | |
| | MBANK SA | 8,679 | 498.20 | 4,323,877.80 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 490,314 | 48.75 | 23,902,807.50 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 17,302 | 460.80 | 7,972,761.60 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 457,338 | 46.50 | 21,266,217.00 | |
| PGE SA | 422,950 | 8.22 | 3,477,494.90 | | |
| | ポーランドズロチ 小計 | 2,514,585 | | 149,110,267.22 (5,458,598,840) | |
| 南アフリカランド | EXXARO RESOURCES LTD | 127,751 | 189.13 | 24,161,546.63 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 33,259 | 848.37 | 28,215,937.83 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI PLC | 249,911 | 329.52 | 82,350,672.72 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 528,313 | 261.86 | 138,344,042.18 | |
| | HARMONY GOLD MINING CO LTD | 325,035 | 119.62 | 38,880,686.70 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 590,056 | 76.20 | 44,962,267.20 | |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 35,041 | 561.22 | 19,665,710.02 | |
| | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 183,913 | 133.55 | 24,561,581.15 | |
| | SASOL LTD | 317,880 | 161.90 | 51,464,772.00 | |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 1,896,239 | 22.57 | 42,798,114.23 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 146,948 | 246.26 | 36,187,414.48 | |
| | NASPERS LTD-N SHS | 114,881 | 3,172.50 | 364,459,972.50 | |
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 1,021,247 | 19.78 | 20,200,265.66 | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 480,830 | 69.84 | 33,581,167.20 | | |

| | | | | | |
|--------|-------------------------------|------------|----------|--------------------------------------|--|
| | BID CORP LTD | 184,622 | 436.96 | 80,672,429.12 | |
| | CLICKS GROUP LTD | 148,332 | 297.78 | 44,170,302.96 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 281,193 | 266.98 | 75,072,907.14 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 223,949 | 193.85 | 43,412,513.65 | |
| | ABSA GROUP LTD | 499,810 | 159.19 | 79,564,753.90 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 48,224 | 2,050.00 | 98,859,200.00 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 421,373 | 213.04 | 89,769,303.92 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 735,750 | 197.50 | 145,310,625.00 | |
| | FIRSTRAND LTD | 2,894,590 | 67.50 | 195,384,825.00 | |
| | REINET INVESTMENTS SCA | 84,585 | 465.33 | 39,359,938.05 | |
| | REMGRO LTD | 267,319 | 153.18 | 40,947,924.42 | |
| | DISCOVERY LTD | 299,449 | 134.44 | 40,257,923.56 | |
| | OLD MUTUAL LTD | 2,345,236 | 12.19 | 28,588,426.84 | |
| | OUTSURANCE GROUP LTD | 394,727 | 41.81 | 16,503,535.87 | |
| | SANLAM LTD | 940,616 | 71.12 | 66,896,609.92 | |
| | MTN GROUP LTD | 1,220,409 | 101.14 | 123,432,166.26 | |
| | VODACOM GROUP LTD | 430,847 | 100.03 | 43,097,625.41 | |
| | NEPI ROCKCASTLE N.V. | 264,758 | 123.19 | 32,615,538.02 | |
| | 南アフリカランド 小計 | 17,737,093 | | 2,233,750,699.54 (17,467,930,470) | |
| オフショア元 | CHINA MERCHANTS ENERGY -A | 176,500 | 6.62 | 1,168,430.00 | |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 1,126,325 | 5.89 | 6,634,054.25 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 236,728 | 35.12 | 8,313,887.36 | |
| | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A | 124,900 | 13.62 | 1,701,138.00 | |
| | GUANGHUI ENERGY CO LTD-A | 235,000 | 7.55 | 1,774,250.00 | |
| | OFFSHORE OIL ENGINEERING-A | 42,000 | 5.81 | 244,020.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-A | 685,100 | 7.99 | 5,473,949.00 | |
| | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 409,600 | 23.70 | 9,707,520.00 | |
| | SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A | 222,000 | 9.97 | 2,213,340.00 | |
| | SHANXI COKING COAL ENERGY-A | 142,970 | 10.43 | 1,491,177.10 | |
| | SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A | 100,900 | 23.35 | 2,356,015.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO-A | 150,082 | 22.28 | 3,343,826.96 | |
| | YANTAI JEREH OILFIELD-A | 9,100 | 27.92 | 254,072.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 650,300 | 5.64 | 3,667,692.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 173,900 | 22.60 | 3,930,140.00 | |
| | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 681,496 | 6.08 | 4,143,495.68 | |

| | | | |
|-------------------------------|-----------|-------|--------------|
| CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A | 20,540 | 23.02 | 472,830.80 |
| CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A | 27,200 | 23.76 | 646,272.00 |
| CHINA JUSHI CO LTD -A | 110,447 | 9.54 | 1,053,664.38 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 123,100 | 17.98 | 2,213,338.00 |
| CHINA RARE EARTH RESOURCES-A | 32,500 | 24.99 | 812,175.00 |
| CMOC GROUP LTD-A | 515,101 | 5.42 | 2,791,847.42 |
| CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A | 54,324 | 47.28 | 2,568,438.72 |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A | 102,531 | 40.61 | 4,163,783.91 |
| GEM CO LTD-A | 131,700 | 4.97 | 654,549.00 |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 84,280 | 21.65 | 1,824,662.00 |
| HENAN SHENHUO COAL & POWER-A | 125,100 | 16.83 | 2,105,433.00 |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A | 257,100 | 12.40 | 3,188,040.00 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO -A | 537,748 | 6.62 | 3,559,891.76 |
| HESTEEL CO LTD-A | 1,596,100 | 2.11 | 3,367,771.00 |
| HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A | 27,200 | 48.99 | 1,332,528.00 |
| HUAFON CHEMICAL CO LTD -A | 106,636 | 6.39 | 681,404.04 |
| HUAIIBEI MINING HOLDINGS CO-A | 131,200 | 17.59 | 2,307,808.00 |
| HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A | 38,600 | 17.72 | 683,992.00 |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A | 185,200 | 5.41 | 1,001,932.00 |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A | 2,282,300 | 1.47 | 3,354,981.00 |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 482,916 | 3.67 | 1,772,301.72 |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 290,586 | 9.85 | 2,862,272.10 |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A | 30,160 | 54.91 | 1,656,085.60 |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A | 99,100 | 18.14 | 1,797,674.00 |
| JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A | 181,400 | 9.78 | 1,774,092.00 |
| LB GROUP CO LTD-A | 59,600 | 16.60 | 989,360.00 |
| NINGBO SHANSHAN CO LTD-A | 338,100 | 11.60 | 3,921,960.00 |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A | 319,800 | 14.16 | 4,528,368.00 |
| PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 697,700 | 3.01 | 2,100,077.00 |
| QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A | 211,600 | 15.20 | 3,216,320.00 |
| RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A | 325,971 | 9.75 | 3,178,217.25 |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A | 84,740 | 14.48 | 1,227,035.20 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 90,424 | 20.59 | 1,861,830.16 |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A | 199,150 | 25.62 | 5,102,223.00 |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A | 336,100 | 2.94 | 988,134.00 |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A | 233,900 | 12.34 | 2,886,326.00 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|-------|--------------|
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 101,726 | 18.83 | 1,915,500.58 |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A | 145,500 | 5.85 | 851,175.00 |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A | 1,174,400 | 3.70 | 4,345,280.00 |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 20,880 | 41.61 | 868,816.80 |
| SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A | 19,040 | 49.85 | 949,144.00 |
| SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A | 17,980 | 12.26 | 220,434.80 |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A | 47,100 | 15.30 | 720,630.00 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A | 58,100 | 2.78 | 161,518.00 |
| SKSHU PAINT CO LTD-A | 13,524 | 40.62 | 549,344.88 |
| TIANQI LITHIUM CORP-A | 59,200 | 56.01 | 3,315,792.00 |
| TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A | 100,000 | 5.54 | 554,000.00 |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A | 60,900 | 13.05 | 794,745.00 |
| TONGLING NONFERROUS METALS-A | 510,800 | 3.12 | 1,593,696.00 |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A | 95,000 | 72.09 | 6,848,550.00 |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 7,840 | 23.71 | 185,886.40 |
| WESTERN MINING CO -A | 163,200 | 14.60 | 2,382,720.00 |
| WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A | 23,240 | 39.81 | 925,184.40 |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A | 13,400 | 16.56 | 221,904.00 |
| YINTAI GOLD CO LTD-A | 199,060 | 13.90 | 2,766,934.00 |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS-A | 14,560 | 51.90 | 755,664.00 |
| YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A | 122,042 | 10.98 | 1,340,021.16 |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A | 34,651 | 49.46 | 1,713,838.46 |
| YUNNAN YUNTIANHUA CO-A | 40,000 | 15.65 | 626,000.00 |
| ZANGGE MINING CO LTD-A | 34,400 | 26.24 | 902,656.00 |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 55,015 | 28.65 | 1,576,179.75 |
| ZHEJIANG JUHUA CO-A | 107,700 | 16.00 | 1,723,200.00 |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A | 204,800 | 7.94 | 1,626,112.00 |
| ZHONGJIN GOLD CORP-A | 349,900 | 9.33 | 3,264,567.00 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 673,600 | 12.05 | 8,116,880.00 |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL-A | 78,931 | 16.85 | 1,329,987.35 |
| AECC AVIATION POWER CO-A | 79,200 | 33.84 | 2,680,128.00 |
| AVICOPTER PLC-A | 37,400 | 35.59 | 1,331,066.00 |
| BEIJING EASPRING MATERIAL-A | 14,200 | 35.90 | 509,780.00 |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 66,800 | 27.44 | 1,832,992.00 |
| BEIJING UNITED INFORMATION-A | 25,019 | 20.49 | 512,639.31 |
| CHINA BAOAN GROUP-A | 49,260 | 11.73 | 577,819.80 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A | 73,000 | 30.79 | 2,247,670.00 |
| CHINA ENERGY ENGINEERING C-A | 1,252,100 | 2.17 | 2,717,057.00 |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL-A | 98,000 | 6.56 | 642,880.00 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A | 1,045,600 | 6.41 | 6,702,296.00 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A | 1,305,480 | 5.10 | 6,657,948.00 |
| CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A | 391,100 | 5.27 | 2,061,097.00 |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 149,254 | 155.00 | 23,134,370.00 |
| CRRC CORP LTD-A | 1,139,000 | 5.67 | 6,458,130.00 |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 144,760 | 14.76 | 2,136,657.60 |
| EVE ENERGY CO LTD-A | 67,288 | 38.93 | 2,619,521.84 |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A | 1,305,243 | 4.75 | 6,199,904.25 |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A | 73,700 | 8.15 | 600,655.00 |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A | 9,750 | 70.64 | 688,740.00 |
| GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A | 129,800 | 7.48 | 970,904.00 |
| GONEO GROUP CO LTD-A | 34,400 | 93.60 | 3,219,840.00 |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A | 231,800 | 19.40 | 4,496,920.00 |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A | 9,940 | 24.11 | 239,653.40 |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 62,532 | 52.45 | 3,279,803.40 |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A | 103,700 | 12.40 | 1,285,880.00 |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A | 47,400 | 12.96 | 614,304.00 |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 527,534 | 3.29 | 1,735,586.86 |
| MING YANG SMART ENERGY GRO-A | 47,900 | 10.80 | 517,320.00 |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | 272,409 | 21.24 | 5,785,967.16 |
| NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A | 26,700 | 78.10 | 2,085,270.00 |
| NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A | 24,000 | 38.18 | 916,320.00 |
| NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A | 8,300 | 33.46 | 277,718.00 |
| NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A | 49,900 | 12.57 | 627,243.00 |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 512,700 | 5.02 | 2,573,754.00 |
| PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A | 3,400 | 100.23 | 340,782.00 |
| RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A | 79,700 | 21.50 | 1,713,550.00 |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 340,616 | 13.50 | 4,598,316.00 |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A | 84,500 | 2.42 | 204,490.00 |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 407,700 | 4.13 | 1,683,801.00 |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 49,851 | 55.74 | 2,778,694.74 |
| SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A | 185,640 | 7.98 | 1,481,407.20 |
| SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A | 60,100 | 51.55 | 3,098,155.00 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 63,100 | 90.00 | 5,679,000.00 |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A | 37,600 | 13.09 | 492,184.00 |
| TBEA CO LTD-A | 217,100 | 14.53 | 3,154,463.00 |
| TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A | 12,000 | 9.91 | 118,920.00 |
| WEICHAI POWER CO LTD-A | 285,251 | 15.09 | 4,304,437.59 |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A | 363,600 | 5.67 | 2,061,612.00 |
| XIAMEN C & D INC-A | 26,900 | 10.26 | 275,994.00 |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A | 36,000 | 20.67 | 744,120.00 |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A | 4,620 | 53.32 | 246,338.40 |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A | 113,500 | 22.23 | 2,523,105.00 |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A | 221,000 | 13.81 | 3,052,010.00 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A | 45,200 | 36.07 | 1,630,364.00 |
| ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A | 90,500 | 6.35 | 574,675.00 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A | 143,900 | 7.25 | 1,043,275.00 |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 74,300 | 33.65 | 2,500,195.00 |
| ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A | 489,300 | 3.30 | 1,614,690.00 |
| ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A | 58,110 | 16.84 | 978,572.40 |
| AIR CHINA LTD-A | 287,800 | 7.42 | 2,135,476.00 |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A | 1,533,100 | 4.94 | 7,573,514.00 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A | 547,400 | 3.90 | 2,134,860.00 |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 444,100 | 6.00 | 2,664,600.00 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 469,130 | 10.05 | 4,714,756.50 |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A | 361,700 | 7.43 | 2,687,431.00 |
| HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A | 2,330,900 | 1.40 | 3,263,260.00 |
| LIAONING PORT CO LTD-A | 2,697,000 | 1.42 | 3,829,740.00 |
| S F HOLDING CO LTD-A | 142,200 | 38.42 | 5,463,324.00 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 38,100 | 34.20 | 1,303,020.00 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 139,900 | 5.48 | 766,652.00 |
| SPRING AIRLINES CO LTD-A | 54,200 | 53.04 | 2,874,768.00 |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A | 75,200 | 12.04 | 905,408.00 |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A | 78,060 | 6.81 | 531,588.60 |
| ANHUI JIANGHUAI AUTO GROUP-A | 109,000 | 13.84 | 1,508,560.00 |
| BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A | 288,700 | 4.99 | 1,440,613.00 |
| BYD CO LTD -A | 58,300 | 189.90 | 11,071,170.00 |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | 20,100 | 130.58 | 2,624,658.00 |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A | 274,190 | 14.34 | 3,931,884.60 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 46,838 | 37.48 | 1,755,488.24 |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A | 92,554 | 22.30 | 2,063,954.20 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A | 348,900 | 8.46 | 2,951,694.00 |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A | 68,200 | 16.68 | 1,137,576.00 |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A | 12,000 | 97.30 | 1,167,600.00 |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A | 12,360 | 16.26 | 200,973.60 |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A | 51,300 | 53.21 | 2,729,673.00 |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A | 159,244 | 13.76 | 2,191,197.44 |
| SAILUN GROUP CO LTD-A | 107,100 | 11.33 | 1,213,443.00 |
| SERES GROUP CO L-A | 55,300 | 65.00 | 3,594,500.00 |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 37,400 | 20.66 | 772,684.00 |
| SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A | 8,700 | 71.97 | 626,139.00 |
| BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A | 5,900 | 288.02 | 1,699,318.00 |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A | 11,400 | 37.51 | 427,614.00 |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 77,853 | 33.66 | 2,620,531.98 |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A | 208,929 | 22.05 | 4,606,884.45 |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A | 9,000 | 21.28 | 191,520.00 |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A | 16,120 | 34.50 | 556,140.00 |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A | 12,917 | 65.27 | 843,092.59 |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A | 5,200 | 51.54 | 268,008.00 |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 27,000 | 29.72 | 802,440.00 |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 24,843 | 10.05 | 249,672.15 |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A | 75,300 | 18.83 | 1,417,899.00 |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 27,900 | 8.22 | 229,338.00 |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 626,202 | 5.92 | 3,707,115.84 |
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A | 700 | 205.60 | 143,920.00 |
| KUNLUN TECH CO LTD-A | 56,000 | 36.60 | 2,049,600.00 |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 80,780 | 23.22 | 1,875,711.60 |
| ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A | 241,100 | 7.41 | 1,786,551.00 |
| PEOPLE.CN CO LTD-A | 55,400 | 25.00 | 1,385,000.00 |
| PERFECT WORLD CO LTD-A | 18,300 | 10.63 | 194,529.00 |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A | 126,520 | 4.96 | 627,539.20 |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A | 60,699 | 86.90 | 5,274,743.10 |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A | 30,800 | 6.42 | 197,736.00 |
| WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A | 48,200 | 4.41 | 212,562.00 |
| ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A | 344,500 | 7.68 | 2,645,760.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 19,704 | 24.04 | 473,684.16 |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 84,971 | 38.81 | 3,297,724.51 |
| ANGEL YEAST CO LTD-A | 7,800 | 33.27 | 259,506.00 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 10,200 | 212.50 | 2,167,500.00 |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 46,625 | 41.30 | 1,925,612.50 |
| ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A | 21,800 | 55.94 | 1,219,492.00 |
| ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A | 5,900 | 79.97 | 471,823.00 |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 40,300 | 5.15 | 207,545.00 |
| BEIJING YANJING BREWERY CO-A | 234,000 | 8.25 | 1,930,500.00 |
| CHONGQING BREWERY CO-A | 16,080 | 60.69 | 975,895.20 |
| EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A | 17,500 | 165.36 | 2,893,800.00 |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 143,133 | 35.82 | 5,127,024.06 |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A | 9,800 | 15.69 | 153,762.00 |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A | 49,519 | 39.31 | 1,946,591.89 |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE-A | 118,600 | 11.73 | 1,391,178.00 |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 87,500 | 27.95 | 2,445,625.00 |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A | 293,000 | 27.07 | 7,931,510.00 |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 32,590 | 43.54 | 1,418,968.60 |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A | 44,981 | 96.20 | 4,327,172.20 |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A | 3,600 | 68.09 | 245,124.00 |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 7,600 | 24.55 | 186,580.00 |
| JUEWEI FOOD CO LTD-A | 5,500 | 22.68 | 124,740.00 |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 47,853 | 1,638.00 | 78,383,214.00 |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A | 48,255 | 155.80 | 7,518,129.00 |
| MUYUAN FOODS CO LTD-A | 190,980 | 36.03 | 6,881,009.40 |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A | 209,700 | 8.46 | 1,774,062.00 |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A | 24,705 | 23.02 | 568,709.10 |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 44,360 | 204.29 | 9,062,304.40 |
| SHEDE SPIRITS CO LTD-A | 22,300 | 90.09 | 2,009,007.00 |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A | 12,600 | 50.76 | 639,576.00 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A | 18,161 | 72.71 | 1,320,486.31 |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO L-A | 261,140 | 18.82 | 4,914,654.80 |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A | 147,900 | 131.11 | 19,391,169.00 |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 23,700 | 30.72 | 728,064.00 |
| YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A | 12,500 | 13.23 | 165,375.00 |
| BY-HEALTH CO LTD-A | 133,500 | 15.97 | 2,131,995.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A | 9,700 | 63.99 | 620,703.00 |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 276,792 | 13.95 | 3,861,248.40 |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A | 128,900 | 28.28 | 3,645,292.00 |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 4,400 | 56.71 | 249,524.00 |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A | 57,140 | 33.07 | 1,889,619.80 |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A | 64,300 | 33.99 | 2,185,557.00 |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A | 37,130 | 7.13 | 264,736.90 |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A | 95,160 | 14.04 | 1,336,046.40 |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 35,560 | 5.00 | 177,800.00 |
| OVCTEK CHINA INC-A | 17,260 | 19.52 | 336,915.20 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A | 183,900 | 16.84 | 3,096,876.00 |
| SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A | 31,700 | 138.59 | 4,393,303.00 |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 38,300 | 283.85 | 10,871,455.00 |
| SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A | 49,300 | 74.52 | 3,673,836.00 |
| TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A | 7,000 | 68.22 | 477,540.00 |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO-A | 15,000 | 13.69 | 205,350.00 |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A | 19,040 | 98.30 | 1,871,632.00 |
| BEIJING TONGRENTANG CO-A | 29,900 | 51.14 | 1,529,086.00 |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A | 13,804 | 60.38 | 833,485.52 |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A | 3,800 | 42.19 | 160,322.00 |
| BGI GENOMICS CO LTD-A | 17,000 | 42.78 | 727,260.00 |
| BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A | 34,200 | 68.41 | 2,339,622.00 |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A | 8,700 | 124.02 | 1,078,974.00 |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 36,000 | 53.16 | 1,913,760.00 |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 90,296 | 49.70 | 4,487,711.20 |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A | 255,600 | 50.45 | 12,895,020.00 |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 7,089 | 48.86 | 346,368.54 |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 54,190 | 18.97 | 1,027,984.30 |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A | 29,900 | 22.21 | 664,079.00 |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A | 8,100 | 305.55 | 2,474,955.00 |
| JIANGSU HENGRUI PHARMACEUT-A | 196,043 | 41.20 | 8,076,971.60 |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A | 18,400 | 11.51 | 211,784.00 |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A | 5,800 | 35.19 | 204,102.00 |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A | 210,622 | 13.99 | 2,946,601.78 |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-A | 28,125 | 25.28 | 711,000.00 |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A | 10,780 | 16.07 | 173,234.60 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A | 112,400 | 23.37 | 2,626,788.00 |
| SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A | 24,600 | 32.41 | 797,286.00 |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A | 240,500 | 6.85 | 1,647,425.00 |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 129,825 | 23.85 | 3,096,326.25 |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A | 89,800 | 28.90 | 2,595,220.00 |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A | 76,100 | 22.29 | 1,696,269.00 |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 106,800 | 24.86 | 2,655,048.00 |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A | 180,580 | 19.59 | 3,537,562.20 |
| WUXI APPTEC CO LTD-A | 87,811 | 73.29 | 6,435,668.19 |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 80,260 | 49.08 | 3,939,160.80 |
| ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A | 19,300 | 228.00 | 4,400,400.00 |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A | 13,860 | 13.08 | 181,288.80 |
| ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A | 25,700 | 20.53 | 527,621.00 |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A | 85,176 | 16.90 | 1,439,474.40 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 2,735,000 | 3.80 | 10,393,000.00 |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A | 751,100 | 4.90 | 3,680,390.00 |
| BANK OF CHENGDU CO LTD-A | 137,793 | 12.17 | 1,676,940.81 |
| BANK OF CHINA LTD-A | 1,412,300 | 4.15 | 5,861,045.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 1,209,833 | 5.90 | 7,138,014.70 |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A | 151,000 | 10.57 | 1,596,070.00 |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A | 576,750 | 7.13 | 4,112,227.50 |
| BANK OF NANJING CO LTD -A | 321,500 | 7.99 | 2,568,785.00 |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A | 236,111 | 21.15 | 4,993,747.65 |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A | 543,311 | 6.35 | 3,450,024.85 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 257,100 | 6.70 | 1,722,570.00 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 1,913,010 | 3.07 | 5,872,940.70 |
| CHINA MERCHANTS BANK-A | 653,899 | 30.90 | 20,205,479.10 |
| CHINA MINSHENG BANKING-A | 1,426,128 | 3.88 | 5,533,376.64 |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 1,093,500 | 2.67 | 2,919,645.00 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A | 650,600 | 4.23 | 2,752,038.00 |
| CNPC CAPITAL CO LTD-A | 361,100 | 5.98 | 2,159,378.00 |
| HUAXIA BANK CO LTD-A | 679,150 | 5.97 | 4,054,525.50 |
| IND & COMM BK OF CHINA-A | 2,029,428 | 5.01 | 10,167,434.28 |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 740,574 | 15.47 | 11,456,679.78 |
| PING AN BANK CO LTD-A | 679,061 | 9.50 | 6,451,079.50 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 874,400 | 4.63 | 4,048,472.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 884,337 | 6.77 | 5,986,961.49 |
| SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A | 749,400 | 6.32 | 4,736,208.00 |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A | 461,900 | 3.47 | 1,602,793.00 |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A | 452,855 | 7.66 | 3,468,869.30 |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 322,834 | 5.23 | 1,688,421.82 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 223,500 | 11.89 | 2,657,415.00 |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 58,000 | 7.65 | 443,700.00 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A | 96,092 | 34.34 | 3,299,799.28 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 159,900 | 13.43 | 2,147,457.00 |
| CITIC SECURITIES CO-A | 397,445 | 20.56 | 8,171,469.20 |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A | 192,700 | 22.75 | 4,383,925.00 |
| DONGXING SECURITIES CO LT-A | 26,200 | 7.95 | 208,290.00 |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A | 522,334 | 13.35 | 6,973,158.90 |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A | 101,600 | 16.11 | 1,636,776.00 |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 97,100 | 5.55 | 538,905.00 |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A | 299,965 | 7.51 | 2,252,737.15 |
| GF SECURITIES CO LTD-A | 281,900 | 14.08 | 3,969,152.00 |
| GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A | 110,261 | 5.99 | 660,463.39 |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A | 51,600 | 10.40 | 536,640.00 |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A | 229,500 | 8.40 | 1,927,800.00 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 173,625 | 15.06 | 2,614,792.50 |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A | 31,900 | 6.67 | 212,773.00 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A | 242,979 | 9.30 | 2,259,704.70 |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 13,530 | 129.20 | 1,748,076.00 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 313,740 | 14.26 | 4,473,932.40 |
| HUAXI SECURITIES CO LTD-A | 24,900 | 8.00 | 199,200.00 |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A | 180,700 | 5.65 | 1,020,955.00 |
| NANJING SECURITIES CO LTD-A | 226,900 | 7.84 | 1,778,896.00 |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A | 341,800 | 8.75 | 2,990,750.00 |
| SDIC CAPITAL CO LTD-A | 343,400 | 6.81 | 2,338,554.00 |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A | 26,900 | 5.24 | 140,956.00 |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A | 634,714 | 4.43 | 2,811,783.02 |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD-A | 210,300 | 8.70 | 1,829,610.00 |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A | 246,100 | 7.14 | 1,757,154.00 |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 53,700 | 3.94 | 211,578.00 |
| TIANFENG SECURITIES CO LTD-A | 567,600 | 3.11 | 1,765,236.00 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A | 247,600 | 6.27 | 1,552,452.00 |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 74,000 | 10.05 | 743,700.00 |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A | 132,200 | 6.81 | 900,282.00 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A | 85,400 | 28.69 | 2,450,126.00 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 212,000 | 24.77 | 5,251,240.00 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 135,086 | 31.22 | 4,217,384.92 |
| PICC HOLDING CO-A | 647,000 | 5.10 | 3,299,700.00 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 412,422 | 41.15 | 16,971,165.30 |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 319,600 | 7.85 | 2,508,860.00 |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A | 17,500 | 242.46 | 4,243,050.00 |
| BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 21,403 | 8.21 | 175,718.63 |
| DHC SOFTWARE CO LTD -A | 281,500 | 5.49 | 1,545,435.00 |
| EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A | 17,600 | 88.67 | 1,560,592.00 |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A | 50,398 | 24.68 | 1,243,822.64 |
| IFLYTEK CO LTD - A | 82,885 | 42.60 | 3,530,901.00 |
| NAVINFO CO LTD-A | 411,400 | 7.70 | 3,167,780.00 |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A | 8,500 | 62.60 | 532,100.00 |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 42,276 | 44.60 | 1,885,509.60 |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 12,400 | 58.82 | 729,368.00 |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A | 87,015 | 12.96 | 1,127,714.40 |
| ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A | 20,100 | 76.07 | 1,529,007.00 |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A | 36,700 | 19.22 | 705,374.00 |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 1,238,900 | 3.74 | 4,633,486.00 |
| CETC CYBERSPACE SECURITY T-A | 26,600 | 18.74 | 498,484.00 |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 48,197 | 25.31 | 1,219,866.07 |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 164,000 | 9.27 | 1,520,280.00 |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A | 296,998 | 4.69 | 1,392,920.62 |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A | 13,700 | 49.70 | 680,890.00 |
| EVERDISPLAY OPTRONICS SHAN-A | 696,400 | 2.23 | 1,552,972.00 |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 473,900 | 15.08 | 7,146,412.00 |
| GOERTEK INC -A | 71,400 | 17.58 | 1,255,212.00 |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO -A | 166,500 | 10.40 | 1,731,600.00 |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A | 1,330,300 | 11.35 | 15,098,905.00 |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 49,000 | 39.64 | 1,942,360.00 |
| IEIT SYSTEMS CO LTD-A | 54,900 | 33.38 | 1,832,562.00 |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A | 109,400 | 11.96 | 1,308,424.00 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A | 217,700 | 5.32 | 1,158,164.00 |
| LUXSHARE PRECISIONIndustr-A | 210,512 | 29.13 | 6,132,214.56 |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 10,752 | 105.53 | 1,134,658.56 |
| NINESTAR CORP-A | 39,700 | 19.86 | 788,442.00 |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A | 140,200 | 16.52 | 2,316,104.00 |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A | 27,780 | 58.43 | 1,623,185.40 |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A | 31,000 | 145.00 | 4,495,000.00 |
| SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A | 51,475 | 38.49 | 1,981,272.75 |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A | 72,200 | 14.90 | 1,075,780.00 |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A | 918,300 | 4.28 | 3,930,324.00 |
| TIANJIN712 COMMUNICATION &-A | 9,000 | 28.02 | 252,180.00 |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A | 111,100 | 9.28 | 1,031,008.00 |
| UNISPLENDOUR CORP LTD-A | 110,648 | 17.79 | 1,968,427.92 |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 25,000 | 37.14 | 928,500.00 |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 157,032 | 6.31 | 990,871.92 |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A | 132,040 | 23.26 | 3,071,250.40 |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A | 6,300 | 97.01 | 611,163.00 |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 31,430 | 27.64 | 868,725.20 |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A | 75,700 | 17.28 | 1,308,096.00 |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A | 30,100 | 118.35 | 3,562,335.00 |
| ZTE CORP-A | 154,100 | 24.72 | 3,809,352.00 |
| CHINA UNITED NETWORK-A | 1,185,800 | 4.53 | 5,371,674.00 |
| CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A | 323,800 | 5.31 | 1,719,378.00 |
| CGN POWER CO LTD-A | 632,800 | 3.57 | 2,259,096.00 |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 240,000 | 8.24 | 1,977,600.00 |
| CHINA THREE GORGES RENEWAB-A | 1,122,300 | 4.47 | 5,016,681.00 |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 856,242 | 23.94 | 20,498,433.48 |
| ENN NATURAL GAS CO LTD-A | 73,600 | 17.56 | 1,292,416.00 |
| GD POWER DEVELOPMENT CO -A | 570,400 | 4.28 | 2,441,312.00 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A | 367,600 | 5.70 | 2,095,320.00 |
| HUANENG POWER INTL INC-A | 324,300 | 8.69 | 2,818,167.00 |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 390,500 | 13.32 | 5,201,460.00 |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A | 300,860 | 6.24 | 1,877,366.40 |
| SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A | 180,400 | 14.99 | 2,704,196.00 |
| WINTIME ENERGY GROUP CO L-A | 2,307,800 | 1.34 | 3,092,452.00 |
| ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A | 838,200 | 5.15 | 4,316,730.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| ADVANCED MICRO-FABRICATION-A | 20,700 | 134.96 | 2,793,672.00 |
| CAMBRICON TECHNOLOGIES-A | 10,000 | 132.81 | 1,328,100.00 |
| CHINA RESOURCES MICROELECT-A | 51,000 | 41.68 | 2,125,680.00 |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD-A | 101,300 | 24.30 | 2,461,590.00 |
| GALAXYCORE INC-A | 100,100 | 17.43 | 1,744,743.00 |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A | 35,556 | 74.16 | 2,636,832.96 |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 62,322 | 24.59 | 1,532,497.98 |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 33,200 | 20.82 | 691,224.00 |
| HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A | 12,911 | 30.38 | 392,236.18 |
| HYGON INFORMATION TECHNOLO-A | 71,200 | 73.20 | 5,211,840.00 |
| INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A | 10,100 | 53.19 | 537,219.00 |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 144,480 | 21.18 | 3,060,086.40 |
| JCET GROUP CO LTD-A | 47,200 | 25.72 | 1,213,984.00 |
| JINKO SOLAR CO LTD-A | 351,000 | 9.11 | 3,197,610.00 |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 385,389 | 22.30 | 8,594,174.70 |
| MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A | 52,600 | 51.67 | 2,717,842.00 |
| NATIONAL SILICON INDUSTRY -A | 189,500 | 15.56 | 2,948,620.00 |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A | 20,900 | 254.21 | 5,312,989.00 |
| PIOTECH INC-A | 7,900 | 182.00 | 1,437,800.00 |
| SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A | 358,200 | 12.71 | 4,552,722.00 |
| SG MICRO CORP-A | 7,897 | 65.76 | 519,306.72 |
| SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A | 102,200 | 18.07 | 1,846,754.00 |
| SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A | 8,600 | 66.22 | 569,492.00 |
| STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A | 3,500 | 163.21 | 571,235.00 |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A | 5,632 | 123.55 | 695,833.60 |
| TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A | 164,500 | 15.52 | 2,553,040.00 |
| TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A | 201,300 | 7.28 | 1,465,464.00 |
| TONGFU MICROELECTRONIC CO-A | 29,100 | 21.58 | 627,978.00 |
| TONGWEI CO LTD-A | 157,700 | 26.15 | 4,123,855.00 |
| TRINA SOLAR CO LTD-A | 56,200 | 26.65 | 1,497,730.00 |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 36,299 | 58.96 | 2,140,189.04 |
| WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A | 38,915 | 92.60 | 3,603,529.00 |
| XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A | 87,400 | 28.14 | 2,459,436.00 |
| ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 61,400 | 38.38 | 2,356,532.00 |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 242,622 | 8.94 | 2,169,040.68 |
| CHINA VANKE CO LTD -A | 424,956 | 9.96 | 4,232,561.76 |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|-------------|--------|--------------------------------------|--|
| | GEMDALE CORP-A | 42,900 | 4.28 | 183,612.00 | |
| | HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A | 498,187 | 3.61 | 1,798,455.07 | |
| | POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 357,000 | 9.60 | 3,427,200.00 | |
| | SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A | 58,700 | 10.88 | 638,656.00 | |
| | SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A | 160,740 | 10.38 | 1,668,481.20 | |
| | SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A | 268,100 | 3.08 | 825,748.00 | |
| | YOUNGOR FASHION CO LTD | 106,400 | 6.74 | 717,136.00 | |
| | オフショア元 小計 | 106,475,256 | | 1,254,876,290.26 (25,800,632,990) | |
| サウジアラビア リヤル | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 202,319 | 9.11 | 1,843,126.09 | |
| | SAUDI ARABIAN OIL CO | 1,547,524 | 31.55 | 48,824,382.20 | |
| | ADVANCED PETROCHEMICALS CO | 101,795 | 37.80 | 3,847,851.00 | |
| | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 198,764 | 11.70 | 2,325,538.80 | |
| | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO | 141,314 | 128.60 | 18,172,980.40 | |
| | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 202,755 | 30.95 | 6,275,267.25 | |
| | SAUDI ARABIAN MINING CO | 869,711 | 47.00 | 40,876,417.00 | |
| | SAUDI ARAMCO BASE OIL CO | 26,867 | 147.20 | 3,954,822.40 | |
| | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 521,863 | 78.80 | 41,122,804.40 | |
| | SAUDI IND INVESTMENT GROUP | 194,677 | 19.94 | 3,881,859.38 | |
| | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 362,675 | 9.70 | 3,517,947.50 | |
| | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 158,529 | 38.35 | 6,079,587.15 | |
| | SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP | 23,810 | 215.60 | 5,133,436.00 | |
| | JARIR MARKETING CO | 303,520 | 15.22 | 4,619,574.40 | |
| | NAHDI MEDICAL CO | 18,802 | 143.80 | 2,703,727.60 | |
| | ALMARAI CO | 144,974 | 59.70 | 8,654,947.80 | |
| | SAVOLA | 136,987 | 44.55 | 6,102,770.85 | |
| | DALLAH HEALTHCARE CO | 17,729 | 173.00 | 3,067,117.00 | |
| | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 48,783 | 295.60 | 14,420,254.80 | |
| | MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 60,419 | 123.00 | 7,431,537.00 | |
| | AL RAJHI BANK | 1,162,766 | 88.50 | 102,904,791.00 | |
| | ALINMA BANK | 545,623 | 42.90 | 23,407,226.70 | |
| | ARAB NATIONAL BANK | 405,036 | 25.50 | 10,328,418.00 | |
| | BANK AL-JAZIRA | 183,665 | 19.34 | 3,552,081.10 | |
| | BANK ALBILAD | 290,677 | 45.95 | 13,356,608.15 | |
| | BANQUE SAUDI FRANSI | 352,854 | 41.15 | 14,519,942.10 | |
| | RIYAD BANK | 865,575 | 29.45 | 25,491,183.75 | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
| | SAUDI AWWAL BANK | 599,339 | 37.70 | 22,595,080.30 | |
| | SAUDI INVESTMENT BANK/THE | 268,331 | 16.02 | 4,298,662.62 | |
| | THE SAUDI NATIONAL BANK | 1,730,883 | 43.05 | 74,514,513.15 | |
| | SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING | 29,391 | 215.80 | 6,342,577.80 | |
| | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE | 49,780 | 223.60 | 11,130,808.00 | |
| | CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | 40,167 | 126.60 | 5,085,142.20 | |
| | ARABIAN INTERNET & COMMUNICA | 11,999 | 333.20 | 3,998,066.80 | |
| | ELM CO | 14,004 | 924.20 | 12,942,496.80 | |
| | ETIHAD ETISALAT CO | 199,830 | 51.40 | 10,271,262.00 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 228,789 | 13.44 | 3,074,924.16 | |
| | SAUDI TELECOM CO | 1,329,690 | 42.65 | 56,711,278.50 | |
| | ACWA POWER CO | 56,238 | 244.80 | 13,767,062.40 | |
| | POWER & WATER UTILITY CO FOR | 34,137 | 64.40 | 2,198,422.80 | |
| | SAUDI ELECTRICITY CO | 434,114 | 19.02 | 8,256,848.28 | |
| | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 274,619 | 14.04 | 3,855,650.76 | |
| | サウジアラビアリヤル 小計 | 14,391,324 | | 665,458,996.39 (26,252,357,407) | |
| トルコリラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 544,304 | 144.80 | 78,815,219.20 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 884,882 | 42.82 | 37,890,647.24 | |
| | HEKTAS TICARET T. A. S | 473,600 | 17.43 | 8,254,848.00 | |
| | KOZA ALTIN ISLETMELERI AS | 491,871 | 20.48 | 10,073,518.08 | |
| | SASA POLYESTER SANAYI | 755,799 | 38.06 | 28,765,709.94 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 715,526 | 48.48 | 34,688,700.48 | |
| | KOC HOLDING AS | 798,602 | 154.60 | 123,463,869.20 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 688,169 | 47.88 | 32,949,531.72 | |
| | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | 23,874 | 729.50 | 17,416,083.00 | |
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 543,256 | 252.25 | 137,036,326.00 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 41,470 | 839.00 | 34,793,330.00 | |
| | TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA | 53,584 | 238.00 | 12,752,992.00 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 241,353 | 364.25 | 87,912,830.25 | |
| | AKBANK T. A. S. | 1,630,071 | 40.34 | 65,757,064.14 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 560,781 | 68.80 | 38,581,732.80 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 1,970,064 | 24.78 | 48,818,185.92 | |
| | YAPI VE KREDI BANKASI | 1,948,324 | 21.70 | 42,278,630.80 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 650,401 | 66.95 | 43,544,346.95 | |
| | トルコリラ 小計 | 13,015,931 | | 883,793,565.72 | |

| | | | | |
|---------|-------------------------------|---------------|-------|--------------------------------------|
| | | | | (4,310,526,358) |
| ユーロ | MOTOR OIL (HELLAS) SA | 40,905 | 26.00 | 1,063,530.00 |
| | MYTILINEOS S. A. | 59,964 | 38.90 | 2,332,599.60 |
| | OPAP SA | 103,580 | 16.18 | 1,675,924.40 |
| | FF GROUP | 5,889 | — | — |
| | JUMBO SA | 66,836 | 26.60 | 1,777,837.60 |
| | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS | 1,184,493 | 1.59 | 1,889,858.58 |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 1,330,927 | 1.74 | 2,317,809.37 |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 647,914 | 6.85 | 4,438,210.90 |
| | PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S | 420,120 | 3.43 | 1,442,692.08 |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 95,037 | 12.97 | 1,232,629.89 |
| | PUBLIC POWER CORP | 111,882 | 12.27 | 1,372,792.14 |
| | ユーロ 小計 | 4,067,547 | | 19,543,884.56 (3,130,343,989) |
| カタールリアル | QATAR FUEL QSC | 288,993 | 15.95 | 4,609,438.35 |
| | QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT) | 1,224,895 | 3.65 | 4,479,441.01 |
| | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 2,142,532 | 1.71 | 3,663,729.72 |
| | INDUSTRIES QATAR | 832,122 | 12.20 | 10,151,888.40 |
| | COMMERCIAL BANK PSQC | 1,761,049 | 5.57 | 9,809,042.93 |
| | DUKHAN BANK | 1,104,320 | 3.99 | 4,408,445.44 |
| | MASRAF AL RAYAN | 3,510,349 | 2.44 | 8,596,844.70 |
| | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC | 555,729 | 10.90 | 6,057,446.10 |
| | QATAR ISLAMIC BANK | 914,528 | 19.95 | 18,244,833.60 |
| | QATAR NATIONAL BANK | 2,690,428 | 16.05 | 43,181,369.40 |
| | OOREDOO QPSC | 397,674 | 10.70 | 4,255,111.80 |
| | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 266,231 | 17.55 | 4,672,354.05 |
| | BARWA REAL ESTATE CO | 3,105,300 | 2.90 | 9,005,370.00 |
| | カタールリアル 小計 | 18,794,150 | | 131,135,315.50 (5,322,782,456) |
| | 合 計 | 3,489,362,273 | | 593,681,414,280 (593,681,414,280) |

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|----------|------|-----------------------------|-----------|--------------------------------|----|
| メキシコペソ | 投資証券 | OPERADORA DE SITES MEX- A-1 | 648,200 | 12,341,728.00 | |
| | | PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA | 414,800 | 30,819,640.00 | |
| | | TRUST FIBRA UNO | 1,759,200 | 51,878,808.00 | |
| メキシコペソ合計 | | | 2,822,200 | 95,040,176.00 (816,157,511) | |
| 合計 | | | | 816,157,511 (816,157,511) | |

(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 49 銘柄 | 100.00% | — | 2.84% |
| 香港ドル | 株式 184 銘柄 | 100.00% | — | 19.27% |
| マレーシアリングgit | 株式 31 銘柄 | 100.00% | — | 1.35% |
| タイバーツ | 株式 38 銘柄 | 100.00% | — | 1.68% |
| フィリピンペソ | 株式 14 銘柄 | 100.00% | — | 0.64% |
| インドネシアルピア | 株式 22 銘柄 | 100.00% | — | 1.88% |
| メキシコペソ | 株式 21 銘柄 | 95.00% | — | 2.61% |
| | 投資証券 3 銘柄 | — | 5.00% | 0.14% |
| ブラジルリアル | 株式 48 銘柄 | 100.00% | — | 5.67% |
| チリペソ | 株式 12 銘柄 | 100.00% | — | 0.48% |
| 韓国ウォン | 株式 102 銘柄 | 100.00% | — | 11.96% |
| ニュー台湾ドル | 株式 90 銘柄 | 100.00% | — | 16.58% |
| インドルピー | 株式 132 銘柄 | 100.00% | — | 17.49% |
| チェココルナ | 株式 3 銘柄 | 100.00% | — | 0.14% |
| クウェートディナール | 株式 7 銘柄 | 100.00% | — | 0.85% |
| コロンビアペソ | 株式 3 銘柄 | 100.00% | — | 0.10% |
| ハンガリーフォリント | 株式 3 銘柄 | 100.00% | — | 0.27% |
| アラブディルハム | 株式 10 銘柄 | 100.00% | — | 1.29% |
| ポーランドズロチ | 株式 15 銘柄 | 100.00% | — | 0.92% |
| 南アフリカランド | 株式 32 銘柄 | 100.00% | — | 2.94% |
| オフショア元 | 株式 455 銘柄 | 100.00% | — | 4.34% |
| サウジアラビアリヤル | 株式 42 銘柄 | 100.00% | — | 4.42% |
| トルコリラ | 株式 18 銘柄 | 100.00% | — | 0.73% |
| ユーロ | 株式 11 銘柄 | 100.00% | — | 0.53% |
| カタールリアル | 株式 13 銘柄 | 100.00% | — | 0.90% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

| 資産の部 | |
|-------------|-----------------|
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,640,525,292 |
| 国債証券 | 648,869,193,030 |
| 地方債証券 | 41,609,810,988 |
| 特殊債券 | 35,817,564,204 |
| 社債券 | 46,098,431,000 |
| 派生商品評価勘定 | 1,107,195 |
| 未収利息 | 1,355,133,352 |
| 前払金 | 1,280,000 |
| 前払費用 | 56,712,840 |
| 差入委託証拠金 | 9,262,301 |
| 流動資産合計 | 777,459,020,202 |
| 資産合計 | 777,459,020,202 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 541,870 |
| 未払金 | 1,278,564,000 |
| 未払解約金 | 460,017,213 |
| 未払利息 | 930 |
| 流動負債合計 | 1,739,124,013 |
| 負債合計 | 1,739,124,013 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 608,533,464,538 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 167,186,431,651 |
| 元本等合計 | 775,719,896,189 |
| 純資産合計 | 775,719,896,189 |
| 負債純資産合計 | 777,459,020,202 |

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1月26日現在] |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2023年1月27日 |
| 期首元本額 | 532,608,638,593円 |
| 期中追加設定元本額 | 148,013,908,937円 |
| 期中一部解約元本額 | 72,089,082,992円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 7,439,665,045円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 10,747,372,867円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 2,746,619,059円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 56,245,340,662円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 101,594,469,109円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 32,245,984,304円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 206,252,058円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 187,735,541円 |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド | 1,827,705,511円 |
| eMAXIS 国内債券インデックス | 6,315,724,263円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 4,289,534,842円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 366,017,906円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 16,894,641,195円 |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金) | 41,964,317,139円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 10,933,832,987円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 5,120,983,499円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 2,339,723,792円 |
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス | 17,130,228,598円 |
| 国内債券セレクション(ラップ向け) | 10,386,091,705円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 21,633,546,373円 |
| つみたて8資産均等バランス | 10,569,951,144円 |
| つみたて4資産均等バランス | 3,991,081,280円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 18,465,486円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 13,949,889円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 388,372円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 6,161,677,827円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金) | 2,723,825,131円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金) | 1,084,392,404円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式15) | 7,011,048,577円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式40) | 6,685,295,313円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式65) | 4,045,555,457円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金) | 795,786,854円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式25) | 1,309,878,609円 |

| | |
|---|------------------|
| 国内債券インデックスファンド（ラップ向け） | 1,660,715,164円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 363,948,126円 |
| ラップ向けインデックスf 国内債券 | 6,122,351,446円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型） | 2,320,158,395円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型） | 2,481,706,998円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式80） | 8,227,364円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金） | 2,226,128円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型） | 128,465,862円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型） | 177,956,270円 |
| eMAXIS 債券バランス（2資産均等型） | 79,075,527円 |
| eMAXIS バランス（4資産均等型） | 1,598,521,756円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー） | 1,873,154,147円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー） | 1,105,939,774円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー） | 2,260,834,355円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード） | 124,356,518円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー） | 67,705,551円 |
| 三菱UFJ 日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定） | 5,930,424,927円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）VA（適格機関投資家限定） | 1,730円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定） | 26,467,888円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定） | 9,049,069,757円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定） | 647,222,252円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定） | 4,534,388,897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） | 118,262,383,144円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定） | 457,816,215円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定） | 1,513,204円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定） | 298,010円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定） | 4,358,131,074円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定） | 2,490,929,518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） | 2,980,339,781円 |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定） | 517,799,828円 |
| MUKAM 日本債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定） | 13,043,515,513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） | 1,911,787,835円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 2,054,382円 |
| 日本債券インデックスファンドS | 4,587,599,760円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 429,832,474円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定） | 424,280,144円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定） | 424,729,389円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 421,626,267円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 419,477,595円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定） | 420,955,442円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07（適 | 413,671,752円 |

| | |
|--|-------------------|
| 格機関投資家限定) | |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 416,234,104 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定) | 418,690,273 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定) | 416,840,490 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定) | 462,440,331 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定) | 469,323,041 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定) | 477,586,919 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定) | 478,244,702 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定) | 476,937,873 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定) | 490,248,647 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定) | 476,919,903 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定) | 477,769,455 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 18,482,885 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 22,946,508 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 3,232,856 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 9,646,171 円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 17,902,276 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 44,928,726 円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 9,036,107 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 28,788,479 円 |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド | 4,310,209,052 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) | 2,221,635,574 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) | 4,674,252,960 円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型) | 2,934,933,620 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) | 2,017,490,629 円 |
| 合計 | 608,533,464,538 円 |
| 2. 受益権の総数 | 608,533,464,538 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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該 |

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

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [2024年 1月 26日現在] |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年 1月 26日現在] |
|-------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | △21,831,403,370 |
| 地方債証券 | △363,460,622 |
| 特殊債券 | △480,471,881 |
| 社債券 | △112,483,000 |
| 合計 | △22,787,818,873 |

(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 1月 26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|--------|-------------|-------|-------------|---------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 731,130,000 | — | 731,700,000 | 570,000 |
| 合計 | | 731,130,000 | — | 731,700,000 | 570,000 |

(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。

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1月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,2747円 |
| (1万口当たり純資産額) | (12,747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445回利付国債(2年) | 2,890,000,000 | 2,891,734,000 | |
| | 第446回利付国債(2年) | 5,100,000,000 | 5,102,754,000 | |
| | 第447回利付国債(2年) | 1,020,000,000 | 1,020,530,400 | |
| | 第448回利付国債(2年) | 1,800,000,000 | 1,800,774,000 | |
| | 第449回利付国債(2年) | 2,220,000,000 | 2,220,732,600 | |
| | 第450回利付国債(2年) | 1,300,000,000 | 1,300,273,000 | |
| | 第451回利付国債(2年) | 2,700,000,000 | 2,700,405,000 | |
| | 第452回利付国債(2年) | 3,100,000,000 | 3,100,000,000 | |
| | 第453回利付国債(2年) | 1,300,000,000 | 1,299,779,000 | |
| | 第454回利付国債(2年) | 1,800,000,000 | 1,802,682,000 | |
| | 第455回利付国債(2年) | 1,850,000,000 | 1,849,149,000 | |
| | 第143回利付国債(5年) | 5,380,000,000 | 5,389,146,000 | |
| | 第144回利付国債(5年) | 6,380,000,000 | 6,390,590,800 | |
| | 第145回利付国債(5年) | 6,410,000,000 | 6,420,512,400 | |
| | 第146回利付国債(5年) | 5,150,000,000 | 5,157,261,500 | |
| | 第147回利付国債(5年) | 4,730,000,000 | 4,726,925,500 | |
| | 第148回利付国債(5年) | 5,100,000,000 | 5,095,716,000 | |
| | 第149回利付国債(5年) | 6,050,000,000 | 6,043,587,000 | |
| | 第150回利付国債(5年) | 1,930,000,000 | 1,926,931,300 | |
| | 第151回利付国債(5年) | 750,000,000 | 748,237,500 | |

| | | | |
|----------------|----------------|----------------|--|
| 第152回利付国債（5年） | 3,930,000,000 | 3,932,436,600 | |
| 第153回利付国債（5年） | 5,620,000,000 | 5,601,004,400 | |
| 第154回利付国債（5年） | 5,930,000,000 | 5,922,468,900 | |
| 第155回利付国債（5年） | 2,850,000,000 | 2,865,418,500 | |
| 第156回利付国債（5年） | 4,650,000,000 | 4,657,161,000 | |
| 第157回利付国債（5年） | 2,020,000,000 | 2,020,404,000 | |
| 第158回利付国債（5年） | 5,330,000,000 | 5,309,213,000 | |
| 第159回利付国債（5年） | 1,980,000,000 | 1,968,813,000 | |
| 第160回利付国債（5年） | 2,850,000,000 | 2,846,266,500 | |
| 第161回利付国債（5年） | 120,000,000 | 120,364,800 | |
| 第162回利付国債（5年） | 190,000,000 | 190,304,000 | |
| 第163回利付国債（5年） | 11,950,000,000 | 12,023,851,000 | |
| 第1回利付国債（40年） | 1,105,000,000 | 1,266,639,400 | |
| 第2回利付国債（40年） | 1,335,000,000 | 1,475,935,950 | |
| 第3回利付国債（40年） | 1,168,000,000 | 1,288,841,280 | |
| 第4回利付国債（40年） | 1,218,000,000 | 1,341,042,360 | |
| 第5回利付国債（40年） | 775,000,000 | 818,469,750 | |
| 第6回利付国債（40年） | 1,230,000,000 | 1,268,043,900 | |
| 第7回利付国債（40年） | 1,540,000,000 | 1,509,908,400 | |
| 第8回利付国債（40年） | 1,510,000,000 | 1,368,981,100 | |
| 第9回利付国債（40年） | 2,880,000,000 | 1,898,668,800 | |
| 第10回利付国債（40年） | 2,720,000,000 | 2,104,817,600 | |
| 第11回利付国債（40年） | 2,100,000,000 | 1,558,725,000 | |
| 第12回利付国債（40年） | 2,490,000,000 | 1,636,502,700 | |
| 第13回利付国債（40年） | 2,800,000,000 | 1,816,108,000 | |
| 第14回利付国債（40年） | 3,070,000,000 | 2,124,440,000 | |
| 第15回利付国債（40年） | 3,500,000,000 | 2,667,735,000 | |
| 第16回利付国債（40年） | 2,230,000,000 | 1,860,756,600 | |
| 第338回利付国債（10年） | 3,330,000,000 | 3,347,016,300 | |
| 第339回利付国債（10年） | 4,020,000,000 | 4,043,436,600 | |
| 第340回利付国債（10年） | 3,470,000,000 | 3,492,763,200 | |
| 第341回利付国債（10年） | 3,320,000,000 | 3,337,230,800 | |
| 第342回利付国債（10年） | 2,570,000,000 | 2,573,546,600 | |
| 第343回利付国債（10年） | 4,870,000,000 | 4,876,964,100 | |
| 第344回利付国債（10年） | 4,620,000,000 | 4,626,699,000 | |
| 第345回利付国債（10年） | 6,340,000,000 | 6,347,291,000 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第346回利付国債（10年） | 6,130,000,000 | 6,133,800,600 | |
| 第347回利付国債（10年） | 5,700,000,000 | 5,699,031,000 | |
| 第348回利付国債（10年） | 4,970,000,000 | 4,963,688,100 | |
| 第349回利付国債（10年） | 6,090,000,000 | 6,075,871,200 | |
| 第350回利付国債（10年） | 6,530,000,000 | 6,504,533,000 | |
| 第351回利付国債（10年） | 4,870,000,000 | 4,842,484,500 | |
| 第352回利付国債（10年） | 4,110,000,000 | 4,079,832,600 | |
| 第353回利付国債（10年） | 4,630,000,000 | 4,588,654,100 | |
| 第354回利付国債（10年） | 6,220,000,000 | 6,158,608,600 | |
| 第355回利付国債（10年） | 2,740,000,000 | 2,710,928,600 | |
| 第356回利付国債（10年） | 7,740,000,000 | 7,649,829,000 | |
| 第357回利付国債（10年） | 5,750,000,000 | 5,678,470,000 | |
| 第358回利付国債（10年） | 6,790,000,000 | 6,693,989,400 | |
| 第359回利付国債（10年） | 8,550,000,000 | 8,413,713,000 | |
| 第360回利付国債（10年） | 6,340,000,000 | 6,222,963,600 | |
| 第361回利付国債（10年） | 6,410,000,000 | 6,276,800,200 | |
| 第362回利付国債（10年） | 6,140,000,000 | 5,995,525,800 | |
| 第363回利付国債（10年） | 7,920,000,000 | 7,707,981,600 | |
| 第364回利付国債（10年） | 7,220,000,000 | 7,004,844,000 | |
| 第365回利付国債（10年） | 7,980,000,000 | 7,717,138,800 | |
| 第366回利付国債（10年） | 4,740,000,000 | 4,608,986,400 | |
| 第367回利付国債（10年） | 5,540,000,000 | 5,371,584,000 | |
| 第368回利付国債（10年） | 6,880,000,000 | 6,651,171,200 | |
| 第369回利付国債（10年） | 6,070,000,000 | 6,008,571,600 | |
| 第370回利付国債（10年） | 6,370,000,000 | 6,290,247,600 | |
| 第371回利付国債（10年） | 5,010,000,000 | 4,890,461,400 | |
| 第372回利付国債（10年） | 6,620,000,000 | 6,688,848,000 | |
| 第1回利付国債（30年） | 196,000,000 | 223,304,760 | |
| 第2回利付国債（30年） | 268,000,000 | 301,406,200 | |
| 第3回利付国債（30年） | 307,000,000 | 344,454,000 | |
| 第4回利付国債（30年） | 252,000,000 | 294,338,520 | |
| 第5回利付国債（30年） | 238,000,000 | 267,735,720 | |
| 第6回利付国債（30年） | 339,000,000 | 387,985,500 | |
| 第7回利付国債（30年） | 339,000,000 | 386,571,870 | |
| 第8回利付国債（30年） | 302,000,000 | 332,752,660 | |
| 第9回利付国債（30年） | 206,000,000 | 219,909,120 | |

| | | | |
|---------------|---------------|---------------|--|
| 第10回利付国債(30年) | 398,000,000 | 414,158,800 | |
| 第11回利付国債(30年) | 237,000,000 | 259,363,320 | |
| 第12回利付国債(30年) | 325,000,000 | 367,753,750 | |
| 第13回利付国債(30年) | 595,000,000 | 668,089,800 | |
| 第14回利付国債(30年) | 683,000,000 | 794,028,480 | |
| 第15回利付国債(30年) | 686,000,000 | 805,583,520 | |
| 第16回利付国債(30年) | 547,000,000 | 643,233,710 | |
| 第17回利付国債(30年) | 577,000,000 | 673,191,670 | |
| 第18回利付国債(30年) | 687,000,000 | 795,223,110 | |
| 第19回利付国債(30年) | 593,000,000 | 686,557,610 | |
| 第20回利付国債(30年) | 655,000,000 | 773,574,650 | |
| 第21回利付国債(30年) | 529,000,000 | 613,486,590 | |
| 第22回利付国債(30年) | 975,000,000 | 1,153,259,250 | |
| 第23回利付国債(30年) | 194,000,000 | 229,620,340 | |
| 第24回利付国債(30年) | 981,000,000 | 1,161,121,410 | |
| 第25回利付国債(30年) | 1,287,000,000 | 1,492,521,030 | |
| 第26回利付国債(30年) | 1,014,000,000 | 1,188,489,120 | |
| 第27回利付国債(30年) | 760,000,000 | 900,075,600 | |
| 第28回利付国債(30年) | 1,426,000,000 | 1,688,840,320 | |
| 第29回利付国債(30年) | 830,000,000 | 970,958,900 | |
| 第30回利付国債(30年) | 1,721,000,000 | 1,987,686,160 | |
| 第31回利付国債(30年) | 2,223,000,000 | 2,530,729,890 | |
| 第32回利付国債(30年) | 1,989,000,000 | 2,289,418,560 | |
| 第33回利付国債(30年) | 1,227,000,000 | 1,354,693,890 | |
| 第34回利付国債(30年) | 2,231,000,000 | 2,522,993,280 | |
| 第35回利付国債(30年) | 2,379,000,000 | 2,612,332,320 | |
| 第36回利付国債(30年) | 1,929,000,000 | 2,111,676,300 | |
| 第37回利付国債(30年) | 2,717,000,000 | 2,924,307,100 | |
| 第38回利付国債(30年) | 1,590,000,000 | 1,680,916,200 | |
| 第39回利付国債(30年) | 1,360,000,000 | 1,458,137,600 | |
| 第40回利付国債(30年) | 1,720,000,000 | 1,812,020,000 | |
| 第41回利付国債(30年) | 1,210,000,000 | 1,250,898,000 | |
| 第42回利付国債(30年) | 1,920,000,000 | 1,980,902,400 | |
| 第43回利付国債(30年) | 1,690,000,000 | 1,741,409,800 | |
| 第44回利付国債(30年) | 1,630,000,000 | 1,677,400,400 | |
| 第45回利付国債(30年) | 1,580,000,000 | 1,567,518,000 | |

| | | | |
|---------------|---------------|---------------|--|
| 第46回利付国債（30年） | 2,380,000,000 | 2,357,294,800 | |
| 第47回利付国債（30年） | 1,900,000,000 | 1,912,179,000 | |
| 第48回利付国債（30年） | 2,100,000,000 | 2,032,464,000 | |
| 第49回利付国債（30年） | 2,160,000,000 | 2,086,560,000 | |
| 第50回利付国債（30年） | 1,910,000,000 | 1,628,275,000 | |
| 第51回利付国債（30年） | 2,460,000,000 | 1,859,268,000 | |
| 第52回利付国債（30年） | 2,020,000,000 | 1,595,012,200 | |
| 第53回利付国債（30年） | 1,950,000,000 | 1,570,647,000 | |
| 第54回利付国債（30年） | 1,870,000,000 | 1,572,239,900 | |
| 第55回利付国債（30年） | 1,940,000,000 | 1,624,691,800 | |
| 第56回利付国債（30年） | 1,840,000,000 | 1,534,854,400 | |
| 第57回利付国債（30年） | 2,040,000,000 | 1,696,341,600 | |
| 第58回利付国債（30年） | 2,280,000,000 | 1,889,983,200 | |
| 第59回利付国債（30年） | 1,960,000,000 | 1,581,171,200 | |
| 第60回利付国債（30年） | 1,730,000,000 | 1,460,466,000 | |
| 第61回利付国債（30年） | 1,820,000,000 | 1,458,311,400 | |
| 第62回利付国債（30年） | 1,370,000,000 | 1,038,405,200 | |
| 第63回利付国債（30年） | 1,960,000,000 | 1,439,208,400 | |
| 第64回利付国債（30年） | 2,080,000,000 | 1,521,083,200 | |
| 第65回利付国債（30年） | 1,510,000,000 | 1,099,748,100 | |
| 第66回利付国債（30年） | 1,900,000,000 | 1,377,006,000 | |
| 第67回利付国債（30年） | 2,840,000,000 | 2,170,100,800 | |
| 第68回利付国債（30年） | 2,060,000,000 | 1,568,278,000 | |
| 第69回利付国債（30年） | 1,890,000,000 | 1,474,540,200 | |
| 第70回利付国債（30年） | 1,990,000,000 | 1,547,185,200 | |
| 第71回利付国債（30年） | 1,960,000,000 | 1,518,510,000 | |
| 第72回利付国債（30年） | 1,910,000,000 | 1,474,558,200 | |
| 第73回利付国債（30年） | 2,030,000,000 | 1,563,120,300 | |
| 第74回利付国債（30年） | 3,040,000,000 | 2,535,998,400 | |
| 第75回利付国債（30年） | 2,370,000,000 | 2,131,341,000 | |
| 第76回利付国債（30年） | 2,070,000,000 | 1,904,503,500 | |
| 第77回利付国債（30年） | 2,040,000,000 | 1,966,172,400 | |
| 第78回利付国債（30年） | 2,360,000,000 | 2,165,087,600 | |
| 第79回利付国債（30年） | 2,030,000,000 | 1,767,013,500 | |
| 第80回利付国債（30年） | 2,200,000,000 | 2,212,826,000 | |
| 第75回利付国債（20年） | 705,000,000 | 722,237,250 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第76回利付国債（20年） | 410,000,000 | 419,093,800 | |
| 第77回利付国債（20年） | 370,000,000 | 378,628,400 | |
| 第78回利付国債（20年） | 310,000,000 | 318,267,700 | |
| 第79回利付国債（20年） | 150,000,000 | 154,209,000 | |
| 第80回利付国債（20年） | 585,000,000 | 602,228,250 | |
| 第81回利付国債（20年） | 250,000,000 | 258,205,000 | |
| 第82回利付国債（20年） | 1,082,000,000 | 1,119,285,720 | |
| 第83回利付国債（20年） | 395,000,000 | 410,484,000 | |
| 第84回利付国債（20年） | 880,000,000 | 912,832,800 | |
| 第85回利付国債（20年） | 520,000,000 | 542,926,800 | |
| 第86回利付国債（20年） | 1,047,000,000 | 1,097,632,920 | |
| 第87回利付国債（20年） | 420,000,000 | 439,416,600 | |
| 第88回利付国債（20年） | 1,264,000,000 | 1,332,180,160 | |
| 第89回利付国債（20年） | 340,000,000 | 357,527,000 | |
| 第90回利付国債（20年） | 1,270,000,000 | 1,342,186,800 | |
| 第91回利付国債（20年） | 548,000,000 | 580,595,040 | |
| 第92回利付国債（20年） | 1,282,000,000 | 1,357,458,520 | |
| 第93回利付国債（20年） | 190,000,000 | 201,413,300 | |
| 第94回利付国債（20年） | 875,000,000 | 930,300,000 | |
| 第95回利付国債（20年） | 1,107,000,000 | 1,189,250,100 | |
| 第96回利付国債（20年） | 340,000,000 | 362,967,000 | |
| 第97回利付国債（20年） | 573,000,000 | 615,980,730 | |
| 第98回利付国債（20年） | 610,000,000 | 653,547,900 | |
| 第99回利付国債（20年） | 1,480,000,000 | 1,591,310,800 | |
| 第100回利付国債（20年） | 1,030,000,000 | 1,114,975,000 | |
| 第101回利付国債（20年） | 723,000,000 | 788,583,330 | |
| 第102回利付国債（20年） | 520,000,000 | 569,275,200 | |
| 第103回利付国債（20年） | 760,000,000 | 828,711,600 | |
| 第104回利付国債（20年） | 610,000,000 | 659,849,200 | |
| 第105回利付国債（20年） | 920,000,000 | 997,850,400 | |
| 第106回利付国債（20年） | 571,000,000 | 621,938,910 | |
| 第107回利付国債（20年） | 607,000,000 | 660,452,420 | |
| 第108回利付国債（20年） | 1,000,000,000 | 1,078,410,000 | |
| 第109回利付国債（20年） | 560,000,000 | 605,936,800 | |
| 第110回利付国債（20年） | 876,000,000 | 956,732,160 | |
| 第111回利付国債（20年） | 861,000,000 | 948,503,430 | |

| | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 第1 1 2 回利付国債（20年） | 1,050,000,000 | 1,151,146,500 | |
| 第1 1 3 回利付国債（20年） | 922,000,000 | 1,014,338,300 | |
| 第1 1 4 回利付国債（20年） | 1,600,000,000 | 1,766,688,000 | |
| 第1 1 5 回利付国債（20年） | 944,000,000 | 1,047,811,680 | |
| 第1 1 6 回利付国債（20年） | 461,000,000 | 513,314,280 | |
| 第1 1 7 回利付国債（20年） | 1,320,000,000 | 1,461,847,200 | |
| 第1 1 8 回利付国債（20年） | 520,000,000 | 574,152,800 | |
| 第1 1 9 回利付国債（20年） | 400,000,000 | 436,516,000 | |
| 第1 2 0 回利付国債（20年） | 780,000,000 | 841,456,200 | |
| 第1 2 1 回利付国債（20年） | 1,299,000,000 | 1,428,276,480 | |
| 第1 2 2 回利付国債（20年） | 100,000,000 | 109,304,000 | |
| 第1 2 3 回利付国債（20年） | 1,318,000,000 | 1,469,714,980 | |
| 第1 2 4 回利付国債（20年） | 1,240,000,000 | 1,374,416,000 | |
| 第1 2 5 回利付国債（20年） | 1,844,000,000 | 2,072,877,280 | |
| 第1 2 6 回利付国債（20年） | 200,000,000 | 221,972,000 | |
| 第1 2 7 回利付国債（20年） | 440,000,000 | 485,289,200 | |
| 第1 2 8 回利付国債（20年） | 1,974,000,000 | 2,178,684,060 | |
| 第1 2 9 回利付国債（20年） | 280,000,000 | 307,031,200 | |
| 第1 3 0 回利付国債（20年） | 1,862,000,000 | 2,043,898,780 | |
| 第1 3 1 回利付国債（20年） | 420,000,000 | 457,934,400 | |
| 第1 3 2 回利付国債（20年） | 187,000,000 | 203,955,290 | |
| 第1 3 3 回利付国債（20年） | 2,320,000,000 | 2,547,963,200 | |
| 第1 3 4 回利付国債（20年） | 4,545,000,000 | 4,997,182,050 | |
| 第1 3 5 回利付国債（20年） | 50,000,000 | 54,584,500 | |
| 第1 3 6 回利付国債（20年） | 190,000,000 | 205,857,400 | |
| 第1 3 7 回利付国債（20年） | 4,342,000,000 | 4,742,375,820 | |
| 第1 3 8 回利付国債（20年） | 160,000,000 | 172,118,400 | |
| 第1 3 9 回利付国債（20年） | 310,000,000 | 336,098,900 | |
| 第1 4 0 回利付国債（20年） | 2,817,000,000 | 3,079,150,020 | |
| 第1 4 1 回利付国債（20年） | 1,120,000,000 | 1,224,496,000 | |
| 第1 4 2 回利付国債（20年） | 3,090,000,000 | 3,405,828,900 | |
| 第1 4 3 回利付国債（20年） | 1,740,000,000 | 1,887,447,600 | |
| 第1 4 4 回利付国債（20年） | 1,520,000,000 | 1,635,656,800 | |
| 第1 4 5 回利付国債（20年） | 3,100,000,000 | 3,392,516,000 | |
| 第1 4 6 回利付国債（20年） | 3,420,000,000 | 3,742,369,200 | |
| 第1 4 7 回利付国債（20年） | 3,450,000,000 | 3,742,387,500 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第148回利付国債（20年） | 3,360,000,000 | 3,610,992,000 | |
| 第149回利付国債（20年） | 3,440,000,000 | 3,695,764,000 | |
| 第150回利付国債（20年） | 3,750,000,000 | 3,988,237,500 | |
| 第151回利付国債（20年） | 3,780,000,000 | 3,937,361,400 | |
| 第152回利付国債（20年） | 3,110,000,000 | 3,235,550,700 | |
| 第153回利付国債（20年） | 3,980,000,000 | 4,176,811,000 | |
| 第154回利付国債（20年） | 3,510,000,000 | 3,640,115,700 | |
| 第155回利付国債（20年） | 3,600,000,000 | 3,646,476,000 | |
| 第156回利付国債（20年） | 3,100,000,000 | 2,919,208,000 | |
| 第157回利付国債（20年） | 3,630,000,000 | 3,320,832,900 | |
| 第158回利付国債（20年） | 2,960,000,000 | 2,800,189,600 | |
| 第159回利付国債（20年） | 2,850,000,000 | 2,719,812,000 | |
| 第160回利付国債（20年） | 3,630,000,000 | 3,495,399,600 | |
| 第161回利付国債（20年） | 3,120,000,000 | 2,955,170,400 | |
| 第162回利付国債（20年） | 3,580,000,000 | 3,377,694,200 | |
| 第163回利付国債（20年） | 3,330,000,000 | 3,129,367,500 | |
| 第164回利付国債（20年） | 3,890,000,000 | 3,589,069,600 | |
| 第165回利付国債（20年） | 3,160,000,000 | 2,902,807,600 | |
| 第166回利付国債（20年） | 3,720,000,000 | 3,501,450,000 | |
| 第167回利付国債（20年） | 2,910,000,000 | 2,649,293,100 | |
| 第168回利付国債（20年） | 2,660,000,000 | 2,373,704,200 | |
| 第169回利付国債（20年） | 2,720,000,000 | 2,377,280,000 | |
| 第170回利付国債（20年） | 2,150,000,000 | 1,868,092,000 | |
| 第171回利付国債（20年） | 2,720,000,000 | 2,350,923,200 | |
| 第172回利付国債（20年） | 2,360,000,000 | 2,062,923,200 | |
| 第173回利付国債（20年） | 3,150,000,000 | 2,739,208,500 | |
| 第174回利付国債（20年） | 4,670,000,000 | 4,039,690,100 | |
| 第175回利付国債（20年） | 2,920,000,000 | 2,557,511,200 | |
| 第176回利付国債（20年） | 2,930,000,000 | 2,553,172,700 | |
| 第177回利付国債（20年） | 3,140,000,000 | 2,674,683,400 | |
| 第178回利付国債（20年） | 3,420,000,000 | 2,953,204,200 | |
| 第179回利付国債（20年） | 3,240,000,000 | 2,784,942,000 | |
| 第180回利付国債（20年） | 3,780,000,000 | 3,414,889,800 | |
| 第181回利付国債（20年） | 2,850,000,000 | 2,612,937,000 | |
| 第182回利付国債（20年） | 2,680,000,000 | 2,534,904,800 | |
| 第183回利付国債（20年） | 2,870,000,000 | 2,848,704,600 | |

| | | | | |
|---------|----------------------|-----------------|-----------------|--|
| | 第184回利付国債（20年） | 2,740,000,000 | 2,577,024,800 | |
| | 第185回利付国債（20年） | 3,880,000,000 | 3,638,664,000 | |
| | 第186回利付国債（20年） | 2,760,000,000 | 2,766,292,800 | |
| | 第1回大韓民国 | 100,000,000 | 100,367,000 | |
| | 第2回大韓民国 | 100,000,000 | 100,807,000 | |
| 国債証券 合計 | | 663,789,000,000 | 648,869,193,030 | |
| 地方債証券 | 第5回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 102,328,000 | |
| | 第7回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 103,360,000 | |
| | 第7回東京都公募公債（30年） | 80,000,000 | 93,295,200 | |
| | 第10回東京都公募公債（30年） | 100,000,000 | 113,426,000 | |
| | 第12回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 107,431,000 | |
| | 第20回東京都公募公債（20年） | 80,000,000 | 87,392,000 | |
| | 第21回東京都公募公債（20年） | 80,000,000 | 88,164,800 | |
| | 第28回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 107,176,000 | |
| | 第33回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 89,923,000 | |
| | 第747回東京都公募公債 | 500,000,000 | 502,915,000 | |
| | 第750回東京都公募公債 | 200,000,000 | 201,148,000 | |
| | 第751回東京都公募公債 | 500,000,000 | 502,170,000 | |
| | 第757回東京都公募公債 | 150,000,000 | 149,569,500 | |
| | 第758回東京都公募公債 | 150,000,000 | 149,569,500 | |
| | 第782回東京都公募公債 | 100,000,000 | 99,502,000 | |
| | 第783回東京都公募公債 | 400,000,000 | 397,836,000 | |
| | 第807回東京都公募公債 | 200,000,000 | 195,280,000 | |
| | 第809回東京都公募公債 | 100,000,000 | 97,395,000 | |
| | 平成27年度第1回北海道公募公債 | 300,000,000 | 301,278,000 | |
| | 平成27年度第5回北海道公募公債 | 100,000,000 | 100,679,000 | |
| | 平成30年度第14回北海道公募公債 | 100,000,000 | 98,984,000 | |
| | 令和3年度第14回北海道公募公債（5年） | 400,000,000 | 397,764,000 | |
| | 第36回2号宮城県公募公債 | 342,000,000 | 333,453,420 | |
| | 第2回神奈川県公募公債（30年） | 180,000,000 | 217,837,800 | |
| | 第3回神奈川県公募公債（20年） | 500,000,000 | 514,090,000 | |
| | 第4回神奈川県公募公債（30年） | 100,000,000 | 118,163,000 | |
| | 第20回神奈川県公募公債（20年） | 500,000,000 | 540,880,000 | |
| | 第27回神奈川県公募公債（20年） | 100,000,000 | 104,948,000 | |
| | 第226回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 100,015,000 | |
| | 第234回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 99,606,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第243回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 97,956,000 | |
| 第256回神奈川県公募公債 | 350,000,000 | 339,041,500 | |
| 第7回大阪府公募公債（20年） | 220,000,000 | 239,701,000 | |
| 第11回大阪府公募公債（20年） | 100,000,000 | 108,052,000 | |
| 第179回大阪府公募公債（5年） | 100,000,000 | 99,696,000 | |
| 第184回大阪府公募公債（5年） | 120,000,000 | 119,539,200 | |
| 第186回大阪府公募公債（5年） | 300,000,000 | 298,770,000 | |
| 第191回大阪府公募公債（5年） | 160,000,000 | 159,105,600 | |
| 第393回大阪府公募公債 | 110,000,000 | 110,468,600 | |
| 第400回大阪府公募公債 | 136,000,000 | 136,909,840 | |
| 第407回大阪府公募公債 | 200,000,000 | 199,708,000 | |
| 第410回大阪府公募公債 | 200,000,000 | 199,206,000 | |
| 第415回大阪府公募公債 | 100,000,000 | 99,890,000 | |
| 第417回大阪府公募公債 | 300,000,000 | 300,522,000 | |
| 第420回大阪府公募公債 | 100,000,000 | 99,851,000 | |
| 第426回大阪府公募公債 | 100,000,000 | 99,604,000 | |
| 第435回大阪府公募公債 | 130,000,000 | 128,962,600 | |
| 第439回大阪府公募公債 | 100,000,000 | 98,975,000 | |
| 第455回大阪府公募公債 | 148,000,000 | 144,779,520 | |
| 第460回大阪府公募公債 | 194,000,000 | 188,878,400 | |
| 第464回大阪府公募公債 | 800,000,000 | 773,960,000 | |
| 第465回大阪府公募公債 | 500,000,000 | 484,855,000 | |
| 第467回大阪府公募公債 | 200,000,000 | 194,116,000 | |
| 第471回大阪府公募公債 | 97,000,000 | 93,159,770 | |
| 第483回大阪府公募公債 | 200,000,000 | 200,704,000 | |
| 平成26年度第2回京都府公募公債（15年） | 200,000,000 | 206,684,000 | |
| 平成26年度第5回京都府公募公債（20年） | 100,000,000 | 105,449,000 | |
| 第1回兵庫県公募公債（15年） | 400,000,000 | 414,908,000 | |
| 第2回兵庫県公募公債（20年） | 300,000,000 | 322,824,000 | |
| 第2回兵庫県公募公債（30年） | 90,000,000 | 102,318,300 | |
| 第4回兵庫県公募公債（12年） | 300,000,000 | 304,299,000 | |
| 第5回兵庫県公募公債（12年） | 400,000,000 | 406,244,000 | |
| 第5回兵庫県公募公債（15年） | 200,000,000 | 208,228,000 | |
| 第6回兵庫県公募公債（15年） | 100,000,000 | 104,329,000 | |
| 第9回兵庫県公募公債（15年） | 800,000,000 | 825,392,000 | |
| 第9回兵庫県公募公債（20年） | 200,000,000 | 220,666,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第27回兵庫県公募公債（20年） | 200,000,000 | 184,774,000 | |
| 平成28年度第29回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 100,141,000 | |
| 令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーン） | 100,000,000 | 98,829,000 | |
| 令和5年度第5回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 100,000,000 | |
| 第1回静岡県公募公債（15年） | 100,000,000 | 104,134,000 | |
| 第6回静岡県公募公債（15年） | 300,000,000 | 310,269,000 | |
| 第11回静岡県公募公債（20年） | 550,000,000 | 597,982,000 | |
| 第14回静岡県公募公債（20年） | 100,000,000 | 108,414,000 | |
| 平成27年度第10回静岡県公募公債 | 400,000,000 | 402,240,000 | |
| 令和2年度第15回静岡県公募公債（5年） | 120,000,000 | 119,653,200 | |
| 令和2年度第13回静岡県公募公債（5年） | 120,000,000 | 119,653,200 | |
| 平成20年度第8回愛知県公募公債（20年） | 200,000,000 | 215,844,000 | |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債（20年） | 700,000,000 | 769,286,000 | |
| 平成23年度第13回愛知県公募公債 | 500,000,000 | 518,985,000 | |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債（15年） | 300,000,000 | 311,955,000 | |
| 平成27年度第7回愛知県公募公債 | 100,000,000 | 100,668,000 | |
| 平成27年度第16回愛知県公募公債 | 100,000,000 | 100,599,000 | |
| 平成29年度第5回愛知県公募公債 | 600,000,000 | 599,694,000 | |
| 平成30年度第5回愛知県公募公債 | 100,000,000 | 99,349,000 | |
| 平成30年度第8回愛知県公募公債 | 200,000,000 | 198,990,000 | |
| 令和3年度第18回愛知県公募公債 | 100,000,000 | 96,859,000 | |
| 令和5年度第8回愛知県公募公債 | 100,000,000 | 99,660,000 | |
| 平成23年度第1回広島県公募公債（20年） | 100,000,000 | 108,989,000 | |
| 平成26年度第7回広島県公募公債 | 260,000,000 | 261,157,000 | |
| 平成28年度第1回広島県公募公債 | 100,000,000 | 99,849,000 | |
| 平成28年度第4回広島県公募公債 | 100,000,000 | 99,704,000 | |
| 平成28年度第1回広島県公募公債（20年） | 100,000,000 | 92,173,000 | |
| 平成30年度第4回広島県公募公債 | 200,000,000 | 198,800,000 | |
| 令和3年度第7回広島県公募公債 | 100,000,000 | 96,633,000 | |
| 第2回埼玉県公募公債（サステナビリティ） | 100,000,000 | 99,795,000 | |
| 第3回埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 201,170,000 | |
| 第9回埼玉県公募公債（20年） | 200,000,000 | 220,812,000 | |
| 第10回埼玉県公募公債（20年） | 100,000,000 | 109,434,000 | |
| 第14回埼玉県公募公債（20年） | 200,000,000 | 213,128,000 | |
| 第16回埼玉県公募公債（20年） | 100,000,000 | 102,454,000 | |
| 平成30年度第4回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 99,393,000 | |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 令和2年度第1回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 98,014,000 | |
| 令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年) | 110,000,000 | 109,671,100 | |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債(30年) | 70,000,000 | 82,676,300 | |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債(30年) | 80,000,000 | 90,833,600 | |
| 平成22年度第2回福岡県公募公債(20年) | 800,000,000 | 886,352,000 | |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債(15年) | 100,000,000 | 103,727,000 | |
| 平成27年度第7回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,618,000 | |
| 令和2年度第4回福岡県公募公債 | 200,000,000 | 195,240,000 | |
| 令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン) | 100,000,000 | 99,095,000 | |
| 令和5年度第3回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 98,831,000 | |
| 第9回千葉県公募公債(20年) | 80,000,000 | 86,952,800 | |
| 第13回千葉県公募公債(20年) | 300,000,000 | 324,639,000 | |
| 第14回千葉県公募公債(20年) | 100,000,000 | 103,154,000 | |
| 平成27年度第3回千葉県公募公債 | 200,000,000 | 201,208,000 | |
| 平成27年度第6回千葉県公募公債 | 500,000,000 | 503,135,000 | |
| 平成28年度第3回千葉県公募公債 | 400,000,000 | 399,004,000 | |
| 平成30年度第6回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 98,749,000 | |
| 令和元年度第6回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 98,218,000 | |
| 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 | 99,437,000 | |
| 令和5年度第8回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 100,541,000 | |
| 平成27年度第2回新潟県公募公債 | 100,000,000 | 100,132,000 | |
| 令和4年度第1回長野県公募公債 | 300,000,000 | 290,976,000 | |
| 令和5年度第2回長野県公募公債 | 100,000,000 | 99,615,000 | |
| 第2回群馬県公募公債(20年) | 100,000,000 | 110,294,000 | |
| 第7回群馬県公募公債(20年) | 100,000,000 | 91,530,000 | |
| 平成27年度第1回岐阜県公募公債 | 300,000,000 | 301,980,000 | |
| 令和2年度第2回岐阜県公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,790,000 | |
| 平成27年度第1回大分県公募公債 | 203,400,000 | 204,634,638 | |
| 第144回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 200,914,000 | |
| 第145回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,405,000 | |
| 第148回共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 503,360,000 | |
| 第150回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 201,294,000 | |
| 第151回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 201,184,000 | |
| 第152回共同発行市場公募地方債 | 700,000,000 | 704,613,000 | |
| 第153回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 201,254,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第158回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 199,698,000 | |
| 第172回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,000,000 | |
| 第173回共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 399,644,000 | |
| 第185回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 298,353,000 | |
| 第193回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 98,411,000 | |
| 第198回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 97,930,000 | |
| 第232回共同発行市場公募地方債 | 450,000,000 | 437,548,500 | |
| 令和元年度第3回堺市公募公債 | 100,000,000 | 98,101,000 | |
| 平成27年度第1回長崎県公募公債 | 300,000,000 | 301,980,000 | |
| 平成27年度第1回佐賀県公募公債 | 500,000,000 | 503,125,000 | |
| 平成29年度第1回佐賀県公募公債 | 100,000,000 | 99,710,000 | |
| 平成30年度第1回福島県公募公債 | 100,000,000 | 99,397,000 | |
| 第2回滋賀県公募公債（サステナビリティ） | 100,000,000 | 99,866,000 | |
| 令和元年度第2回栃木県公募公債 | 100,000,000 | 98,055,000 | |
| 令和2年度第2回栃木県公募公債 | 100,000,000 | 97,419,000 | |
| 令和3年度第1回熊本県公募公債（5年） | 200,000,000 | 199,274,000 | |
| 令和5年度第2回奈良県公募公債 | 200,000,000 | 199,422,000 | |
| 第5回大阪市公募公債（20年） | 100,000,000 | 109,569,000 | |
| 第15回大阪市公募公債（20年） | 100,000,000 | 110,708,000 | |
| 令和2年度第3回大阪市公募公債（5年） | 500,000,000 | 499,150,000 | |
| 第1回名古屋市公募公債（30年） | 100,000,000 | 116,616,000 | |
| 第9回名古屋市公募公債（20年） | 100,000,000 | 108,066,000 | |
| 第9回名古屋市公募公債（30年） | 90,000,000 | 97,857,900 | |
| 第28回名古屋市公募公債（5年） | 500,000,000 | 498,770,000 | |
| 第491回名古屋市公募公債 | 400,000,000 | 402,768,000 | |
| 第511回名古屋市公募公債 | 100,000,000 | 97,696,000 | |
| 第1回京都市公募公債（15年） | 100,000,000 | 101,598,000 | |
| 第3回京都市公募公債（20年） | 100,000,000 | 103,677,000 | |
| 第5回京都市公募公債（20年） | 50,000,000 | 53,136,500 | |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債（20年） | 110,000,000 | 116,271,100 | |
| 平成20年度第24回神戸市公募公債（20年） | 200,000,000 | 216,228,000 | |
| 平成22年度第4回神戸市公募公債 | 100,000,000 | 109,009,000 | |
| 平成23年度第4回神戸市公募公債（20年） | 150,000,000 | 164,344,500 | |
| 第5回横浜市公募公債（20年） | 100,000,000 | 102,902,000 | |
| 第7回横浜市公募公債（20年） | 450,000,000 | 466,335,000 | |
| 第19回横浜市公募公債（20年） | 200,000,000 | 219,568,000 | |

| | | | | |
|----------|-----------------------------|----------------|----------------|--|
| | 平成27年度第2回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 201,322,000 | |
| | 平成27年度第3回横浜市公募公債 | 400,000,000 | 402,588,000 | |
| | 平成27年度第4回横浜市公募公債 | 300,000,000 | 301,869,000 | |
| | 第27回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 107,287,000 | |
| | 第33回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 91,818,000 | |
| | 第35回横浜市公募公債(20年) | 500,000,000 | 461,985,000 | |
| | 第54回横浜市公募公債(5年) | 300,000,000 | 299,370,000 | |
| | 平成22年度第8回札幌市公募公債(30年) | 80,000,000 | 90,032,800 | |
| | 平成23年度第3回札幌市公募公債 | 100,000,000 | 109,755,000 | |
| | 平成23年度第9回札幌市公募公債 | 600,000,000 | 623,826,000 | |
| | 令和2年度第7回札幌市公募公債 | 200,000,000 | 194,478,000 | |
| | 令和3年度第2回札幌市公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,665,000 | |
| | 令和3年度第9回札幌市公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,643,000 | |
| | 第7回川崎市公募公債(20年) | 100,000,000 | 108,931,000 | |
| | 第12回川崎市公募公債(20年) | 100,000,000 | 110,389,000 | |
| | 第62回川崎市公募公債(5年) | 490,000,000 | 488,221,300 | |
| | 第3回北九州市公募公債(サステナビリティ) | 100,000,000 | 99,392,000 | |
| | 第17回北九州市公募公債(20年) | 100,000,000 | 106,237,000 | |
| | 令和3年度第4回千葉市公募公債 | 100,000,000 | 96,057,000 | |
| | 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 | 99,973,000 | |
| | 平成26年度第4回福井県公募公債 | 100,000,000 | 100,427,000 | |
| | 令和2年度第2回徳島県公募公債 | 100,000,000 | 97,419,000 | |
| | 平成28年度第1回山梨県公募公債 | 200,000,000 | 199,450,000 | |
| | 平成30年度第1回山梨県公募公債 | 100,000,000 | 99,571,000 | |
| | 令和2年度第1回山梨県公募公債 | 700,000,000 | 682,500,000 | |
| | 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 | 108,529,000 | |
| 地方債証券 合計 | | 40,880,400,000 | 41,609,810,988 | |
| 特殊債券 | 第4回政府保証新関西国際空港債券 | 904,000,000 | 909,396,880 | |
| | 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 | 599,532,000 | |
| | 第6回神奈川県住宅供給公社債券 | 100,000,000 | 98,073,000 | |
| | 第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債) | 30,000,000 | 31,942,500 | |
| | 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 | 121,237,000 | |
| | 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 | 146,764,800 | |

| | | | |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 300,000,000 | 316,917,000 | |
| 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 | 35,751,600 | |
| 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 | 233,934,000 | |
| 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 | 212,938,000 | |
| 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 | 127,000,500 | |
| 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 | 321,750,000 | |
| 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 | 214,906,000 | |
| 第28回道路債券（財投機関債） | 100,000,000 | 117,841,000 | |
| 第33回道路債券（財投機関債） | 300,000,000 | 356,778,000 | |
| 第42回道路債券（財投機関債） | 200,000,000 | 204,814,000 | |
| 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 | 163,470,000 | |
| 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 | 108,028,000 | |
| 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 | 113,456,000 | |
| 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 | 111,907,000 | |
| 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 | 105,855,000 | |
| 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 | 109,318,000 | |
| 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 | 96,824,000 | |
| 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 | 109,007,000 | |
| 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 | 303,144,000 | |
| 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 | 99,873,000 | |
| 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 | 107,831,000 | |
| 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 | 102,383,000 | |
| 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 | 108,634,000 | |
| 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 | 105,017,000 | |
| 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 | 105,203,000 | |
| 第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 200,974,000 | |

| | | | |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| 第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1,250,000,000 | 1,257,762,500 | |
| 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 101,000,000 | 101,615,090 | |
| 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 | 100,746,000 | |
| 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 | 100,520,000 | |
| 第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 201,066,000 | |
| 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 | 100,446,000 | |
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 200,182,000 | |
| 第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 299,424,000 | |
| 第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 299,403,000 | |
| 第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 99,357,000 | |
| 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 | 297,978,000 | |
| 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 | 54,757,500 | |
| 第4回公営企業債券（30年）（財投機関債） | 100,000,000 | 119,464,000 | |
| 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 | 108,333,000 | |
| 第12回公営企業債券（20年）（財投機関債） | 300,000,000 | 306,615,000 | |
| 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 | 110,359,000 | |
| 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 | 88,675,200 | |
| 第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 80,000,000 | 86,844,800 | |
| 第17回公営企業債券（20年）（財投機関債） | 150,000,000 | 157,068,000 | |
| 第22回公営企業債券（20年）（財投機関債） | 1,000,000,000 | 1,068,700,000 | |
| 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 | 107,422,000 | |
| 第24回公営企業債券（20年）（財投機関債） | 300,000,000 | 323,988,000 | |
| 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 | 215,218,000 | |
| 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 | 54,167,500 | |
| 第27回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債） | 100,000,000 | 99,860,000 | |
| 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 | 102,692,000 | |

| | | | |
|--------------------------|-------------|-------------|--|
| 第73回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 302,000,000 | 303,802,940 | |
| 第76回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 400,000,000 | 402,276,000 | |
| 第77回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,516,000 | |
| 第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債） | 300,000,000 | 301,734,000 | |
| 第78回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 150,000,000 | 150,789,000 | |
| 第81回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,088,000 | |
| 第82回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 674,000,000 | 672,847,460 | |
| 第83回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 102,000,000 | 101,807,220 | |
| F90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 105,033,000 | |
| 第91回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 299,655,000 | |
| 第94回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,999,000 | |
| 第100回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 325,000,000 | 323,648,000 | |
| 第101回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,839,000 | |
| 第102回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 131,000,000 | 130,693,460 | |
| F104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 101,345,000 | |
| 第108回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 223,000,000 | 221,624,090 | |
| 第115回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 198,168,000 | |
| F131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債） | 70,000,000 | 74,456,200 | |
| F151回地方公共団体金融機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 103,862,000 | |
| F203回地方公共団体金融機構債券（財投機関債） | 200,000,000 | 205,748,000 | |
| F234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 106,069,000 | |
| 第27回首都高速道路 | 100,000,000 | 99,697,000 | |
| 第24回阪神高速道路 | 200,000,000 | 199,782,000 | |
| 第10回日本政策金融公庫（財投機関債） | 80,000,000 | 87,889,600 | |
| 第15回日本政策金融公庫（財投機関債） | 80,000,000 | 86,896,800 | |
| 第48回福祉医療機構債券（財投機関債） | 400,000,000 | 399,480,000 | |
| 第54回福祉医療機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 99,223,000 | |
| 第4回中部国際空港（財投機関債） | 200,000,000 | 200,020,000 | |
| 第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 31,247,000 | 31,031,083 | |
| 第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 32,560,000 | 32,397,200 | |
| 第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 37,664,000 | 37,331,050 | |
| 第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券 | 53,950,000 | 53,346,839 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 10,078,000 | 10,114,986 | |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 18,448,000 | 19,325,940 | |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 18,522,000 | 19,357,342 | |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 18,736,000 | 19,539,024 | |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 18,095,000 | 18,890,999 | |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 34,738,000 | 36,149,404 | |
| 第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 36,074,000 | 37,496,037 | |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 19,594,000 | 20,324,464 | |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 38,000,000 | 39,064,760 | |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,535,000 | 23,402,822 | |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 85,728,000 | 89,455,453 | |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 53,277,000 | 55,334,557 | |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 15,495,000 | 16,069,399 | |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 33,022,000 | 34,311,839 | |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 33,676,000 | 34,918,307 | |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 34,834,000 | 36,055,976 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 36,714,000 | 38,006,699 | |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 39,424,000 | 40,702,914 | |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,400,000 | 42,736,806 | |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 23,335,000 | 24,073,786 | |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 23,497,000 | 24,259,007 | |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 49,844,000 | 51,486,858 | |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 50,630,000 | 52,100,801 | |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 51,146,000 | 52,470,169 | |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 28,773,000 | 29,439,670 | |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 28,441,000 | 28,976,544 | |
| 第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 197,424,000 | 201,285,613 | |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 94,557,000 | 96,303,467 | |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 29,585,000 | 30,329,654 | |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 33,273,000 | 34,191,667 | |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 28,102,000 | 28,766,050 | |
| 第77回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 30,000,000 | 31,104,900 | |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 29,317,000 | 29,834,151 | |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 33,077,000 | 33,593,331 | |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 35,831,000 | 36,286,412 | |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 139,996,000 | 141,632,553 | |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 73,010,000 | 73,845,234 | |
| 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 | 108,601,000 | |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 39,105,000 | 39,349,406 | |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 120,276,000 | 120,466,036 | |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 42,546,000 | 42,225,628 | |
| 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 | 207,716,000 | |
| 第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 53,567,000 | 53,220,421 | |
| 第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 51,168,000 | 50,579,568 | |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 52,446,000 | 52,246,705 | |
| 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 | 217,912,000 | |
| 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 | 103,744,000 | |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 55,636,000 | 55,148,628 | |
| 第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 116,682,000 | 113,173,372 | |
| 第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 120,300,000 | 116,046,192 | |
| 第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 255,772,000 | 245,362,079 | |
| 第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 324,355,000 | 308,889,753 | |
| 第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 526,648,000 | 499,994,344 | |
| 第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 136,376,000 | 131,117,341 | |
| 第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 473,879,000 | 456,274,395 | |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 130,000,000 | 143,015,600 | |
| 第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 211,116,000 | 202,255,461 | |
| 第123回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 108,255,000 | |
| 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 70,126,000 | 67,013,106 | |
| 第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,253,000 | 68,837,600 | |
| 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 70,825,000 | 67,628,667 | |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 144,994,000 | 138,637,463 | |
| 第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 145,020,000 | 138,320,076 | |
| 第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,412,000 | 68,886,259 | |
| 第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 71,801,000 | 68,334,447 | |
| 第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 219,015,000 | 208,627,118 | |
| 第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 73,567,000 | 69,848,923 | |
| 第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 74,625,000 | 71,076,581 | |
| 第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 150,166,000 | 143,289,898 | |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 148,558,000 | 142,110,582 | |
| 第143回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 103,479,000 | |
| 第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 157,710,000 | 146,933,675 | |
| 第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 239,442,000 | 221,859,773 | |
| 第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 244,128,000 | 227,063,452 | |
| 第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 165,062,000 | 153,969,833 | |
| 第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 82,134,000 | 77,077,009 | |
| 第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 164,820,000 | 154,620,938 | |
| 第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 85,320,000 | 80,099,269 | |
| 第161回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 101,488,000 | |
| 第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 172,712,000 | 161,829,416 | |
| 第164回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 100,570,000 | |
| 第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 86,948,000 | 81,462,450 | |
| 第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 261,657,000 | 245,709,005 | |
| 第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 177,266,000 | 166,202,828 | |
| 第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 177,230,000 | 165,958,172 | |
| 第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 179,958,000 | 167,681,265 | |
| 第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,362,000 | 83,237,128 | |
| 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 | 180,810,000 | |
| 第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 91,299,000 | 85,366,390 | |
| 第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 182,346,000 | 169,698,481 | |
| 第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 182,816,000 | 171,276,654 | |
| 第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 91,469,000 | 86,357,712 | |
| 第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 183,508,000 | 172,734,245 | |
| 第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 91,885,000 | 86,948,018 | |
| 第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 92,641,000 | 87,573,537 | |
| 第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 186,978,000 | 176,596,981 | |
| 第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 187,356,000 | 177,300,603 | |
| 第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 187,992,000 | 177,411,810 | |
| 第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 95,021,000 | 91,789,335 | |
| 第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 191,236,000 | 189,105,630 | |
| 第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 96,157,000 | 95,622,367 | |
| 第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 96,576,000 | 95,538,773 | |
| 第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 387,396,000 | 386,102,097 | |

| | | | |
|------------------------------|----------------|----------------|--|
| 第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 97,289,000 | 96,262,601 | |
| 第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 98,029,000 | 96,820,302 | |
| 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 | 99,646,000 | |
| 第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 196,982,000 | 194,287,286 | |
| 第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 296,349,000 | 294,778,350 | |
| 第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 197,828,000 | 197,717,216 | |
| 第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 198,926,000 | 200,543,268 | |
| 第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 399,576,000 | 400,443,079 | |
| 第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 300,000,000 | 299,484,000 | |
| 第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 300,000,000 | 298,071,000 | |
| 第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000 | 99,968,000 | |
| 第6回沖繩振興開発金融公庫債券（財投機関債） | 50,000,000 | 51,331,500 | |
| い第843号商工債券 | 200,000,000 | 199,640,000 | |
| い第848号商工債券 | 100,000,000 | 99,635,000 | |
| い第850号商工債券 | 300,000,000 | 298,740,000 | |
| い第852号商工債券 | 100,000,000 | 99,502,000 | |
| い第854号商工債券 | 500,000,000 | 497,145,000 | |
| い第857号商工債券 | 100,000,000 | 99,346,000 | |
| い第871号商工債券 | 200,000,000 | 199,116,000 | |
| い第872号商工債券 | 400,000,000 | 399,532,000 | |
| 第376回信金中金債 | 100,000,000 | 99,644,000 | |
| 第280号商工債券（3年） | 200,000,000 | 199,606,000 | |
| 第2回信金中金債（10年） | 100,000,000 | 100,547,000 | |
| 第7回国際協力機構債券（財投機関債） | 70,000,000 | 76,601,700 | |
| 第83回東日本高速道路 | 400,000,000 | 398,284,000 | |
| 第29回西日本高速道路 | 200,000,000 | 200,358,000 | |
| 第56回西日本高速道路 | 900,000,000 | 898,227,000 | |
| 第61回西日本高速道路 | 700,000,000 | 696,829,000 | |
| 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 | 102,285,000 | |
| 特殊債券 合計 | 35,542,287,000 | 35,817,564,204 | |
| 社債券 | | | |
| 第19回フランス相互信用連合銀行 | 100,000,000 | 100,523,000 | |
| 第29回フランス相互信用連合銀行 | 200,000,000 | 199,612,000 | |
| 第35回フランス相互信用連合銀行 | 500,000,000 | 492,185,000 | |
| 第38回フランス相互信用連合銀行 | 300,000,000 | 300,564,000 | |

| | | | |
|--------------------------|-------------|-------------|--|
| 第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | 100,000,000 | 98,228,000 | |
| 第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | 200,000,000 | 199,200,000 | |
| 第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | 200,000,000 | 197,756,000 | |
| 第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー | 400,000,000 | 399,980,000 | |
| 第1回サンタンデール銀行(2019) | 500,000,000 | 498,785,000 | |
| 第12回新関西国際空港 | 100,000,000 | 102,748,000 | |
| 第27回新関西国際空港 | 100,000,000 | 99,626,000 | |
| 第32回成田国際空港 | 100,000,000 | 98,367,000 | |
| 第1回国際石油開発帝石 | 100,000,000 | 99,439,000 | |
| 第48回鹿島建設(サステナビリティ) | 100,000,000 | 100,168,000 | |
| 第10回明治ホールディングス(サステナビリティ) | 200,000,000 | 198,892,000 | |
| 第16回アサヒグループホールディングス | 100,000,000 | 99,514,000 | |
| 第19回アサヒグループホールディングス | 400,000,000 | 399,872,000 | |
| 第21回麒麟ホールディングス(ソーシャル) | 300,000,000 | 298,668,000 | |
| 第22回麒麟ホールディングス(ソーシャル) | 100,000,000 | 100,334,000 | |
| 第9回サントリーホールディングス | 500,000,000 | 498,770,000 | |
| 第22回味の素 | 100,000,000 | 100,091,000 | |
| 第3回 キュービー | 100,000,000 | 99,887,000 | |
| 第13回日本たばこ産業 | 400,000,000 | 395,932,000 | |
| 第16回日本たばこ産業 | 300,000,000 | 296,976,000 | |
| 第6回ヒューリック | 400,000,000 | 395,040,000 | |
| 第24回森ヒルズリート投資法人(グリーン) | 300,000,000 | 300,792,000 | |
| 第27回東急不動産ホールディングス(グリーン) | 300,000,000 | 299,844,000 | |
| 第9回クラレ | 100,000,000 | 99,665,000 | |
| 第22回旭化成 | 100,000,000 | 100,155,000 | |
| 第42回王子ホールディングス | 300,000,000 | 298,332,000 | |
| 第4回野村総合研究所 | 100,000,000 | 98,917,000 | |
| 第12回野村総合研究所 | 200,000,000 | 199,894,000 | |
| 第6回花王 | 200,000,000 | 199,492,000 | |
| 第1回アステラス製薬 | 400,000,000 | 399,724,000 | |
| 第17回Zホールディングス | 100,000,000 | 99,725,000 | |
| 第22回Zホールディングス | 200,000,000 | 198,852,000 | |
| 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 | 99,159,000 | |
| 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 | 99,948,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第11回ブリヂストン | 500,000,000 | 497,940,000 | |
| 第12回日本電気硝子 | 100,000,000 | 98,754,000 | |
| 第4回新日本製鐵 | 200,000,000 | 199,450,000 | |
| 第36回ジェイ エフ イー ホールディングス | 400,000,000 | 398,092,000 | |
| 第1回住友生命2023基金 | 400,000,000 | 397,276,000 | |
| 第14回LIXIL | 200,000,000 | 199,238,000 | |
| 第1回日本郵政(グリーン) | 100,000,000 | 99,367,000 | |
| 第4回日本郵政 | 500,000,000 | 501,440,000 | |
| 第30回ダイキン工業 | 200,000,000 | 197,248,000 | |
| 第55回日本精工 | 100,000,000 | 99,906,000 | |
| 第19回日立製作所 | 100,000,000 | 99,243,000 | |
| 第17回パナソニック | 500,000,000 | 500,825,000 | |
| 第22回パナソニック | 100,000,000 | 98,749,000 | |
| 第24回パナソニックホールディングス | 300,000,000 | 299,436,000 | |
| 第25回パナソニックホールディングス | 400,000,000 | 400,212,000 | |
| 第18回デンソー | 300,000,000 | 297,873,000 | |
| 第40回三菱重工業 | 300,000,000 | 297,924,000 | |
| 第27回J A三井リース | 100,000,000 | 99,942,000 | |
| 第26回トヨタ自動車(サステナビリティ) | 800,000,000 | 796,000,000 | |
| 第27回トヨタ自動車(サステナビリティ) | 100,000,000 | 96,471,000 | |
| 第31回トヨタ自動車(サステナビリティ) | 200,000,000 | 195,896,000 | |
| 第4回ヤマハ発動機 | 100,000,000 | 99,902,000 | |
| 第1回明治安田生命2019基金 | 200,000,000 | 199,870,000 | |
| 第7回アシックス | 100,000,000 | 100,386,000 | |
| 第63回三井物産 | 400,000,000 | 425,116,000 | |
| 第51回住友商事 | 100,000,000 | 102,734,000 | |
| 第61回住友商事 | 100,000,000 | 100,306,000 | |
| 第43回丸井グループ | 100,000,000 | 99,912,000 | |
| 第44回丸井グループ | 100,000,000 | 99,610,000 | |
| 第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ | 300,000,000 | 299,940,000 | |
| 第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ | 500,000,000 | 489,075,000 | |
| 第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 200,000,000 | 219,726,000 | |
| 第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 200,000,000 | 204,086,000 | |
| 第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 200,000,000 | 205,296,000 | |
| 第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付) | 100,000,000 | 107,731,000 | |
| 第88回三菱東京UFJ銀行 | 100,000,000 | 106,134,000 | |

| | | | |
|---------------------------|---------------|---------------|--|
| 第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付 | 100,000,000 | 97,658,000 | |
| 第18回みずほ銀行(劣後特約付) | 100,000,000 | 103,161,000 | |
| 第38回芙蓉総合リース(サステナビリティ) | 400,000,000 | 401,604,000 | |
| 第7回みずほリース | 200,000,000 | 197,916,000 | |
| 第21回みずほリース | 300,000,000 | 298,635,000 | |
| 第22回みずほリース(サステナビリティ) | 300,000,000 | 299,646,000 | |
| 第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス | 1,200,000,000 | 1,196,568,000 | |
| 第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス | 300,000,000 | 297,669,000 | |
| 第25回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 300,000,000 | 298,170,000 | |
| 第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 200,000,000 | 196,108,000 | |
| 第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 300,000,000 | 300,447,000 | |
| 第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 300,000,000 | 301,656,000 | |
| 第30回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 200,000,000 | 202,296,000 | |
| 第53回日産フィナンシャルサービス | 300,000,000 | 297,471,000 | |
| 第56回日産フィナンシャルサービス | 500,000,000 | 497,375,000 | |
| 第57回日産フィナンシャルサービス | 400,000,000 | 394,936,000 | |
| 第30回東京センチュリー | 100,000,000 | 98,875,000 | |
| 第34回東京センチュリー | 300,000,000 | 294,432,000 | |
| 第96回トヨタファイナンス | 800,000,000 | 795,856,000 | |
| 第22回ポケットカード | 100,000,000 | 99,576,000 | |
| 第24回ポケットカード | 300,000,000 | 300,594,000 | |
| 第79回アコム | 300,000,000 | 299,862,000 | |
| 第189回オリックス | 200,000,000 | 200,094,000 | |
| 第220回オリックス | 400,000,000 | 400,892,000 | |
| 第34回三井住友ファイナンス&リース | 300,000,000 | 300,507,000 | |
| 第3回野村ホールディングス | 200,000,000 | 198,120,000 | |
| 第24回野村ホールディングス | 100,000,000 | 102,453,000 | |
| 第27回野村ホールディングス | 100,000,000 | 102,477,000 | |
| 第83回三井不動産(グリーン) | 200,000,000 | 194,822,000 | |
| 第137回三菱地所 | 300,000,000 | 299,496,000 | |
| 第142回三菱地所(サステナビリティ) | 200,000,000 | 199,316,000 | |
| 第143回三菱地所 | 100,000,000 | 98,438,000 | |
| 第111回住友不動産(グリーン) | 100,000,000 | 99,825,000 | |

| | | | |
|---------------------|-------------|-------------|--|
| 第13回森トラスト総合リート投資法人 | 200,000,000 | 199,994,000 | |
| 第20回森トラストリート投資法人 | 200,000,000 | 200,140,000 | |
| 第76回東京急行電鉄 | 200,000,000 | 207,926,000 | |
| 第36回京王電鉄 | 200,000,000 | 199,436,000 | |
| 第53回東日本旅客鉄道 | 300,000,000 | 323,466,000 | |
| 第71回東日本旅客鉄道 | 400,000,000 | 431,092,000 | |
| 第100回東日本旅客鉄道 | 200,000,000 | 205,770,000 | |
| 第163回東日本旅客鉄道 | 600,000,000 | 597,024,000 | |
| 第73回西日本旅客鉄道 | 400,000,000 | 398,000,000 | |
| 第42回東海旅客鉄道 | 100,000,000 | 108,833,000 | |
| 第53回東海旅客鉄道 | 100,000,000 | 107,104,000 | |
| 第28回東京地下鉄 | 300,000,000 | 296,766,000 | |
| 第50回阪急阪神ホールディングス | 200,000,000 | 198,052,000 | |
| 第58回阪急阪神ホールディングス | 200,000,000 | 199,232,000 | |
| 第68回名古屋鉄道（サステナビリティ） | 200,000,000 | 198,206,000 | |
| 第1回横浜高速鉄道 | 300,000,000 | 301,080,000 | |
| 第31回KDDI（サステナビリティ） | 200,000,000 | 199,388,000 | |
| 第9回ソフトバンク | 600,000,000 | 590,556,000 | |
| 第13回ソフトバンク | 500,000,000 | 468,810,000 | |
| 第16回ソフトバンク | 500,000,000 | 465,885,000 | |
| 第21回ソフトバンク | 700,000,000 | 694,295,000 | |
| 第22回ソフトバンク | 300,000,000 | 295,389,000 | |
| 第548回東京電力 | 100,000,000 | 103,045,000 | |
| 第567回東京電力 | 100,000,000 | 100,630,000 | |
| 第508回関西電力 | 200,000,000 | 200,064,000 | |
| 第510回関西電力 | 500,000,000 | 499,915,000 | |
| 第511回関西電力 | 100,000,000 | 99,607,000 | |
| 第518回関西電力 | 200,000,000 | 198,418,000 | |
| 第524回関西電力 | 200,000,000 | 198,422,000 | |
| 第393回中国電力 | 100,000,000 | 99,706,000 | |
| 第400回中国電力 | 200,000,000 | 198,924,000 | |
| 第409回中国電力 | 200,000,000 | 197,776,000 | |
| 第433回中国電力 | 700,000,000 | 696,990,000 | |
| 第448回中国電力 | 200,000,000 | 196,548,000 | |
| 第322回北陸電力 | 100,000,000 | 99,748,000 | |
| 第485回東北電力 | 100,000,000 | 99,728,000 | |

| | | | |
|-------------------------|----------------|----------------|--|
| 第492回東北電力 | 300,000,000 | 299,904,000 | |
| 第494回東北電力 | 200,000,000 | 199,798,000 | |
| 第529回東北電力 | 500,000,000 | 496,940,000 | |
| 第552回東北電力 | 400,000,000 | 403,676,000 | |
| 第449回九州電力 | 300,000,000 | 300,048,000 | |
| 第468回九州電力 | 100,000,000 | 99,058,000 | |
| 第471回九州電力 | 300,000,000 | 296,838,000 | |
| 第484回九州電力 | 400,000,000 | 391,168,000 | |
| 第503回九州電力 | 600,000,000 | 598,656,000 | |
| 第511回九州電力 | 600,000,000 | 601,800,000 | |
| 第49回電源開発 | 500,000,000 | 499,525,000 | |
| 第50回電源開発 | 200,000,000 | 199,632,000 | |
| 第57回電源開発 | 100,000,000 | 98,818,000 | |
| 第59回電源開発 | 300,000,000 | 296,727,000 | |
| 第64回電源開発 | 600,000,000 | 591,234,000 | |
| 第67回電源開発 | 200,000,000 | 194,802,000 | |
| 第86回電源開発 | 100,000,000 | 98,310,000 | |
| 第6回東京電力パワーグリッド | 100,000,000 | 100,513,000 | |
| 第13回東京電力パワーグリッド | 300,000,000 | 299,547,000 | |
| 第15回東京電力パワーグリッド | 100,000,000 | 98,863,000 | |
| 第25回東京電力パワーグリッド | 100,000,000 | 100,477,000 | |
| 第28回東京電力パワーグリッド | 400,000,000 | 401,364,000 | |
| 第31回東京電力パワーグリッド | 300,000,000 | 300,099,000 | |
| 第33回東京電力パワーグリッド | 200,000,000 | 200,414,000 | |
| 第35回東京電力パワーグリッド | 100,000,000 | 100,918,000 | |
| 第39回東京電力パワーグリッド | 400,000,000 | 400,176,000 | |
| 第47回東京電力パワーグリッド | 200,000,000 | 192,436,000 | |
| 第49回東京電力パワーグリッド | 400,000,000 | 399,436,000 | |
| 第16回JERA | 200,000,000 | 200,106,000 | |
| 第17回JERA | 200,000,000 | 200,614,000 | |
| 第21回JERA | 200,000,000 | 199,940,000 | |
| 第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン） | 400,000,000 | 402,004,000 | |
| 第51回大阪ガス | 100,000,000 | 98,208,000 | |
| 第13回広島ガス | 200,000,000 | 197,392,000 | |
| 第7回ファーストリテイリング | 100,000,000 | 99,312,000 | |
| 社債券 合計 | 46,200,000,000 | 46,098,431,000 | |

| | | |
|----|-----------------|-----------------|
| 合計 | 786,411,687,000 | 772,394,999,222 |
|----|-----------------|-----------------|

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1月26日現在]

| 資産の部 | |
|-------------|-----------------|
| 流動資産 | |
| 預金 | 2,858,217,017 |
| コール・ローン | 3,450,411,892 |
| 国債証券 | 521,627,234,978 |
| 派生商品評価勘定 | 94,230,568 |
| 未収入金 | 12,699,921 |
| 未収利息 | 4,144,832,233 |
| 前払費用 | 446,630,212 |
| 流動資産合計 | 532,634,256,821 |
| 資産合計 | 532,634,256,821 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 983,679 |
| 未払金 | 440,641,510 |
| 未払解約金 | 271,792,170 |
| 未払利息 | 881 |
| 流動負債合計 | 713,418,240 |
| 負債合計 | 713,418,240 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 206,647,867,531 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 325,272,971,050 |
| 元本等合計 | 531,920,838,581 |
| 純資産合計 | 531,920,838,581 |
| 負債純資産合計 | 532,634,256,821 |

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1月26日現在] |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2023年1月27日 |
| 期首元本額 | 174,401,387,040円 |
| 期中追加設定元本額 | 57,561,997,583円 |
| 期中一部解約元本額 | 25,315,517,092円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 280,077,392円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 645,435,989円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 407,521,244円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン | 830,884,536円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 2,117,442,844円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 6,101,280,863円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 4,784,401,977円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 536,468,781円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 96,241,967円 |
| ファンド・マネジャー(海外債券) | 895,726,448円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス | 6,083,670,061円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 2,354,786,717円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 210,492,811円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 1,014,612,091円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 419,661,400円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 237,925,486円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 159,847,454円 |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス | 39,001,288,318円 |
| 海外債券セレクション(ラップ向け) | 5,794,847,787円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 11,699,465,823円 |
| つみたて8資産均等バランス | 5,765,865,057円 |
| つみたて4資産均等バランス | 2,071,842,710円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 4,447,147円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 2,310,805円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 556,353円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 232,162,396円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金) | 155,699,614円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金) | 89,525,587円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式15) | 791,825,592円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式40) | 1,204,460,672円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式65) | 1,800,742,790円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券) | 2,042,403,938円 |

| | |
|--|-----------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 75,858,016円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 173,890,473円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 34,612,561円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国債券 | 2,756,084,087円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 31,128,167円 |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け) | 3,851,044,159円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド | 76,839,332円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 42,238,720円 |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け) | 54,433,336円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金) | 205,592円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン (確定拠出年金) | 3,101,269,888円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型) | 16,771,403,427円 |
| ワールド・インカムオープン | 993,048,159円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド | 15,553,369,468円 |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型) | 407,136,940円 |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型) | 2,141,369,369円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 825,801,219円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 512,433,579円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 281,332,315円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 324,789,919円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 177,493,481円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 70,611,898円 |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定) | 1,006,608,711円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定) | 103円 |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定) | 10,383,745円 |
| MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定) | 1,028,461,738円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 11,170,719円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 1,522,880,546円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 1,137,750,689円 |
| MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定) | 41,720,753,305円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定) | 465,972,697円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 383,138円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 102,202円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 1,258,247,368円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 60,903,911円 |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 108,652,517円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付) | 1,031,658,432円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 31,096,604円 |
| MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定) | 2,482,508,842円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定) | 655,362,166円 |
| 外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定) | 772,204,051円 |
| 海外債券インデックスファンドS | 4,074,292,643円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 1,615,459円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 2,714,089円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 503,871円 |

| | |
|---------------------------------------|------------------|
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA | 890,268円 |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA | 4,440,348円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定） | 3,564,102円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定） | 7,461,109円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定） | 3,386,271円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定） | 8,627,509円 |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド | 1,751,838,476円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型） | 193,917,904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） | 554,205,925円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型） | 457,256,361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） | 187,734,957円 |
| 合計 | 206,647,867,531円 |
| 2. 受益権の総数 | 206,647,867,531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1月27日 至 2024年1月26日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 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1月26日現在] |
|----------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | （1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額 |

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年 1月26日現在] | |
|------|---------------------|----------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額 (円) | |
| 国債証券 | | △4,711,470,935 |
| 合計 | | △4,711,470,935 |

(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 1月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | 時価 (円) | | 評価損益 (円) |
|-----------|-------------|---------------|-------------|---------------|------------|
| | | | | うち1年超 | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカドル | 3,230,653,700 | — | 3,324,504,145 | 93,850,445 |
| | カナダドル | 17,508,560 | — | 17,526,836 | 18,276 |
| | オーストラリアドル | 15,543,880 | — | 15,549,168 | 5,288 |
| | イギリスポンド | 43,152,426 | — | 43,129,019 | △23,407 |
| | シンガポールドル | 4,405,080 | — | 4,404,788 | △292 |
| | マレーシアリング | 5,299,240 | — | 5,295,806 | △3,434 |
| | スウェーデンクローネ | 4,943,470 | — | 4,943,225 | △245 |
| | デンマーククローネ | 5,368,200 | — | 5,367,750 | △450 |
| | メキシコペソ | 9,772,470 | — | 9,777,522 | 5,052 |
| | オフショア元 | 89,998,838 | — | 89,765,044 | △233,794 |
| ユーロ | 272,541,200 | — | 272,170,650 | △370,550 | |
| 合計 | | 3,699,187,064 | — | 3,792,433,953 | 93,246,889 |

(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1月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 2,5740円 |
| (1万口当たり純資産額) | (25,740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 250531 | 5,000,000.00 | 4,721,093.75 | |
| | | 0.25 T-NOTE 250630 | 6,650,000.00 | 6,263,079.12 | |
| | | 0.25 T-NOTE 250731 | 5,800,000.00 | 5,444,183.57 | |
| | | 0.25 T-NOTE 250831 | 6,700,000.00 | 6,269,603.52 | |
| | | 0.25 T-NOTE 250930 | 7,600,000.00 | 7,092,046.85 | |
| | | 0.25 T-NOTE 251031 | 10,300,000.00 | 9,584,431.60 | |
| | | 0.375 T-NOTE 250430 | 4,670,000.00 | 4,429,750.40 | |
| | | 0.375 T-NOTE 251130 | 10,150,000.00 | 9,439,698.22 | |
| | | 0.375 T-NOTE 251231 | 8,500,000.00 | 7,885,742.23 | |
| | | 0.375 T-NOTE 260131 | 9,200,000.00 | 8,508,921.84 | |
| | | 0.375 T-NOTE 270731 | 7,150,000.00 | 6,292,418.91 | |
| | | 0.375 T-NOTE 270930 | 7,300,000.00 | 6,389,210.97 | |
| | | 0.5 T-NOTE 250331 | 6,500,000.00 | 6,195,058.61 | |
| | | 0.5 T-NOTE 260228 | 9,900,000.00 | 9,156,339.81 | |
| | | 0.5 T-NOTE 270430 | 5,280,000.00 | 4,706,831.23 | |
| | | 0.5 T-NOTE 270531 | 4,280,000.00 | 3,804,351.57 | |
| | | 0.5 T-NOTE 270630 | 5,900,000.00 | 5,230,718.75 | |
| | | 0.5 T-NOTE 270831 | 4,950,000.00 | 4,364,701.15 | |
| | | 0.5 T-NOTE 271031 | 7,900,000.00 | 6,927,929.64 | |

| | | | |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 0.625 T-NOTE 260731 | 7,930,000.00 | 7,264,158.81 | |
| 0.625 T-NOTE 270331 | 3,800,000.00 | 3,411,167.96 | |
| 0.625 T-NOTE 271130 | 7,550,000.00 | 6,635,594.73 | |
| 0.625 T-NOTE 271231 | 8,630,000.00 | 7,564,397.28 | |
| 0.625 T-NOTE 300515 | 12,090,000.00 | 9,791,247.05 | |
| 0.625 T-NOTE 300815 | 16,160,000.00 | 12,974,712.41 | |
| 0.75 T-NOTE 260331 | 8,100,000.00 | 7,519,552.70 | |
| 0.75 T-NOTE 260430 | 9,200,000.00 | 8,515,750.00 | |
| 0.75 T-NOTE 260531 | 8,200,000.00 | 7,572,347.64 | |
| 0.75 T-NOTE 260831 | 10,100,000.00 | 9,259,253.87 | |
| 0.75 T-NOTE 280131 | 8,850,000.00 | 7,777,801.79 | |
| 0.875 T-NOTE 260630 | 8,300,000.00 | 7,675,716.82 | |
| 0.875 T-NOTE 260930 | 10,000,000.00 | 9,183,007.80 | |
| 0.875 T-NOTE 301115 | 17,430,000.00 | 14,169,364.49 | |
| 1 T-NOTE 280731 | 9,150,000.00 | 8,011,968.75 | |
| 1.125 T-BOND 400515 | 6,020,000.00 | 3,728,637.50 | |
| 1.125 T-BOND 400815 | 8,350,000.00 | 5,113,722.69 | |
| 1.125 T-NOTE 250228 | 4,150,000.00 | 3,993,564.46 | |
| 1.125 T-NOTE 261031 | 10,450,000.00 | 9,635,022.47 | |
| 1.125 T-NOTE 270228 | 2,950,000.00 | 2,697,809.57 | |
| 1.125 T-NOTE 280229 | 9,760,000.00 | 8,693,071.82 | |
| 1.125 T-NOTE 280831 | 9,970,000.00 | 8,760,748.07 | |
| 1.125 T-NOTE 310215 | 16,920,000.00 | 13,954,042.92 | |
| 1.25 T-BOND 500515 | 9,420,000.00 | 4,748,820.66 | |
| 1.25 T-NOTE 261130 | 11,360,000.00 | 10,488,475.00 | |
| 1.25 T-NOTE 261231 | 8,200,000.00 | 7,561,457.06 | |
| 1.25 T-NOTE 280331 | 9,950,000.00 | 8,890,286.09 | |
| 1.25 T-NOTE 280430 | 9,740,000.00 | 8,683,057.85 | |
| 1.25 T-NOTE 280531 | 9,750,000.00 | 8,673,500.94 | |
| 1.25 T-NOTE 280630 | 9,680,000.00 | 8,593,457.84 | |
| 1.25 T-NOTE 280930 | 10,700,000.00 | 9,438,779.33 | |
| 1.25 T-NOTE 310815 | 17,720,000.00 | 14,477,793.75 | |
| 1.375 T-BOND 401115 | 8,400,000.00 | 5,351,226.55 | |
| 1.375 T-BOND 500815 | 10,430,000.00 | 5,437,859.78 | |
| 1.375 T-NOTE 260831 | 3,800,000.00 | 3,541,570.32 | |
| 1.375 T-NOTE 281031 | 8,250,000.00 | 7,306,406.25 | |

| | | | |
|----------------------|---------------|---------------|--|
| 1. 375 T-NOTE 281231 | 8,700,000.00 | 7,674,691.42 | |
| 1. 375 T-NOTE 311115 | 18,100,000.00 | 14,832,101.46 | |
| 1. 5 T-NOTE 250215 | 6,300,000.00 | 6,089,902.11 | |
| 1. 5 T-NOTE 260815 | 9,740,000.00 | 9,114,128.93 | |
| 1. 5 T-NOTE 270131 | 11,540,000.00 | 10,693,207.37 | |
| 1. 5 T-NOTE 281130 | 9,700,000.00 | 8,627,126.93 | |
| 1. 5 T-NOTE 300215 | 8,740,000.00 | 7,544,736.74 | |
| 1. 625 T-BOND 501115 | 10,710,000.00 | 5,980,238.11 | |
| 1. 625 T-NOTE 260215 | 9,760,000.00 | 9,251,412.45 | |
| 1. 625 T-NOTE 260515 | 7,670,000.00 | 7,237,064.47 | |
| 1. 625 T-NOTE 260930 | 2,100,000.00 | 1,967,519.52 | |
| 1. 625 T-NOTE 261031 | 3,350,000.00 | 3,131,988.29 | |
| 1. 625 T-NOTE 261130 | 3,400,000.00 | 3,174,351.55 | |
| 1. 625 T-NOTE 290815 | 7,050,000.00 | 6,225,480.50 | |
| 1. 625 T-NOTE 310515 | 16,640,000.00 | 14,090,049.95 | |
| 1. 75 T-BOND 410815 | 11,370,000.00 | 7,605,908.17 | |
| 1. 75 T-NOTE 250315 | 9,030,000.00 | 8,740,052.29 | |
| 1. 75 T-NOTE 261231 | 4,700,000.00 | 4,397,437.50 | |
| 1. 75 T-NOTE 290131 | 8,600,000.00 | 7,716,316.37 | |
| 1. 75 T-NOTE 291115 | 5,150,000.00 | 4,558,755.84 | |
| 1. 875 T-BOND 410215 | 10,700,000.00 | 7,396,792.93 | |
| 1. 875 T-BOND 510215 | 11,810,000.00 | 7,034,331.25 | |
| 1. 875 T-BOND 511115 | 10,450,000.00 | 6,195,911.17 | |
| 1. 875 T-NOTE 260630 | 3,500,000.00 | 3,317,001.94 | |
| 1. 875 T-NOTE 260731 | 5,500,000.00 | 5,201,582.04 | |
| 1. 875 T-NOTE 270228 | 9,120,000.00 | 8,533,434.33 | |
| 1. 875 T-NOTE 290228 | 7,800,000.00 | 7,030,968.75 | |
| 1. 875 T-NOTE 320215 | 16,860,000.00 | 14,298,399.66 | |
| 2 T-BOND 411115 | 10,220,000.00 | 7,118,269.94 | |
| 2 T-BOND 500215 | 7,790,000.00 | 4,828,582.81 | |
| 2 T-BOND 510815 | 11,990,000.00 | 7,352,773.85 | |
| 2 T-NOTE 250215 | 8,110,000.00 | 7,881,042.69 | |
| 2 T-NOTE 250815 | 11,490,000.00 | 11,070,121.27 | |
| 2 T-NOTE 261115 | 8,680,000.00 | 8,192,767.20 | |
| 2. 125 T-NOTE 250515 | 6,970,000.00 | 6,755,182.43 | |
| 2. 125 T-NOTE 260531 | 5,000,000.00 | 4,770,507.80 | |

| | | | |
|----------------------|---------------|--------------|--|
| 2. 25 T-BOND 410515 | 9,190,000.00 | 6,741,367.59 | |
| 2. 25 T-BOND 460815 | 5,040,000.00 | 3,425,526.56 | |
| 2. 25 T-BOND 490815 | 6,580,000.00 | 4,344,984.75 | |
| 2. 25 T-BOND 520215 | 9,890,000.00 | 6,441,635.09 | |
| 2. 25 T-NOTE 251115 | 10,290,000.00 | 9,912,565.98 | |
| 2. 25 T-NOTE 260331 | 4,500,000.00 | 4,314,638.65 | |
| 2. 25 T-NOTE 270215 | 6,810,000.00 | 6,450,346.87 | |
| 2. 25 T-NOTE 270815 | 6,190,000.00 | 5,818,358.21 | |
| 2. 25 T-NOTE 271115 | 7,500,000.00 | 7,024,218.74 | |
| 2. 375 T-BOND 420215 | 7,850,000.00 | 5,801,027.38 | |
| 2. 375 T-BOND 491115 | 6,910,000.00 | 4,686,788.48 | |
| 2. 375 T-BOND 510515 | 11,570,000.00 | 7,779,921.15 | |
| 2. 375 T-NOTE 260430 | 2,000,000.00 | 1,920,781.24 | |
| 2. 375 T-NOTE 270515 | 9,070,000.00 | 8,590,459.21 | |
| 2. 375 T-NOTE 290331 | 7,500,000.00 | 6,920,361.30 | |
| 2. 375 T-NOTE 290515 | 7,480,000.00 | 6,890,950.00 | |
| 2. 5 T-BOND 450215 | 5,050,000.00 | 3,673,184.56 | |
| 2. 5 T-BOND 460215 | 4,030,000.00 | 2,896,011.51 | |
| 2. 5 T-BOND 460515 | 4,210,000.00 | 3,016,974.78 | |
| 2. 5 T-NOTE 250131 | 3,350,000.00 | 3,275,702.12 | |
| 2. 5 T-NOTE 260228 | 3,450,000.00 | 3,327,767.56 | |
| 2. 5 T-NOTE 270331 | 7,700,000.00 | 7,338,460.97 | |
| 2. 625 T-NOTE 250331 | 1,960,000.00 | 1,915,287.50 | |
| 2. 625 T-NOTE 250415 | 9,000,000.00 | 8,787,128.94 | |
| 2. 625 T-NOTE 251231 | 3,200,000.00 | 3,100,750.01 | |
| 2. 625 T-NOTE 260131 | 3,900,000.00 | 3,775,839.83 | |
| 2. 625 T-NOTE 270531 | 7,900,000.00 | 7,539,716.78 | |
| 2. 625 T-NOTE 290215 | 9,640,000.00 | 9,022,437.50 | |
| 2. 625 T-NOTE 290731 | 5,600,000.00 | 5,208,109.36 | |
| 2. 75 T-BOND 420815 | 2,520,000.00 | 1,969,685.14 | |
| 2. 75 T-BOND 421115 | 3,700,000.00 | 2,883,687.50 | |
| 2. 75 T-BOND 470815 | 4,860,000.00 | 3,612,821.50 | |
| 2. 75 T-BOND 471115 | 5,110,000.00 | 3,791,679.88 | |
| 2. 75 T-NOTE 250228 | 3,440,000.00 | 3,369,184.36 | |
| 2. 75 T-NOTE 250515 | 6,400,000.00 | 6,253,500.03 | |
| 2. 75 T-NOTE 250630 | 2,370,000.00 | 2,313,434.75 | |

| | | | |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 2.75 T-NOTE 250831 | 4,050,000.00 | 3,944,478.50 | |
| 2.75 T-NOTE 270430 | 6,400,000.00 | 6,139,249.98 | |
| 2.75 T-NOTE 270731 | 7,650,000.00 | 7,319,944.34 | |
| 2.75 T-NOTE 280215 | 9,990,000.00 | 9,504,938.64 | |
| 2.75 T-NOTE 290531 | 7,160,000.00 | 6,716,695.32 | |
| 2.75 T-NOTE 320815 | 15,460,000.00 | 13,940,571.87 | |
| 2.875 T-BOND 430515 | 4,680,000.00 | 3,701,861.70 | |
| 2.875 T-BOND 450815 | 3,500,000.00 | 2,711,816.41 | |
| 2.875 T-BOND 461115 | 2,340,000.00 | 1,792,339.45 | |
| 2.875 T-BOND 490515 | 7,170,000.00 | 5,409,428.87 | |
| 2.875 T-BOND 520515 | 9,820,000.00 | 7,373,630.88 | |
| 2.875 T-NOTE 250430 | 6,000,000.00 | 5,872,851.54 | |
| 2.875 T-NOTE 250531 | 4,230,000.00 | 4,137,633.97 | |
| 2.875 T-NOTE 250615 | 7,800,000.00 | 7,628,460.91 | |
| 2.875 T-NOTE 250731 | 6,100,000.00 | 5,958,341.77 | |
| 2.875 T-NOTE 251130 | 3,800,000.00 | 3,700,027.35 | |
| 2.875 T-NOTE 280515 | 10,090,000.00 | 9,626,490.62 | |
| 2.875 T-NOTE 280815 | 10,310,000.00 | 9,814,233.95 | |
| 2.875 T-NOTE 290430 | 7,000,000.00 | 6,615,000.00 | |
| 2.875 T-NOTE 320515 | 15,480,000.00 | 14,136,686.77 | |
| 3 T-BOND 420515 | 1,920,000.00 | 1,566,000.00 | |
| 3 T-BOND 441115 | 3,900,000.00 | 3,107,507.82 | |
| 3 T-BOND 450515 | 2,790,000.00 | 2,213,854.08 | |
| 3 T-BOND 451115 | 2,000,000.00 | 1,580,937.50 | |
| 3 T-BOND 470215 | 5,030,000.00 | 3,933,224.18 | |
| 3 T-BOND 470515 | 3,390,000.00 | 2,646,318.75 | |
| 3 T-BOND 480215 | 5,970,000.00 | 4,638,643.36 | |
| 3 T-BOND 480815 | 7,070,000.00 | 5,479,250.00 | |
| 3 T-BOND 490215 | 7,800,000.00 | 6,033,878.90 | |
| 3 T-BOND 520815 | 8,670,000.00 | 6,682,673.43 | |
| 3 T-NOTE 250715 | 6,700,000.00 | 6,558,802.72 | |
| 3 T-NOTE 250930 | 5,400,000.00 | 5,276,390.65 | |
| 3 T-NOTE 251031 | 3,300,000.00 | 3,222,720.69 | |
| 3.125 T-BOND 411115 | 1,990,000.00 | 1,664,409.57 | |
| 3.125 T-BOND 420215 | 2,200,000.00 | 1,836,011.71 | |
| 3.125 T-BOND 430215 | 3,160,000.00 | 2,606,382.81 | |

| | | | |
|----------------------|------------------|------------------|--|
| 3. 125 T-BOND 440815 | 4, 130, 000. 00 | 3, 369, 257. 22 | |
| 3. 125 T-BOND 480515 | 6, 010, 000. 00 | 4, 773, 606. 81 | |
| 3. 125 T-NOTE 250815 | 5, 000, 000. 00 | 4, 900, 195. 30 | |
| 3. 125 T-NOTE 270831 | 7, 300, 000. 00 | 7, 069, 451. 18 | |
| 3. 125 T-NOTE 281115 | 8, 280, 000. 00 | 7, 952, 034. 33 | |
| 3. 125 T-NOTE 290831 | 5, 900, 000. 00 | 5, 625, 742. 15 | |
| 3. 25 T-BOND 420515 | 6, 950, 000. 00 | 5, 881, 844. 69 | |
| 3. 25 T-NOTE 270630 | 6, 300, 000. 00 | 6, 135, 978. 49 | |
| 3. 25 T-NOTE 290630 | 6, 170, 000. 00 | 5, 931, 033. 00 | |
| 3. 375 T-BOND 420815 | 6, 300, 000. 00 | 5, 421, 691. 41 | |
| 3. 375 T-BOND 440515 | 3, 380, 000. 00 | 2, 874, 914. 46 | |
| 3. 375 T-BOND 481115 | 6, 920, 000. 00 | 5, 743, 194. 55 | |
| 3. 375 T-NOTE 330515 | 16, 100, 000. 00 | 15, 176, 765. 62 | |
| 3. 5 T-BOND 390215 | 1, 360, 000. 00 | 1, 242, 885. 93 | |
| 3. 5 T-NOTE 250915 | 5, 100, 000. 00 | 5, 024, 595. 68 | |
| 3. 5 T-NOTE 280131 | 6, 100, 000. 00 | 5, 975, 974. 61 | |
| 3. 5 T-NOTE 280430 | 6, 900, 000. 00 | 6, 753, 375. 00 | |
| 3. 5 T-NOTE 300131 | 5, 100, 000. 00 | 4, 944, 708. 97 | |
| 3. 5 T-NOTE 300430 | 5, 600, 000. 00 | 5, 421, 718. 73 | |
| 3. 5 T-NOTE 330215 | 15, 100, 000. 00 | 14, 395, 136. 68 | |
| 3. 625 T-BOND 430815 | 3, 400, 000. 00 | 3, 015, 242. 19 | |
| 3. 625 T-BOND 440215 | 3, 870, 000. 00 | 3, 425, 403. 52 | |
| 3. 625 T-BOND 530215 | 8, 690, 000. 00 | 7, 587, 965. 39 | |
| 3. 625 T-BOND 530515 | 9, 060, 000. 00 | 7, 917, 590. 62 | |
| 3. 625 T-NOTE 260515 | 7, 000, 000. 00 | 6, 908, 398. 42 | |
| 3. 625 T-NOTE 280331 | 6, 000, 000. 00 | 5, 903, 554. 68 | |
| 3. 625 T-NOTE 280531 | 6, 600, 000. 00 | 6, 492, 105. 44 | |
| 3. 625 T-NOTE 300331 | 5, 500, 000. 00 | 5, 364, 003. 92 | |
| 3. 75 T-BOND 410815 | 2, 060, 000. 00 | 1, 887, 957. 82 | |
| 3. 75 T-BOND 431115 | 3, 360, 000. 00 | 3, 031, 415. 61 | |
| 3. 75 T-NOTE 260415 | 7, 000, 000. 00 | 6, 925, 078. 16 | |
| 3. 75 T-NOTE 300531 | 5, 600, 000. 00 | 5, 495, 875. 00 | |
| 3. 75 T-NOTE 300630 | 5, 400, 000. 00 | 5, 298, 433. 61 | |
| 3. 875 T-BOND 400815 | 1, 870, 000. 00 | 1, 756, 886. 91 | |
| 3. 875 T-BOND 430215 | 6, 040, 000. 00 | 5, 562, 580. 45 | |
| 3. 875 T-BOND 430515 | 6, 200, 000. 00 | 5, 704, 484. 34 | |

| | | | |
|----------------------|---------------|---------------|--|
| 3. 875 T-NOTE 250331 | 5,000,000.00 | 4,955,761.70 | |
| 3. 875 T-NOTE 250430 | 4,000,000.00 | 3,963,828.12 | |
| 3. 875 T-NOTE 260115 | 6,700,000.00 | 6,644,515.62 | |
| 3. 875 T-NOTE 271130 | 6,900,000.00 | 6,853,101.52 | |
| 3. 875 T-NOTE 271231 | 7,000,000.00 | 6,954,335.92 | |
| 3. 875 T-NOTE 290930 | 6,030,000.00 | 5,971,819.90 | |
| 3. 875 T-NOTE 291130 | 5,100,000.00 | 5,047,406.25 | |
| 3. 875 T-NOTE 291231 | 5,700,000.00 | 5,640,773.46 | |
| 3. 875 T-NOTE 330815 | 16,640,000.00 | 16,314,999.97 | |
| 4 T-BOND 421115 | 5,870,000.00 | 5,513,672.68 | |
| 4 T-BOND 521115 | 9,230,000.00 | 8,629,328.95 | |
| 4 T-NOTE 251215 | 5,700,000.00 | 5,663,595.69 | |
| 4 T-NOTE 260215 | 8,000,000.00 | 7,953,593.76 | |
| 4 T-NOTE 280229 | 8,020,000.00 | 8,004,179.26 | |
| 4 T-NOTE 280630 | 6,000,000.00 | 5,991,328.14 | |
| 4 T-NOTE 291031 | 5,500,000.00 | 5,480,556.62 | |
| 4 T-NOTE 300228 | 6,270,000.00 | 6,243,058.55 | |
| 4 T-NOTE 300731 | 5,400,000.00 | 5,374,265.64 | |
| 4. 125 T-BOND 530815 | 10,020,000.00 | 9,588,670.23 | |
| 4. 125 T-NOTE 260615 | 7,000,000.00 | 6,985,917.96 | |
| 4. 125 T-NOTE 270930 | 7,440,000.00 | 7,454,967.18 | |
| 4. 125 T-NOTE 271031 | 6,500,000.00 | 6,512,314.44 | |
| 4. 125 T-NOTE 280731 | 6,500,000.00 | 6,525,136.72 | |
| 4. 125 T-NOTE 300831 | 6,500,000.00 | 6,512,441.38 | |
| 4. 125 T-NOTE 321115 | 15,100,000.00 | 15,103,539.13 | |
| 4. 25 T-BOND 390515 | 1,770,000.00 | 1,759,870.89 | |
| 4. 25 T-BOND 401115 | 1,980,000.00 | 1,946,084.75 | |
| 4. 25 T-NOTE 250531 | 9,000,000.00 | 8,962,910.19 | |
| 4. 25 T-NOTE 251015 | 6,000,000.00 | 5,983,710.96 | |
| 4. 375 T-BOND 380215 | 1,000,000.00 | 1,017,343.75 | |
| 4. 375 T-BOND 391115 | 2,270,000.00 | 2,280,950.97 | |
| 4. 375 T-BOND 400515 | 2,080,000.00 | 2,082,559.37 | |
| 4. 375 T-BOND 410515 | 1,960,000.00 | 1,949,625.77 | |
| 4. 375 T-BOND 430815 | 6,360,000.00 | 6,266,090.64 | |
| 4. 375 T-NOTE 260815 | 5,500,000.00 | 5,525,029.29 | |
| 4. 375 T-NOTE 261215 | 10,000,000.00 | 10,067,187.50 | |

| | | | |
|----------------------|------------------|---------------------------------------|--|
| 4. 375 T-NOTE 280831 | 7,000,000.00 | 7,100,625.00 | |
| 4. 375 T-NOTE 281130 | 8,050,000.00 | 8,176,410.09 | |
| 4. 375 T-NOTE 301130 | 6,250,000.00 | 6,353,515.62 | |
| 4. 5 T-BOND 360215 | 1,160,000.00 | 1,207,804.69 | |
| 4. 5 T-BOND 380515 | 1,330,000.00 | 1,367,458.19 | |
| 4. 5 T-BOND 390815 | 1,880,000.00 | 1,919,289.06 | |
| 4. 5 T-NOTE 251115 | 4,700,000.00 | 4,709,455.08 | |
| 4. 5 T-NOTE 260715 | 6,500,000.00 | 6,545,195.28 | |
| 4. 5 T-NOTE 331115 | 12,400,000.00 | 12,772,968.66 | |
| 4. 625 T-BOND 400215 | 2,100,000.00 | 2,168,660.15 | |
| 4. 625 T-NOTE 250228 | 3,000,000.00 | 2,997,363.27 | |
| 4. 625 T-NOTE 250630 | 5,000,000.00 | 5,008,007.80 | |
| 4. 625 T-NOTE 260315 | 6,000,000.00 | 6,042,187.50 | |
| 4. 625 T-NOTE 260915 | 7,500,000.00 | 7,583,789.10 | |
| 4. 625 T-NOTE 261015 | 6,800,000.00 | 6,880,617.19 | |
| 4. 625 T-NOTE 261115 | 7,000,000.00 | 7,088,046.84 | |
| 4. 625 T-NOTE 280930 | 7,050,000.00 | 7,225,148.43 | |
| 4. 625 T-NOTE 300930 | 5,700,000.00 | 5,876,566.39 | |
| 4. 75 T-BOND 410215 | 2,010,000.00 | 2,095,425.00 | |
| 4. 75 T-BOND 431115 | 2,980,000.00 | 3,085,929.69 | |
| 4. 75 T-BOND 531115 | 7,000,000.00 | 7,438,593.72 | |
| 4. 75 T-NOTE 250731 | 7,500,000.00 | 7,529,003.92 | |
| 4. 875 T-NOTE 251130 | 8,400,000.00 | 8,474,484.39 | |
| 4. 875 T-NOTE 281031 | 8,500,000.00 | 8,807,128.88 | |
| 4. 875 T-NOTE 301031 | 5,500,000.00 | 5,751,796.87 | |
| 5 T-BOND 370515 | 1,020,000.00 | 1,108,373.43 | |
| 5 T-NOTE 250831 | 8,500,000.00 | 8,567,734.37 | |
| 5 T-NOTE 250930 | 7,600,000.00 | 7,669,171.84 | |
| 5 T-NOTE 251031 | 9,500,000.00 | 9,595,371.07 | |
| 5. 25 T-BOND 281115 | 2,690,000.00 | 2,832,485.93 | |
| 5. 375 T-BOND 310215 | 1,300,000.00 | 1,408,722.65 | |
| 6 T-BOND 260215 | 1,200,000.00 | 1,239,187.50 | |
| 6. 125 T-BOND 271115 | 1,160,000.00 | 1,243,329.69 | |
| 6. 25 T-BOND 300515 | 1,150,000.00 | 1,286,966.79 | |
| アメリカドル合計 | 1,856,730,000.00 | 1,668,430,957.42 (246,427,252,410) | |

| | | | | | |
|---------------------|--------------|--------------------------|--------------|--------------|--|
| カナダドル | 国債証券 | 0.25 CAN GOVT 260301 | 2,200,000.00 | 2,038,930.65 | |
| | | 0.5 CAN GOVT 250901 | 2,900,000.00 | 2,735,400.37 | |
| | | 0.5 CAN GOVT 301201 | 4,500,000.00 | 3,700,676.38 | |
| | | 1 CAN GOVT 260901 | 2,500,000.00 | 2,329,482.60 | |
| | | 1 CAN GOVT 270601 | 1,930,000.00 | 1,774,076.11 | |
| | | 1.25 CAN GOVT 250301 | 2,100,000.00 | 2,028,085.81 | |
| | | 1.25 CAN GOVT 270301 | 2,500,000.00 | 2,324,445.67 | |
| | | 1.25 CAN GOVT 300601 | 4,410,000.00 | 3,863,630.01 | |
| | | 1.5 CAN GOVT 250401 | 1,000,000.00 | 966,272.05 | |
| | | 1.5 CAN GOVT 260601 | 4,070,000.00 | 3,856,604.20 | |
| | | 1.5 CAN GOVT 310601 | 5,900,000.00 | 5,154,252.39 | |
| | | 1.5 CAN GOVT 311201 | 4,270,000.00 | 3,696,676.23 | |
| | | 1.75 CAN GOVT 531201 | 4,900,000.00 | 3,354,702.04 | |
| | | 2 CAN GOVT 280601 | 2,670,000.00 | 2,511,592.93 | |
| | | 2 CAN GOVT 320601 | 3,750,000.00 | 3,353,980.57 | |
| | | 2 CAN GOVT 511201 | 6,060,000.00 | 4,473,199.12 | |
| | | 2.25 CAN GOVT 250601 | 4,360,000.00 | 4,240,937.68 | |
| | | 2.25 CAN GOVT 290601 | 2,210,000.00 | 2,084,133.98 | |
| | | 2.25 CAN GOVT 291201 | 1,000,000.00 | 939,301.38 | |
| | | 2.5 CAN GOVT 321201 | 3,500,000.00 | 3,243,548.17 | |
| | | 2.75 CAN GOVT 270901 | 2,000,000.00 | 1,941,557.92 | |
| | | 2.75 CAN GOVT 330601 | 3,000,000.00 | 2,829,018.36 | |
| | | 2.75 CAN GOVT 481201 | 1,680,000.00 | 1,476,938.78 | |
| | | 2.75 CAN GOVT 551201 | 1,750,000.00 | 1,513,657.85 | |
| | | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 1,250,000.00 | 1,068,341.70 | |
| | | 3 CAN GOVT 251001 | 3,000,000.00 | 2,940,851.85 | |
| | | 3 CAN GOVT 340601 | 1,200,000.00 | 1,149,760.04 | |
| | | 3.25 CAN GOVT 280901 | 2,600,000.00 | 2,570,412.70 | |
| | | 3.25 CAN GOVT 331201 | 3,170,000.00 | 3,110,515.60 | |
| | | 3.5 CAN GOVT 280301 | 2,000,000.00 | 1,994,817.44 | |
| | | 3.5 CAN GOVT 451201 | 1,650,000.00 | 1,648,508.07 | |
| | | 3.75 CAN GOVT 250201 | 3,000,000.00 | 2,973,027.63 | |
| | | 3.75 CAN GOVT 250501 | 3,500,000.00 | 3,470,748.50 | |
| 4 CAN GOVT 290301 | 1,080,000.00 | 1,105,685.35 | | | |
| 4 CAN GOVT 410601 | 1,200,000.00 | 1,273,717.35 | | | |
| 4.5 CAN GOVT 251101 | 2,540,000.00 | 2,553,650.29 | | | |

| | | | | | |
|------------------------|--------------|------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| | | 4. 5 CAN GOVT 260201 | 700,000.00 | 706,533.52 | |
| | | 5 CAN GOVT 370601 | 830,000.00 | 959,859.16 | |
| | | 5. 75 CAN GOVT 290601 | 950,000.00 | 1,055,753.71 | |
| | | 5. 75 CAN GOVT 330601 | 1,430,000.00 | 1,687,238.59 | |
| カナダドル合計 | | | 105,260,000.00 | 96,700,522.75 (10,598,377,293) | |
| オーストラリアドル | 国債証券 | 0. 25 AUST GOVT 251121 | 5,450,000.00 | 5,106,035.07 | |
| | | 0. 5 AUST GOVT 260921 | 4,100,000.00 | 3,762,719.11 | |
| | | 1 AUST GOVT 301221 | 3,010,000.00 | 2,463,227.75 | |
| | | 1 AUST GOVT 311121 | 4,250,000.00 | 3,368,316.59 | |
| | | 1. 25 AUST GOVT 320521 | 4,530,000.00 | 3,608,007.55 | |
| | | 1. 5 AUST GOVT 310621 | 3,740,000.00 | 3,126,610.04 | |
| | | 1. 75 AUST GOVT 321121 | 3,980,000.00 | 3,265,245.37 | |
| | | 1. 75 AUST GOVT 510621 | 3,070,000.00 | 1,705,945.48 | |
| | | 2. 25 AUST GOVT 280521 | 2,900,000.00 | 2,720,208.64 | |
| | | 2. 5 AUST GOVT 300521 | 3,940,000.00 | 3,615,574.29 | |
| | | 2. 75 AUST GOVT 271121 | 2,490,000.00 | 2,397,739.20 | |
| | | 2. 75 AUST GOVT 281121 | 3,040,000.00 | 2,894,717.82 | |
| | | 2. 75 AUST GOVT 291121 | 2,980,000.00 | 2,798,179.32 | |
| | | 2. 75 AUST GOVT 350621 | 1,520,000.00 | 1,308,747.83 | |
| | | 2. 75 AUST GOVT 410521 | 2,170,000.00 | 1,705,927.57 | |
| | | 3 AUST GOVT 331121 | 4,100,000.00 | 3,694,646.32 | |
| | | 3 AUST GOVT 470321 | 2,020,000.00 | 1,555,056.51 | |
| | | 3. 25 AUST GOVT 250421 | 1,100,000.00 | 1,089,683.66 | |
| | | 3. 25 AUST GOVT 290421 | 2,660,000.00 | 2,580,604.63 | |
| | | 3. 25 AUST GOVT 390621 | 2,130,000.00 | 1,842,961.34 | |
| | | 3. 5 AUST GOVT 341221 | 2,300,000.00 | 2,144,676.90 | |
| | | 3. 75 AUST GOVT 340521 | 2,300,000.00 | 2,203,338.24 | |
| | | 3. 75 AUST GOVT 370421 | 3,150,000.00 | 2,952,834.63 | |
| | | 4. 25 AUST GOVT 260421 | 2,490,000.00 | 2,511,503.88 | |
| 4. 5 AUST GOVT 330421 | 3,900,000.00 | 3,982,498.26 | | | |
| 4. 75 AUST GOVT 270421 | 3,050,000.00 | 3,137,816.51 | | | |
| 4. 75 AUST GOVT 540621 | 1,570,000.00 | 1,606,584.29 | | | |
| オーストラリアドル合計 | | | 81,940,000.00 | 73,149,406.80 (7,112,316,823) | |
| イギリス | 国債証券 | 0. 125 GILT 260130 | 2,600,000.00 | 2,402,790.00 | |

ボンド

| | | | |
|-------------------|--------------|--------------|--|
| 0.125 GILT 280131 | 2,300,000.00 | 1,984,458.40 | |
| 0.25 GILT 250131 | 5,100,000.00 | 4,879,163.88 | |
| 0.25 GILT 310731 | 4,460,000.00 | 3,415,022.00 | |
| 0.375 GILT 261022 | 3,750,000.00 | 3,400,464.75 | |
| 0.375 GILT 301022 | 2,390,000.00 | 1,906,068.02 | |
| 0.5 GILT 290131 | 4,900,000.00 | 4,161,080.00 | |
| 0.5 GILT 611022 | 3,700,000.00 | 1,091,130.00 | |
| 0.625 GILT 250607 | 2,880,000.00 | 2,736,720.00 | |
| 0.625 GILT 350731 | 4,030,000.00 | 2,742,818.00 | |
| 0.625 GILT 501022 | 2,890,000.00 | 1,154,266.00 | |
| 0.875 GILT 291022 | 2,320,000.00 | 1,974,222.56 | |
| 0.875 GILT 330731 | 5,140,000.00 | 3,876,074.00 | |
| 0.875 GILT 460131 | 2,980,000.00 | 1,469,736.00 | |
| 1 GILT 320131 | 5,100,000.00 | 4,086,820.74 | |
| 1.125 GILT 390131 | 3,600,000.00 | 2,318,760.00 | |
| 1.125 GILT 731022 | 1,500,000.00 | 546,733.20 | |
| 1.25 GILT 270722 | 2,100,000.00 | 1,921,143.00 | |
| 1.25 GILT 411022 | 3,750,000.00 | 2,286,750.00 | |
| 1.25 GILT 510731 | 4,180,000.00 | 2,030,644.00 | |
| 1.5 GILT 260722 | 2,490,000.00 | 2,344,015.78 | |
| 1.5 GILT 470722 | 3,160,000.00 | 1,773,708.00 | |
| 1.5 GILT 530731 | 2,950,000.00 | 1,496,936.20 | |
| 1.625 GILT 281022 | 3,470,000.00 | 3,147,654.35 | |
| 1.625 GILT 541022 | 2,060,000.00 | 1,073,466.00 | |
| 1.625 GILT 711022 | 2,530,000.00 | 1,166,491.92 | |
| 1.75 GILT 370907 | 3,340,000.00 | 2,474,606.00 | |
| 1.75 GILT 490122 | 1,780,000.00 | 1,038,808.00 | |
| 1.75 GILT 570722 | 3,230,000.00 | 1,708,347.00 | |
| 2 GILT 250907 | 2,100,000.00 | 2,023,194.60 | |
| 2.5 GILT 650722 | 2,480,000.00 | 1,574,800.00 | |
| 3.25 GILT 330131 | 5,100,000.00 | 4,822,815.00 | |
| 3.25 GILT 440122 | 3,440,000.00 | 2,855,544.00 | |
| 3.5 GILT 251022 | 4,400,000.00 | 4,336,860.00 | |
| 3.5 GILT 450122 | 3,190,000.00 | 2,735,744.00 | |
| 3.5 GILT 680722 | 2,470,000.00 | 2,026,882.00 | |
| 3.75 GILT 380129 | 3,350,000.00 | 3,148,665.00 | |

| | | | | | |
|--------------|------|---------------------------|-------------------|--|--|
| | | 3. 75 GILT 520722 | 2, 110, 000. 00 | 1, 837, 177. 00 | |
| | | 3. 75 GILT 531022 | 4, 180, 000. 00 | 3, 617, 372. 00 | |
| | | 4 GILT 600122 | 1, 980, 000. 00 | 1, 804, 374. 00 | |
| | | 4 GILT 631022 | 1, 630, 000. 00 | 1, 480, 366. 00 | |
| | | 4. 125 GILT 270129 | 4, 900, 000. 00 | 4, 913, 429. 92 | |
| | | 4. 25 GILT 271207 | 2, 450, 000. 00 | 2, 480, 071. 30 | |
| | | 4. 25 GILT 320607 | 3, 370, 000. 00 | 3, 456, 777. 50 | |
| | | 4. 25 GILT 360307 | 2, 410, 000. 00 | 2, 427, 593. 00 | |
| | | 4. 25 GILT 390907 | 2, 320, 000. 00 | 2, 280, 332. 64 | |
| | | 4. 25 GILT 401207 | 2, 420, 000. 00 | 2, 364, 582. 00 | |
| | | 4. 25 GILT 461207 | 2, 680, 000. 00 | 2, 557, 256. 00 | |
| | | 4. 25 GILT 491207 | 1, 990, 000. 00 | 1, 890, 102. 00 | |
| | | 4. 25 GILT 551207 | 2, 770, 000. 00 | 2, 628, 176. 00 | |
| | | 4. 5 GILT 280607 | 2, 500, 000. 00 | 2, 558, 994. 25 | |
| | | 4. 5 GILT 340907 | 1, 990, 000. 00 | 2, 060, 426. 10 | |
| | | 4. 5 GILT 421207 | 3, 190, 000. 00 | 3, 190, 156. 31 | |
| | | 4. 625 GILT 340131 | 1, 570, 000. 00 | 1, 643, 790. 00 | |
| | | 4. 75 GILT 301207 | 3, 650, 000. 00 | 3, 850, 180. 60 | |
| | | 4. 75 GILT 381207 | 2, 310, 000. 00 | 2, 410, 891. 56 | |
| | | 4. 75 GILT 431022 | 1, 250, 000. 00 | 1, 284, 625. 00 | |
| | | 5 GILT 250307 | 2, 490, 000. 00 | 2, 499, 319. 57 | |
| | | 6 GILT 281207 | 1, 890, 000. 00 | 2, 070, 632. 97 | |
| | | イギリスポンド合計 | 177, 260, 000. 00 | 145, 440, 028. 12 (27, 287, 458, 075) | |
| シンガポ ールドル | 国債証券 | 1. 25 SINGAPORGOVT 261101 | 700, 000. 00 | 667, 100. 00 | |
| | | 1. 625 SINGAPORGOV 310701 | 1, 050, 000. 00 | 957, 600. 00 | |
| | | 1. 875 SINGAPORGOV 500301 | 700, 000. 00 | 567, 000. 00 | |
| | | 1. 875 SINGAPORGOV 511001 | 950, 000. 00 | 773, 480. 50 | |
| | | 2. 125 SINGAPORGOV 260601 | 1, 530, 000. 00 | 1, 494, 504. 00 | |
| | | 2. 25 SINGAPORGOVT 360801 | 1, 300, 000. 00 | 1, 202, 500. 00 | |
| | | 2. 375 SINGAPORGOV 250601 | 1, 560, 000. 00 | 1, 538, 784. 00 | |
| | | 2. 375 SINGAPORGOV 390701 | 780, 000. 00 | 723, 106. 80 | |
| | | 2. 625 SINGAPORGOV 280501 | 800, 000. 00 | 791, 440. 00 | |
| | | 2. 625 SINGAPORGOV 320801 | 700, 000. 00 | 682, 150. 00 | |
| | | 2. 75 SINGAPORGOVT 420401 | 980, 000. 00 | 951, 545. 70 | |
| | | 2. 75 SINGAPORGOVT 460301 | 1, 140, 000. 00 | 1, 101, 240. 00 | |

| | | | | | |
|---------------------------|--------------|---------------------------|---------------|----------------------------------|--|
| | | 2. 875 SINGAPORGOV 270901 | 1,000,000.00 | 998,000.00 | |
| | | 2. 875 SINGAPORGOV 280801 | 1,000,000.00 | 999,685.00 | |
| | | 2. 875 SINGAPORGOV 290701 | 1,760,000.00 | 1,755,600.00 | |
| | | 2. 875SINGAPORGOVT 300901 | 1,340,000.00 | 1,335,310.00 | |
| | | 3 SINGAPORGOVT 720801 | 910,000.00 | 940,485.00 | |
| | | 3. 375 SINGAPORGOV 330901 | 1,280,000.00 | 1,323,801.60 | |
| | | 3. 5 SINGAPORGOVT 270301 | 1,000,000.00 | 1,015,000.00 | |
| シンガポールドル合計 | | | 20,480,000.00 | 19,818,332.60 (2,183,385,702) | |
| マレーシア リング ット | 国債証券 | 2. 632 MALAYSIAGOV 310415 | 2,800,000.00 | 2,603,934.31 | |
| | | 3. 502MALAYSIAGOVT 270531 | 3,000,000.00 | 2,999,957.01 | |
| | | 3. 582 MALAYSIAGOV 320715 | 2,370,000.00 | 2,321,351.38 | |
| | | 3. 733 MALAYSIAGO 280615 | 2,800,000.00 | 2,812,372.64 | |
| | | 3. 757 MALAYSIAGOV 400522 | 3,980,000.00 | 3,830,498.41 | |
| | | 3. 828 MALAYSIAGOV 340705 | 3,410,000.00 | 3,401,322.06 | |
| | | 3. 844 MALAYSIAGOV 330415 | 2,400,000.00 | 2,390,594.76 | |
| | | 3. 882 MALAYSIAGOV 250314 | 2,410,000.00 | 2,426,093.01 | |
| | | 3. 885 MALAYSIAGOV 290815 | 3,600,000.00 | 3,639,517.20 | |
| | | 3. 892 MALAYSIAGOV 270315 | 5,100,000.00 | 5,162,998.77 | |
| | | 3. 899 MALAYSIAGOV 271116 | 5,640,000.00 | 5,707,256.43 | |
| | | 3. 9 MALAYSIAGOVT 261130 | 2,150,000.00 | 2,175,499.43 | |
| | | 3. 906 MALAYSIAGOV 260715 | 2,730,000.00 | 2,761,465.43 | |
| | | 3. 955 MALAYSIAGOV 250915 | 4,270,000.00 | 4,306,609.69 | |
| | | 4. 065 MALAYSIAGOV 500615 | 5,250,000.00 | 5,110,080.20 | |
| | | 4. 232MALAYSIAGOVT 310630 | 2,550,000.00 | 2,627,728.33 | |
| | | 4. 254 MALAYSIAGOV 350531 | 2,150,000.00 | 2,207,093.25 | |
| | | 4. 392 MALAYSIAGOV 260415 | 1,350,000.00 | 1,376,325.27 | |
| | | 4. 457 MALAYSIAGOV 530331 | 1,600,000.00 | 1,660,462.72 | |
| | | 4. 498 MALAYSIAGOV 300415 | 3,640,000.00 | 3,789,576.70 | |
| | | 4. 504 MALAYSIAGOV 290430 | 1,500,000.00 | 1,560,710.40 | |
| | | 4. 642 MALAYSIAGOV 331107 | 2,600,000.00 | 2,772,927.30 | |
| | | 4. 696 MALAYSIAGOV 421015 | 3,900,000.00 | 4,204,128.63 | |
| | | 4. 736 MALAYSIAGOV 460315 | 1,650,000.00 | 1,772,852.56 | |
| 4. 762 MALAYSIAGOV 370407 | 4,440,000.00 | 4,778,758.68 | | | |
| 4. 893 MALAYSIAGOV 380608 | 3,360,000.00 | 3,689,176.84 | | | |
| 4. 921 MALAYSIAGOV 480706 | 2,020,000.00 | 2,233,301.90 | | | |

| | | | | | |
|--------------|------|---------------------------|------------------|--|--|
| | | 4. 935 MALAYSIAGOV 430930 | 1, 190, 000. 00 | 1, 313, 180. 94 | |
| マレーシアリングット合計 | | | 83, 860, 000. 00 | 85, 635, 774. 25 (2, 668, 736, 141) | |
| ニュージーランドドル | 国債証券 | 0. 25 NZ GOVT 280515 | 2, 000, 000. 00 | 1, 676, 162. 88 | |
| | | 1. 75 NZ GOVT 410515 | 600, 000. 00 | 375, 869. 44 | |
| | | 2 NZ GOVT 320515 | 2, 300, 000. 00 | 1, 886, 885. 36 | |
| | | 2. 75 NZ GOVT 250415 | 1, 400, 000. 00 | 1, 361, 195. 90 | |
| | | 2. 75 NZ GOVT 370415 | 1, 450, 000. 00 | 1, 150, 621. 41 | |
| | | 2. 75 NZ GOVT 510515 | 1, 180, 000. 00 | 786, 894. 96 | |
| | | 3 NZ GOVT 290420 | 1, 700, 000. 00 | 1, 587, 659. 63 | |
| | | 3. 5 NZ GOVT 330414 | 1, 900, 000. 00 | 1, 733, 743. 06 | |
| | | 4. 5 NZ GOVT 270415 | 1, 800, 000. 00 | 1, 800, 422. 82 | |
| | | 4. 5 NZ GOVT 300515 | 1, 000, 000. 00 | 999, 803. 66 | |
| ニュージーランドドル合計 | | | 15, 330, 000. 00 | 13, 359, 259. 12 (1, 205, 005, 172) | |
| スウェーデンクローネ | 国債証券 | 0. 125 SWD GOVT 310512 | 9, 450, 000. 00 | 8, 137, 793. 60 | |
| | | 0. 75 SWD GOVT 280512 | 8, 000, 000. 00 | 7, 518, 002. 64 | |
| | | 0. 75 SWD GOVT 291112 | 12, 200, 000. 00 | 11, 259, 877. 88 | |
| | | 1 SWD GOVT 261112 | 11, 960, 000. 00 | 11, 499, 997. 82 | |
| | | 1. 75 SWD GOVT 331111 | 11, 500, 000. 00 | 10, 992, 898. 99 | |
| | | 2. 25 SWD GOVT 320601 | 6, 750, 000. 00 | 6, 746, 700. 80 | |
| | | 2. 5 SWD GOVT 250512 | 8, 840, 000. 00 | 8, 784, 182. 56 | |
| | | 3. 5 SWD GOVT 390330 | 6, 470, 000. 00 | 7, 352, 702. 10 | |
| スウェーデンクローネ合計 | | | 75, 170, 000. 00 | 72, 292, 156. 39 (1, 021, 488, 169) | |
| ノルウェークローネ | 国債証券 | 1. 25 NORWE GOVT 310917 | 4, 700, 000. 00 | 3, 973, 544. 50 | |
| | | 1. 375 NORWE GOVT 300819 | 8, 770, 000. 00 | 7, 675, 346. 14 | |
| | | 1. 5 NORWE GOVT 260219 | 6, 040, 000. 00 | 5, 776, 112. 40 | |
| | | 1. 75 NORWE GOVT 250313 | 10, 200, 000. 00 | 9, 938, 520. 96 | |
| | | 1. 75 NORWE GOVT 270217 | 5, 120, 000. 00 | 4, 851, 660. 80 | |
| | | 1. 75 NORWE GOVT 290906 | 4, 600, 000. 00 | 4, 195, 108. 00 | |
| | | 2 NORWE GOVT 280426 | 6, 900, 000. 00 | 6, 497, 785. 20 | |
| | | 2. 125 NORWE GOVT 320518 | 10, 500, 000. 00 | 9, 400, 755. 00 | |
| | | 3 NORWE GOVT 330815 | 4, 500, 000. 00 | 4, 280, 899. 50 | |
| | | 3. 5 NORWE GOVT 421006 | 4, 000, 000. 00 | 4, 021, 640. 00 | |
| ノルウェークローネ合計 | | | 65, 330, 000. 00 | 60, 611, 372. 50 | |

| | | | | |
|--------------------------|---------------|--------------------------|----------------|-----------------------------------|
| | | | | (858,257,034) |
| デンマーク クローネ | 国債証券 | 0 DMK GOVT 311115 | 14,550,000.00 | 12,166,934.21 |
| | | 0.25 DMK GOVT 521115 | 11,830,000.00 | 6,368,952.59 |
| | | 0.5 DMK GOVT 271115 | 8,100,000.00 | 7,573,777.02 |
| | | 0.5 DMK GOVT 291115 | 10,550,000.00 | 9,530,078.75 |
| | | 1.75 DMK GOVT 251115 | 7,490,000.00 | 7,379,522.50 |
| | | 2.25 DMK GOVT 331115 | 3,500,000.00 | 3,445,400.00 |
| | | 4.5 DMK GOVT 391115 | 15,650,000.00 | 19,513,820.67 |
| デンマーククローネ合計 | | | 71,670,000.00 | 65,978,485.74 (1,417,217,873) |
| メキシコ ペソ | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 12,350,000.00 | 13,059,384.00 |
| | | 5 MEXICAN BONOS 250306 | 34,000,000.00 | 32,360,520.00 |
| | | 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 52,000,000.00 | 46,538,960.00 |
| | | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 65,500,000.00 | 60,498,609.29 |
| | | 7 MEXICAN BONOS 260903 | 20,000,000.00 | 18,764,600.00 |
| | | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 48,750,000.00 | 46,184,775.00 |
| | | 7.5 MEXICAN BONOS 330526 | 34,000,000.00 | 30,315,080.00 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 68,050,000.00 | 62,793,137.50 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 13,400,000.00 | 12,012,966.00 |
| | | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 49,690,000.00 | 42,587,808.30 |
| | | 8 MEXICAN BONOS 350524 | 5,000,000.00 | 4,561,176.35 |
| | | 8 MEXICAN BONOS 471107 | 39,100,000.00 | 34,029,512.00 |
| | | 8 MEXICAN BONOS 530731 | 33,270,000.00 | 28,634,490.90 |
| | | 8.5 MEXICAN BONOS 290301 | 13,420,000.00 | 13,029,075.40 |
| | | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 39,150,000.00 | 38,155,981.50 |
| 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 39,700,000.00 | 37,095,680.00 | | |
| メキシコペソ合計 | | | 567,380,000.00 | 520,621,756.24 (4,470,839,331) |
| イスラエル シェケル | 国債証券 | 0.5 ISRAEL FIXED 250430 | 6,500,000.00 | 6,257,225.00 |
| | | 0.5 ISRAEL FIXED 260227 | 5,800,000.00 | 5,439,530.00 |
| | | 1 ISRAEL FIXED BO 300331 | 3,370,000.00 | 2,826,082.00 |
| | | 1.3 ISRAEL FIXED 320430 | 4,800,000.00 | 3,848,640.00 |
| | | 1.5 ISRAEL FIXED 370531 | 4,900,000.00 | 3,435,880.00 |
| | | 2.25 ISRAEL FIXED 280928 | 3,080,000.00 | 2,875,334.00 |
| | | 2.8 ISRAEL FIXED 521129 | 800,000.00 | 549,360.00 |
| | | 3.75 ISRAEL FIXED 470331 | 4,680,000.00 | 4,144,140.00 |

| | | | | | |
|-------------------------|------------------|---------------------------|------------------|--|--|
| | | 5. 5 ISRAEL FIXED 420131 | 3, 130, 000. 00 | 3, 430, 167. 00 | |
| | | 6. 25 ISRAEL FIXED 261030 | 5, 000, 000. 00 | 5, 380, 500. 00 | |
| イスラエルシェケル合計 | | | 42, 060, 000. 00 | 38, 186, 858. 00 (1, 521, 929, 588) | |
| ポーランド ドズロチ | 国債証券 | 0. 25 POLAND 261025 | 3, 000, 000. 00 | 2, 643, 576. 00 | |
| | | 0. 75 POLAND 250425 | 3, 500, 000. 00 | 3, 325, 525. 00 | |
| | | 1. 25 POLAND 301025 | 9, 190, 000. 00 | 7, 187, 030. 31 | |
| | | 1. 75 POLAND 320425 | 9, 900, 000. 00 | 7, 620, 287. 40 | |
| | | 2. 5 POLAND 260725 | 7, 840, 000. 00 | 7, 391, 732. 32 | |
| | | 2. 5 POLAND 270725 | 6, 110, 000. 00 | 5, 630, 187. 81 | |
| | | 2. 75 POLAND 280425 | 5, 760, 000. 00 | 5, 259, 231. 36 | |
| | | 2. 75 POLAND 291025 | 7, 900, 000. 00 | 6, 996, 737. 70 | |
| | | 3. 25 POLAND 250725 | 8, 700, 000. 00 | 8, 481, 334. 20 | |
| | | 3. 75 POLAND 270525 | 4, 000, 000. 00 | 3, 849, 264. 00 | |
| | | 5. 75 POLAND 290425 | 5, 600, 000. 00 | 5, 743, 955. 84 | |
| | | 6 POLAND 331025 | 2, 000, 000. 00 | 2, 094, 052. 00 | |
| | | 7. 5 POLAND 280725 | 6, 000, 000. 00 | 6, 556, 821. 00 | |
| ポーランドズロチ合計 | | | 79, 500, 000. 00 | 72, 779, 734. 94 (2, 664, 305, 980) | |
| 中国元 | 国債証券 | 1. 99 CHINA GOVT 250409 | 35, 000, 000. 00 | 34, 938, 286. 60 | |
| | | 2 CHINA GOVT 250615 | 42, 000, 000. 00 | 41, 893, 899. 60 | |
| | | 2. 18 CHINA GOVT 250825 | 34, 000, 000. 00 | 33, 993, 581. 82 | |
| | | 2. 18 CHINA GOVT 260815 | 35, 000, 000. 00 | 34, 959, 034. 60 | |
| | | 2. 22 CHINA GOVT 250925 | 50, 000, 000. 00 | 50, 026, 170. 00 | |
| | | 2. 24 CHINA GOVT 250525 | 18, 000, 000. 00 | 18, 017, 238. 60 | |
| | | 2. 26 CHINA GOVT 250224 | 14, 000, 000. 00 | 14, 025, 338. 60 | |
| | | 2. 28 CHINA GOVT 251125 | 34, 000, 000. 00 | 34, 059, 479. 60 | |
| | | 2. 3 CHINA GOVT 260515 | 30, 000, 000. 00 | 30, 033, 123. 00 | |
| | | 2. 33 CHINA GOVT 251215 | 30, 000, 000. 00 | 30, 088, 482. 00 | |
| | | 2. 35 CHINA GOVT 250315 | 22, 000, 000. 00 | 22, 057, 945. 80 | |
| | | 2. 37 CHINA GOVT 270120 | 28, 000, 000. 00 | 28, 089, 863. 20 | |
| | | 2. 39 CHINA GOVT 261115 | 25, 000, 000. 00 | 25, 096, 320. 00 | |
| | | 2. 4 CHINA GOVT 280715 | 31, 000, 000. 00 | 31, 014, 694. 00 | |
| | | 2. 44 CHINA GOVT 271015 | 23, 000, 000. 00 | 23, 085, 672. 70 | |
| | | 2. 46 CHINA GOVT 260215 | 29, 000, 000. 00 | 29, 148, 717. 80 | |
| 2. 48 CHINA GOVT 270415 | 28, 000, 000. 00 | 28, 117, 023. 20 | | | |

| | | | |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 2.48 CHINA GOVT 280925 | 12,000,000.00 | 12,058,852.80 | |
| 2.5 CHINA GOVT 270725 | 25,000,000.00 | 25,140,207.50 | |
| 2.52 CHINA GOVT 330825 | 37,000,000.00 | 36,938,899.68 | |
| 2.55 CHINA GOVT 281015 | 50,000,000.00 | 50,466,295.00 | |
| 2.6 CHINA GOVT 300915 | 39,000,000.00 | 39,289,263.00 | |
| 2.6 CHINA GOVT 320901 | 23,000,000.00 | 23,062,304.70 | |
| 2.62 CHINA GOVT 280415 | 33,000,000.00 | 33,398,940.30 | |
| 2.62 CHINA GOVT 290925 | 21,000,000.00 | 21,219,586.50 | |
| 2.62 CHINA GOVT 300625 | 31,000,000.00 | 31,249,881.70 | |
| 2.64 CHINA GOVT 280115 | 41,000,000.00 | 41,473,492.60 | |
| 2.67 CHINA GOVT 330525 | 28,000,000.00 | 28,272,039.60 | |
| 2.67 CHINA GOVT 331125 | 31,000,000.00 | 31,402,039.00 | |
| 2.68 CHINA GOVT 300521 | 45,000,000.00 | 45,546,484.50 | |
| 2.69 CHINA GOVT 260812 | 34,000,000.00 | 34,380,915.60 | |
| 2.69 CHINA GOVT 320815 | 26,000,000.00 | 26,276,991.00 | |
| 2.74 CHINA GOVT 260804 | 15,000,000.00 | 15,204,306.00 | |
| 2.75 CHINA GOVT 290615 | 30,000,000.00 | 30,534,192.00 | |
| 2.75 CHINA GOVT 320217 | 24,000,000.00 | 24,401,858.40 | |
| 2.76 CHINA GOVT 320515 | 25,000,000.00 | 25,414,577.50 | |
| 2.79 CHINA GOVT 291215 | 31,000,000.00 | 31,592,856.40 | |
| 2.8 CHINA GOVT 290324 | 27,000,000.00 | 27,540,475.20 | |
| 2.8 CHINA GOVT 300325 | 35,000,000.00 | 35,652,452.50 | |
| 2.8 CHINA GOVT 321115 | 29,000,000.00 | 29,542,604.50 | |
| 2.85 CHINA GOVT 270604 | 32,000,000.00 | 32,571,449.60 | |
| 2.88 CHINA GOVT 330225 | 26,000,000.00 | 26,727,508.60 | |
| 2.89 CHINA GOVT 311118 | 20,000,000.00 | 20,545,180.00 | |
| 2.9 CHINA GOVT 260505 | 17,000,000.00 | 17,270,522.70 | |
| 2.91 CHINA GOVT 281014 | 32,000,000.00 | 32,801,116.80 | |
| 2.99 CHINA GOVT 251015 | 9,000,000.00 | 9,137,638.80 | |
| 3 CHINA GOVT 531015 | 8,000,000.00 | 8,462,741.60 | |
| 3.01 CHINA GOVT 280513 | 39,000,000.00 | 40,133,156.70 | |
| 3.02 CHINA GOVT 251022 | 36,000,000.00 | 36,572,097.60 | |
| 3.02 CHINA GOVT 310527 | 38,000,000.00 | 39,329,167.80 | |
| 3.03 CHINA GOVT 260311 | 28,000,000.00 | 28,527,699.20 | |
| 3.12 CHINA GOVT 261205 | 37,000,000.00 | 37,952,394.80 | |
| 3.12 CHINA GOVT 521025 | 15,000,000.00 | 15,925,417.50 | |

| | | | | | |
|-------|------|-------------------------|------------------|--------------------------------------|--|
| | | 3. 13 CHINA GOVT 291121 | 30,000,000.00 | 31,193,889.00 | |
| | | 3. 19 CHINA GOVT 530415 | 17,000,000.00 | 18,515,363.00 | |
| | | 3. 22 CHINA GOVT 251206 | 18,000,000.00 | 18,377,582.40 | |
| | | 3. 25 CHINA GOVT 260606 | 28,000,000.00 | 28,729,643.60 | |
| | | 3. 25 CHINA GOVT 281122 | 17,000,000.00 | 17,763,208.20 | |
| | | 3. 27 CHINA GOVT 301119 | 35,000,000.00 | 36,857,716.00 | |
| | | 3. 28 CHINA GOVT 271203 | 24,000,000.00 | 24,957,048.00 | |
| | | 3. 29 CHINA GOVT 290523 | 25,000,000.00 | 26,186,735.00 | |
| | | 3. 32 CHINA GOVT 520415 | 17,000,000.00 | 18,859,454.90 | |
| | | 3. 39 CHINA GOVT 500316 | 32,000,000.00 | 35,543,571.20 | |
| | | 3. 52 CHINA GOVT 270504 | 19,000,000.00 | 19,864,353.70 | |
| | | 3. 53 CHINA GOVT 511018 | 16,000,000.00 | 18,264,547.20 | |
| | | 3. 54 CHINA GOVT 280816 | 13,000,000.00 | 13,758,165.20 | |
| | | 3. 59 CHINA GOVT 270803 | 7,000,000.00 | 7,352,108.40 | |
| | | 3. 6 CHINA GOVT 250906 | 8,000,000.00 | 8,212,487.20 | |
| | | 3. 61 CHINA GOVT 250607 | 10,000,000.00 | 10,232,994.00 | |
| | | 3. 69 CHINA GOVT 280517 | 15,000,000.00 | 15,977,428.50 | |
| | | 3. 72 CHINA GOVT 510412 | 21,000,000.00 | 24,902,215.80 | |
| | | 3. 77 CHINA GOVT 250308 | 11,000,000.00 | 11,235,082.10 | |
| | | 3. 81 CHINA GOVT 500914 | 31,000,000.00 | 36,884,389.00 | |
| | | 3. 86 CHINA GOVT 490722 | 25,000,000.00 | 29,837,662.50 | |
| | | 4. 08 CHINA GOVT 481022 | 25,000,000.00 | 30,759,412.50 | |
| 中国元合計 | | | 1,981,000,000.00 | 2,038,925,536.20 (41,954,562,973) | |
| ユーロ | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 250420 | 800,000.00 | 771,851.20 | |
| | | 0 AUSTRIA GOVT 281020 | 1,790,000.00 | 1,589,886.95 | |
| | | 0 AUSTRIA GOVT 300220 | 2,150,000.00 | 1,843,797.00 | |
| | | 0 AUSTRIA GOVT 310220 | 2,130,000.00 | 1,771,467.75 | |
| | | 0 AUSTRIA GOVT 401020 | 810,000.00 | 490,173.93 | |
| | | 0 BEL GOVT 271022 | 1,800,000.00 | 1,642,427.10 | |
| | | 0 BEL GOVT 311022 | 2,300,000.00 | 1,875,439.78 | |
| | | 0 BUND 260815 | 5,930,000.00 | 5,589,202.90 | |
| | | 0 BUND 271115 | 3,100,000.00 | 2,854,591.60 | |
| | | 0 BUND 281115 | 4,400,000.00 | 3,974,467.20 | |
| | | 0 BUND 290815 | 4,550,000.00 | 4,047,297.80 | |
| | | 0 BUND 300215 | 4,820,000.00 | 4,241,330.08 | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| 0 BUND 300815 | 4,960,000.00 | 4,318,696.80 | |
| 0 BUND 300815 | 1,550,000.00 | 1,350,928.85 | |
| 0 BUND 310215 | 3,700,000.00 | 3,186,565.80 | |
| 0 BUND 310815 | 5,400,000.00 | 4,598,283.60 | |
| 0 BUND 310815 | 1,900,000.00 | 1,619,343.40 | |
| 0 BUND 320215 | 4,690,000.00 | 3,944,651.13 | |
| 0 BUND 350515 | 3,630,000.00 | 2,793,201.51 | |
| 0 BUND 360515 | 3,800,000.00 | 2,839,056.00 | |
| 0 BUND 500815 | 6,220,000.00 | 3,261,979.48 | |
| 0 BUND 500815 | 1,560,000.00 | 822,163.68 | |
| 0 BUND 520815 | 4,540,000.00 | 2,268,987.58 | |
| 0 FINNISH GOVT 300915 | 750,000.00 | 632,482.20 | |
| 0 IRISH GOVT 311018 | 1,350,000.00 | 1,116,184.05 | |
| 0 ITALY GOVT 260401 | 3,300,000.00 | 3,096,092.27 | |
| 0 ITALY GOVT 260801 | 5,000,000.00 | 4,648,020.00 | |
| 0 NETH GOVT 260115 | 2,200,000.00 | 2,091,247.40 | |
| 0 NETH GOVT 270115 | 1,950,000.00 | 1,817,399.22 | |
| 0 NETH GOVT 290115 | 1,300,000.00 | 1,156,582.05 | |
| 0 NETH GOVT 300715 | 2,650,000.00 | 2,271,156.00 | |
| 0 NETH GOVT 310715 | 2,220,000.00 | 1,854,925.55 | |
| 0 NETH GOVT 380115 | 1,540,000.00 | 1,054,417.71 | |
| 0 NETH GOVT 520115 | 2,830,000.00 | 1,368,803.08 | |
| 0 O. A. T 250225 | 5,400,000.00 | 5,222,369.16 | |
| 0 O. A. T 250325 | 7,380,000.00 | 7,126,113.24 | |
| 0 O. A. T 260225 | 6,600,000.00 | 6,256,140.00 | |
| 0 O. A. T 270225 | 6,130,000.00 | 5,682,387.40 | |
| 0 O. A. T 291125 | 7,180,000.00 | 6,216,666.58 | |
| 0 O. A. T 301125 | 8,840,000.00 | 7,445,048.00 | |
| 0 O. A. T 311125 | 8,400,000.00 | 6,866,815.20 | |
| 0 O. A. T 320525 | 6,530,000.00 | 5,253,685.38 | |
| 0 OBL 250411 | 2,800,000.00 | 2,703,652.00 | |
| 0 OBL 251010 | 4,000,000.00 | 3,827,320.00 | |
| 0 OBL 251010 | 1,000,000.00 | 958,388.00 | |
| 0 OBL 260410 | 6,910,000.00 | 6,553,236.70 | |
| 0 OBL 261009 | 2,900,000.00 | 2,724,680.50 | |
| 0 OBL 270416 | 3,050,000.00 | 2,838,997.95 | |

| | | | |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 0 SPAIN GOVT 250131 | 3,630,000.00 | 3,513,858.15 | |
| 0 SPAIN GOVT 250531 | 2,500,000.00 | 2,399,885.50 | |
| 0 SPAIN GOVT 260131 | 3,000,000.00 | 2,836,338.00 | |
| 0 SPAIN GOVT 270131 | 3,800,000.00 | 3,503,849.43 | |
| 0 SPAIN GOVT 280131 | 3,800,000.00 | 3,410,952.20 | |
| 0.1 BEL GOVT 300622 | 2,500,000.00 | 2,141,320.00 | |
| 0.1 SPAIN GOVT 310430 | 4,360,000.00 | 3,559,756.00 | |
| 0.125 FINNISH GOV 310915 | 1,070,000.00 | 884,724.15 | |
| 0.125 FINNISH GOV 360415 | 510,000.00 | 364,114.34 | |
| 0.125 FINNISH GOV 520415 | 750,000.00 | 349,231.91 | |
| 0.2 IRISH GOVT 270515 | 500,000.00 | 465,741.35 | |
| 0.2 IRISH GOVT 301018 | 1,220,000.00 | 1,052,246.90 | |
| 0.25 AUSTRIA GOVT 361020 | 1,050,000.00 | 750,942.15 | |
| 0.25 BUND 270215 | 4,490,000.00 | 4,227,101.52 | |
| 0.25 BUND 280815 | 4,170,000.00 | 3,831,521.10 | |
| 0.25 BUND 290215 | 4,850,000.00 | 4,417,389.70 | |
| 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 540,000.00 | 345,026.84 | |
| 0.25 ITALY GOVT 280315 | 2,700,000.00 | 2,409,733.80 | |
| 0.25 NETH GOVT 250715 | 1,930,000.00 | 1,860,571.72 | |
| 0.25 NETH GOVT 290715 | 2,950,000.00 | 2,632,063.75 | |
| 0.25 O. A. T 261125 | 5,680,000.00 | 5,332,952.00 | |
| 0.35 BEL GOVT 320622 | 2,450,000.00 | 2,016,152.04 | |
| 0.35 IRISH GOVT 321018 | 800,000.00 | 663,437.28 | |
| 0.35 ITALY GOVT 250201 | 3,060,000.00 | 2,970,666.36 | |
| 0.4 BEL GOVT 400622 | 1,300,000.00 | 840,827.00 | |
| 0.4 IRISH GOVT 350515 | 1,020,000.00 | 792,846.00 | |
| 0.45 ITALY GOVT 290215 | 2,300,000.00 | 2,010,924.50 | |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 270420 | 2,100,000.00 | 1,971,366.60 | |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 290220 | 2,050,000.00 | 1,852,517.35 | |
| 0.5 BUND 250215 | 7,110,000.00 | 6,921,227.15 | |
| 0.5 BUND 260215 | 6,660,000.00 | 6,396,830.10 | |
| 0.5 BUND 270815 | 5,120,000.00 | 4,826,342.40 | |
| 0.5 BUND 280215 | 4,280,000.00 | 4,006,127.08 | |
| 0.5 FINNISH GOVT 260415 | 1,670,000.00 | 1,595,974.24 | |
| 0.5 FINNISH GOVT 270915 | 700,000.00 | 652,108.10 | |
| 0.5 FINNISH GOVT 280915 | 1,480,000.00 | 1,350,810.80 | |

| | | | |
|---------------------------|-----------------|-----------------|--|
| 0. 5 FINNISH GOVT 290915 | 1, 350, 000. 00 | 1, 206, 818. 59 | |
| 0. 5 FINNISH GOVT 430415 | 780, 000. 00 | 492, 151. 92 | |
| 0. 5 ITALY GOVT 260201 | 2, 450, 000. 00 | 2, 332, 057. 58 | |
| 0. 5 ITALY GOVT 280715 | 2, 400, 000. 00 | 2, 144, 389. 82 | |
| 0. 5 NETH GOVT 260715 | 3, 970, 000. 00 | 3, 785, 810. 26 | |
| 0. 5 NETH GOVT 320715 | 2, 300, 000. 00 | 1, 953, 337. 92 | |
| 0. 5 NETH GOVT 400115 | 2, 630, 000. 00 | 1, 880, 151. 86 | |
| 0. 5 O. A. T 250525 | 6, 490, 000. 00 | 6, 287, 463. 32 | |
| 0. 5 O. A. T 260525 | 7, 530, 000. 00 | 7, 181, 496. 54 | |
| 0. 5 O. A. T 290525 | 9, 030, 000. 00 | 8, 143, 840. 95 | |
| 0. 5 O. A. T 400525 | 3, 990, 000. 00 | 2, 667, 688. 74 | |
| 0. 5 O. A. T 440625 | 3, 390, 000. 00 | 2, 040, 166. 41 | |
| 0. 5 O. A. T 720525 | 2, 100, 000. 00 | 815, 290. 56 | |
| 0. 5 SPAIN GOVT 300430 | 3, 580, 000. 00 | 3, 101, 858. 78 | |
| 0. 5 SPAIN GOVT 311031 | 3, 190, 000. 00 | 2, 646, 551. 60 | |
| 0. 55 IRISH GOVT 410422 | 600, 000. 00 | 408, 046. 80 | |
| 0. 6 ITALY GOVT 310801 | 3, 100, 000. 00 | 2, 515, 808. 10 | |
| 0. 6 SPAIN GOVT 291031 | 3, 680, 000. 00 | 3, 249, 793. 28 | |
| 0. 65 BEL GOVT 710622 | 1, 090, 000. 00 | 456, 050. 55 | |
| 0. 7 AUSTRIA GOVT 710420 | 680, 000. 00 | 302, 893. 08 | |
| 0. 7 SPAIN GOVT 320430 | 3, 800, 000. 00 | 3, 160, 087. 60 | |
| 0. 75 AUSTRIA GOVT 261020 | 2, 480, 000. 00 | 2, 362, 852. 24 | |
| 0. 75 AUSTRIA GOVT 280220 | 1, 690, 000. 00 | 1, 576, 105. 83 | |
| 0. 75 AUSTRIA GOVT 510320 | 1, 570, 000. 00 | 910, 926. 56 | |
| 0. 75 FINNISH GOVT 310415 | 1, 050, 000. 00 | 921, 671. 10 | |
| 0. 75 NETH GOVT 270715 | 2, 670, 000. 00 | 2, 527, 449. 23 | |
| 0. 75 NETH GOVT 280715 | 3, 020, 000. 00 | 2, 814, 783. 60 | |
| 0. 75 O. A. T 280225 | 7, 400, 000. 00 | 6, 909, 972. 00 | |
| 0. 75 O. A. T 280525 | 9, 750, 000. 00 | 9, 068, 943. 00 | |
| 0. 75 O. A. T 281125 | 9, 060, 000. 00 | 8, 355, 603. 12 | |
| 0. 75 O. A. T 520525 | 5, 560, 000. 00 | 3, 022, 927. 52 | |
| 0. 75 O. A. T 530525 | 4, 990, 000. 00 | 2, 655, 897. 56 | |
| 0. 8 BEL GOVT 250622 | 2, 970, 000. 00 | 2, 885, 037. 21 | |
| 0. 8 BEL GOVT 270622 | 2, 880, 000. 00 | 2, 723, 572. 80 | |
| 0. 8 BEL GOVT 280622 | 2, 250, 000. 00 | 2, 095, 670. 25 | |
| 0. 8 SPAIN GOVT 270730 | 3, 350, 000. 00 | 3, 136, 685. 40 | |

| | | | |
|---------------------------|-----------------|-----------------|--|
| 0. 8 SPAIN GOVT 290730 | 5, 430, 000. 00 | 4, 876, 623. 27 | |
| 0. 85 AUSTRIA GOVT 200630 | 650, 000. 00 | 283, 904. 40 | |
| 0. 85 ITALY GOVT 270115 | 3, 060, 000. 00 | 2, 881, 136. 88 | |
| 0. 85 SPAIN GOVT 370730 | 2, 470, 000. 00 | 1, 777, 297. 20 | |
| 0. 875 FINNISH GOV 250915 | 630, 000. 00 | 611, 488. 64 | |
| 0. 9 AUSTRIA GOVT 320220 | 2, 120, 000. 00 | 1, 844, 079. 88 | |
| 0. 9 BEL GOVT 290622 | 3, 090, 000. 00 | 2, 842, 784. 55 | |
| 0. 9 IRISH GOVT 280515 | 1, 640, 000. 00 | 1, 543, 256. 40 | |
| 0. 9 ITALY GOVT 310401 | 4, 230, 000. 00 | 3, 552, 257. 68 | |
| 0. 95 ITALY GOVT 270915 | 4, 000, 000. 00 | 3, 723, 384. 00 | |
| 0. 95 ITALY GOVT 300801 | 2, 940, 000. 00 | 2, 525, 677. 56 | |
| 0. 95 ITALY GOVT 311201 | 2, 730, 000. 00 | 2, 254, 406. 70 | |
| 0. 95 ITALY GOVT 320601 | 3, 600, 000. 00 | 2, 928, 456. 00 | |
| 0. 95 ITALY GOVT 370301 | 2, 560, 000. 00 | 1, 770, 992. 64 | |
| 1 BEL GOVT 260622 | 2, 760, 000. 00 | 2, 659, 903. 08 | |
| 1 BEL GOVT 310622 | 2, 850, 000. 00 | 2, 536, 690. 95 | |
| 1 BUND 250815 | 5, 580, 000. 00 | 5, 434, 540. 56 | |
| 1 BUND 380515 | 3, 610, 000. 00 | 2, 978, 141. 70 | |
| 1 IRISH GOVT 260515 | 1, 850, 000. 00 | 1, 788, 679. 90 | |
| 1 O. A. T 251125 | 6, 580, 000. 00 | 6, 381, 645. 90 | |
| 1 O. A. T 270525 | 6, 260, 000. 00 | 5, 967, 032. 00 | |
| 1 SPAIN GOVT 420730 | 2, 070, 000. 00 | 1, 337, 075. 10 | |
| 1 SPAIN GOVT 501031 | 3, 650, 000. 00 | 1, 959, 958. 75 | |
| 1. 1 IRISH GOVT 290515 | 1, 610, 000. 00 | 1, 505, 420. 84 | |
| 1. 1 ITALY GOVT 270401 | 3, 300, 000. 00 | 3, 116, 597. 22 | |
| 1. 125 FINNISH GOV 340415 | 730, 000. 00 | 621, 717. 64 | |
| 1. 2 AUSTRIA GOVT 251020 | 2, 710, 000. 00 | 2, 641, 312. 34 | |
| 1. 2 ITALY GOVT 250815 | 2, 100, 000. 00 | 2, 040, 549. 98 | |
| 1. 2 SPAIN GOVT 401031 | 3, 030, 000. 00 | 2, 111, 516. 10 | |
| 1. 25 BEL GOVT 330422 | 1, 770, 000. 00 | 1, 559, 371. 77 | |
| 1. 25 BUND 480815 | 5, 990, 000. 00 | 4, 641, 686. 94 | |
| 1. 25 ITALY GOVT 261201 | 2, 680, 000. 00 | 2, 559, 426. 80 | |
| 1. 25 O. A. T 340525 | 6, 790, 000. 00 | 5, 852, 986. 79 | |
| 1. 25 O. A. T 360525 | 7, 150, 000. 00 | 5, 907, 408. 65 | |
| 1. 25 O. A. T 380525 | 2, 880, 000. 00 | 2, 280, 124. 80 | |
| 1. 25 SPAIN GOVT 301031 | 4, 030, 000. 00 | 3, 623, 997. 65 | |

| | | | |
|---------------------------|--------------|--------------|--|
| 1. 3 IRISH GOVT 330515 | 860,000.00 | 768,772.92 | |
| 1. 3 OBL 271015 | 5,750,000.00 | 5,566,345.00 | |
| 1. 3 OBL 271015 | 800,000.00 | 775,530.16 | |
| 1. 3 SPAIN GOVT 261031 | 4,750,000.00 | 4,571,476.00 | |
| 1. 35 IRISH GOVT 310318 | 1,070,000.00 | 993,243.55 | |
| 1. 35 ITALY GOVT 300401 | 3,610,000.00 | 3,214,586.30 | |
| 1. 375 FINNISH GOV 270415 | 800,000.00 | 772,193.76 | |
| 1. 375 FINNISH GOV 470415 | 840,000.00 | 612,478.18 | |
| 1. 4 BEL GOVT 530622 | 1,720,000.00 | 1,101,334.59 | |
| 1. 4 SPAIN GOVT 280430 | 3,740,000.00 | 3,541,780.00 | |
| 1. 4 SPAIN GOVT 280730 | 4,240,000.00 | 4,002,390.40 | |
| 1. 45 BEL GOVT 370622 | 1,220,000.00 | 1,005,478.86 | |
| 1. 45 ITALY GOVT 250515 | 2,300,000.00 | 2,251,195.70 | |
| 1. 45 ITALY GOVT 360301 | 2,140,000.00 | 1,629,370.32 | |
| 1. 45 SPAIN GOVT 271031 | 4,330,000.00 | 4,135,565.68 | |
| 1. 45 SPAIN GOVT 290430 | 3,300,000.00 | 3,088,400.70 | |
| 1. 45 SPAIN GOVT 711031 | 1,300,000.00 | 625,657.50 | |
| 1. 5 AUSTRIA GOVT 470220 | 1,810,000.00 | 1,337,629.82 | |
| 1. 5 AUSTRIA GOVT 861102 | 460,000.00 | 272,957.10 | |
| 1. 5 FINNISH GOVT 320915 | 750,000.00 | 680,511.00 | |
| 1. 5 IRISH GOVT 500515 | 1,460,000.00 | 1,059,526.38 | |
| 1. 5 ITALY GOVT 250601 | 3,300,000.00 | 3,228,795.90 | |
| 1. 5 ITALY GOVT 450430 | 2,010,000.00 | 1,248,748.68 | |
| 1. 5 O. A. T 310525 | 9,560,000.00 | 8,886,268.56 | |
| 1. 5 O. A. T 500525 | 5,230,000.00 | 3,629,703.68 | |
| 1. 5 SPAIN GOVT 270430 | 4,290,000.00 | 4,128,344.22 | |
| 1. 6 BEL GOVT 470622 | 1,570,000.00 | 1,137,713.06 | |
| 1. 6 ITALY GOVT 260601 | 4,120,000.00 | 3,997,765.28 | |
| 1. 6 SPAIN GOVT 250430 | 3,510,000.00 | 3,445,057.98 | |
| 1. 65 ITALY GOVT 301201 | 3,870,000.00 | 3,453,231.96 | |
| 1. 65 ITALY GOVT 320301 | 4,450,000.00 | 3,864,193.10 | |
| 1. 7 BEL GOVT 500622 | 1,840,000.00 | 1,315,009.36 | |
| 1. 7 BUND 320815 | 4,350,000.00 | 4,184,234.55 | |
| 1. 7 IRISH GOVT 370515 | 1,190,000.00 | 1,039,750.60 | |
| 1. 7 ITALY GOVT 510901 | 2,390,000.00 | 1,428,436.29 | |
| 1. 75 O. A. T 390625 | 5,470,000.00 | 4,610,345.74 | |

| | | | |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 1.75 O.A.T 660525 | 2,590,000.00 | 1,755,476.10 | |
| 1.8 BUND 530815 | 4,060,000.00 | 3,479,383.46 | |
| 1.8 BUND 530815 | 1,000,000.00 | 858,580.00 | |
| 1.8 ITALY GOVT 410301 | 2,640,000.00 | 1,875,535.20 | |
| 1.85 AUSTRIA GOVT 490523 | 870,000.00 | 681,898.17 | |
| 1.85 ITALY GOVT 250701 | 2,400,000.00 | 2,357,493.60 | |
| 1.85 SPAIN GOVT 350730 | 3,510,000.00 | 3,021,818.67 | |
| 1.9 BEL GOVT 380622 | 1,360,000.00 | 1,169,938.36 | |
| 1.9 SPAIN GOVT 521031 | 2,920,000.00 | 1,932,923.20 | |
| 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 3,520,000.00 | 3,455,400.96 | |
| 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 3,790,000.00 | 3,582,838.60 | |
| 2 AUSTRIA GOVT 260715 | 1,000,000.00 | 986,200.00 | |
| 2 IRISH GOVT 450218 | 1,640,000.00 | 1,379,659.84 | |
| 2 ITALY GOVT 251201 | 3,530,000.00 | 3,468,150.87 | |
| 2 ITALY GOVT 280201 | 3,880,000.00 | 3,732,536.72 | |
| 2 NETH GOVT 540115 | 1,310,000.00 | 1,123,642.02 | |
| 2 O.A.T 321125 | 7,450,000.00 | 7,052,251.95 | |
| 2 O.A.T 480525 | 4,650,000.00 | 3,688,677.60 | |
| 2.05 ITALY GOVT 270801 | 2,650,000.00 | 2,569,638.75 | |
| 2.1 AUSTRIA GOVT 170920 | 950,000.00 | 702,711.20 | |
| 2.1 BUND 291115 | 3,800,000.00 | 3,785,233.20 | |
| 2.1 ITALY GOVT 260715 | 2,350,000.00 | 2,304,619.15 | |
| 2.15 BEL GOVT 660622 | 1,530,000.00 | 1,149,403.32 | |
| 2.15 ITALY GOVT 520901 | 1,550,000.00 | 1,009,852.90 | |
| 2.15 ITALY GOVT 720301 | 850,000.00 | 507,146.83 | |
| 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 6,000,000.00 | 5,928,915.54 | |
| 2.2 ITALY GOVT 270601 | 2,000,000.00 | 1,952,460.00 | |
| 2.2 OBL 280413 | 4,250,000.00 | 4,249,532.50 | |
| 2.25 BEL GOVT 570622 | 1,020,000.00 | 798,083.70 | |
| 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2,720,000.00 | 2,254,561.76 | |
| 2.3 BUND 330215 | 5,650,000.00 | 5,686,549.85 | |
| 2.3 BUND 330215 | 950,000.00 | 956,465.70 | |
| 2.35 SPAIN GOVT 330730 | 3,110,000.00 | 2,908,608.84 | |
| 2.4 AUSTRIA GOVT 340523 | 1,300,000.00 | 1,250,769.00 | |
| 2.4 BUND 301115 | 2,580,000.00 | 2,614,308.84 | |
| 2.4 IRISH GOVT 300515 | 1,490,000.00 | 1,486,276.49 | |

| | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| 2.4 OBL 281019 | 4,820,000.00 | 4,864,869.38 | |
| 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2,870,000.00 | 2,585,301.74 | |
| 2.45 ITALY GOVT 500901 | 2,490,000.00 | 1,776,059.73 | |
| 2.5 BUND 440704 | 4,730,000.00 | 4,709,353.55 | |
| 2.5 BUND 460815 | 4,950,000.00 | 4,942,842.30 | |
| 2.5 ITALY GOVT 251115 | 2,330,000.00 | 2,310,861.38 | |
| 2.5 ITALY GOVT 321201 | 2,850,000.00 | 2,611,050.30 | |
| 2.5 NETH GOVT 300115 | 600,000.00 | 602,539.20 | |
| 2.5 NETH GOVT 330115 | 2,750,000.00 | 2,745,866.75 | |
| 2.5 NETH GOVT 330715 | 1,650,000.00 | 1,641,585.00 | |
| 2.5 O.A.T 260924 | 7,300,000.00 | 7,288,035.30 | |
| 2.5 O.A.T 300525 | 9,590,000.00 | 9,577,535.58 | |
| 2.5 O.A.T 430525 | 2,110,000.00 | 1,897,660.15 | |
| 2.5 SCHATS 250313 | 1,000,000.00 | 994,047.33 | |
| 2.55 SPAIN GOVT 321031 | 4,190,000.00 | 4,021,264.51 | |
| 2.6 BUND 330815 | 4,310,000.00 | 4,437,515.66 | |
| 2.625 FINNISH GOV 420704 | 940,000.00 | 884,865.24 | |
| 2.65 ITALY GOVT 271201 | 2,800,000.00 | 2,764,176.80 | |
| 2.7 ITALY GOVT 470301 | 3,300,000.00 | 2,552,909.70 | |
| 2.7 SPAIN GOVT 481031 | 2,910,000.00 | 2,412,252.26 | |
| 2.75 BEL GOVT 390422 | 950,000.00 | 904,821.80 | |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 1,110,000.00 | 1,121,610.60 | |
| 2.75 FINNISH GOVT 380415 | 680,000.00 | 658,476.15 | |
| 2.75 NETH GOVT 470115 | 3,320,000.00 | 3,340,426.63 | |
| 2.75 O.A.T 271025 | 10,320,000.00 | 10,414,624.08 | |
| 2.75 O.A.T 290225 | 5,250,000.00 | 5,308,500.75 | |
| 2.8 ITALY GOVT 281201 | 3,680,000.00 | 3,627,593.12 | |
| 2.8 ITALY GOVT 290615 | 3,200,000.00 | 3,131,283.20 | |
| 2.8 ITALY GOVT 670301 | 1,510,000.00 | 1,076,738.72 | |
| 2.8 SCHATS 250612 | 3,470,000.00 | 3,465,652.09 | |
| 2.8 SPAIN GOVT 260531 | 3,500,000.00 | 3,499,734.00 | |
| 2.875 FINNISH GOV 290415 | 600,000.00 | 609,274.80 | |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 290523 | 700,000.00 | 712,749.10 | |
| 2.9 AUSTRIA GOVT 330220 | 2,180,000.00 | 2,202,443.10 | |
| 2.9 SPAIN GOVT 461031 | 2,990,000.00 | 2,609,979.97 | |
| 2.95 ITALY GOVT 380901 | 2,380,000.00 | 2,079,037.93 | |

| | | | |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3 BEL GOVT 330622 | 2,750,000.00 | 2,793,848.75 | |
| 3 BEL GOVT 340622 | 2,050,000.00 | 2,073,640.60 | |
| 3 FINNISH GOVT 330915 | 920,000.00 | 937,459.29 | |
| 3 IRISH GOVT 431018 | 690,000.00 | 697,890.84 | |
| 3 ITALY GOVT 290801 | 3,400,000.00 | 3,360,645.00 | |
| 3 O. A. T 330525 | 5,500,000.00 | 5,621,275.00 | |
| 3 O. A. T 540525 | 3,450,000.00 | 3,244,785.02 | |
| 3.1 ITALY GOVT 400301 | 2,310,000.00 | 2,016,743.19 | |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 1,250,000.00 | 1,259,120.00 | |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 531020 | 500,000.00 | 501,840.00 | |
| 3.15 SPAIN GOVT 330430 | 3,500,000.00 | 3,501,636.60 | |
| 3.25 BUND 420704 | 3,120,000.00 | 3,447,715.44 | |
| 3.25 ITALY GOVT 380301 | 2,220,000.00 | 2,016,141.80 | |
| 3.25 ITALY GOVT 460901 | 2,740,000.00 | 2,336,751.46 | |
| 3.25 NETH GOVT 440115 | 500,000.00 | 537,861.50 | |
| 3.25 O. A. T 450525 | 4,710,000.00 | 4,740,322.98 | |
| 3.3 BEL GOVT 540622 | 1,690,000.00 | 1,657,683.82 | |
| 3.35 ITALY GOVT 350301 | 3,110,000.00 | 2,960,340.58 | |
| 3.4 ITALY GOVT 250328 | 2,300,000.00 | 2,303,033.24 | |
| 3.4 ITALY GOVT 280401 | 3,000,000.00 | 3,038,715.00 | |
| 3.45 AUSTRIA GOVT 301020 | 700,000.00 | 735,140.00 | |
| 3.45 BEL GOVT 430622 | 800,000.00 | 820,287.36 | |
| 3.45 ITALY GOVT 480301 | 2,820,000.00 | 2,472,389.88 | |
| 3.45 SPAIN GOVT 430730 | 1,800,000.00 | 1,729,229.40 | |
| 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 2,230,000.00 | 2,003,944.90 | |
| 3.5 ITALY GOVT 260115 | 2,500,000.00 | 2,523,987.50 | |
| 3.5 ITALY GOVT 300301 | 4,470,000.00 | 4,518,642.54 | |
| 3.5 O. A. T 260425 | 6,690,000.00 | 6,819,826.14 | |
| 3.5 O. A. T 331125 | 2,620,000.00 | 2,781,402.48 | |
| 3.5 SPAIN GOVT 290531 | 1,000,000.00 | 1,033,453.80 | |
| 3.55 SPAIN GOVT 331031 | 3,690,000.00 | 3,798,807.03 | |
| 3.6 ITALY GOVT 250929 | 2,000,000.00 | 2,016,608.20 | |
| 3.7 ITALY GOVT 300615 | 2,350,000.00 | 2,392,925.10 | |
| 3.75 BEL GOVT 450622 | 1,620,000.00 | 1,737,121.14 | |
| 3.75 NETH GOVT 420115 | 2,940,000.00 | 3,348,953.41 | |
| 3.8 AUSTRIA GOVT 620126 | 700,000.00 | 802,956.70 | |

| | | | |
|---------------------------|-----------------|-----------------|--|
| 3. 8 ITALY GOVT 260415 | 2, 700, 000. 00 | 2, 748, 667. 50 | |
| 3. 8 ITALY GOVT 280801 | 3, 090, 000. 00 | 3, 178, 729. 35 | |
| 3. 85 ITALY GOVT 260915 | 1, 450, 000. 00 | 1, 482, 916. 45 | |
| 3. 85 ITALY GOVT 291215 | 2, 600, 000. 00 | 2, 674, 240. 40 | |
| 3. 85 ITALY GOVT 490901 | 2, 180, 000. 00 | 2, 024, 039. 31 | |
| 3. 9 SPAIN GOVT 390730 | 1, 670, 000. 00 | 1, 726, 091. 29 | |
| 4 BEL GOVT 320328 | 1, 250, 000. 00 | 1, 368, 353. 75 | |
| 4 BUND 370104 | 4, 440, 000. 00 | 5, 209, 505. 28 | |
| 4 FINNISH GOVT 250704 | 240, 000. 00 | 243, 766. 03 | |
| 4 ITALY GOVT 301115 | 2, 220, 000. 00 | 2, 297, 108. 14 | |
| 4 ITALY GOVT 311030 | 1, 650, 000. 00 | 1, 705, 365. 75 | |
| 4 ITALY GOVT 350430 | 2, 150, 000. 00 | 2, 173, 452. 20 | |
| 4 ITALY GOVT 370201 | 4, 950, 000. 00 | 4, 960, 132. 65 | |
| 4 NETH GOVT 370115 | 3, 160, 000. 00 | 3, 599, 248. 21 | |
| 4 O. A. T 381025 | 4, 020, 000. 00 | 4, 480, 539. 24 | |
| 4 O. A. T 550425 | 3, 090, 000. 00 | 3, 503, 976. 57 | |
| 4 O. A. T 600425 | 3, 180, 000. 00 | 3, 654, 454. 40 | |
| 4. 1 ITALY GOVT 290201 | 2, 230, 000. 00 | 2, 322, 879. 50 | |
| 4. 15 AUSTRIA GOVT 370315 | 2, 540, 000. 00 | 2, 851, 724. 04 | |
| 4. 2 ITALY GOVT 340301 | 1, 680, 000. 00 | 1, 738, 623. 60 | |
| 4. 2 SPAIN GOVT 370131 | 3, 460, 000. 00 | 3, 744, 152. 84 | |
| 4. 25 BEL GOVT 410328 | 2, 380, 000. 00 | 2, 708, 697. 04 | |
| 4. 25 BUND 390704 | 3, 010, 000. 00 | 3, 679, 424. 00 | |
| 4. 35 ITALY GOVT 331101 | 3, 270, 000. 00 | 3, 432, 486. 30 | |
| 4. 4 ITALY GOVT 330501 | 3, 800, 000. 00 | 4, 015, 395. 40 | |
| 4. 45 ITALY GOVT 430901 | 1, 450, 000. 00 | 1, 476, 404. 50 | |
| 4. 5 BEL GOVT 260328 | 1, 610, 000. 00 | 1, 672, 064. 21 | |
| 4. 5 ITALY GOVT 260301 | 3, 740, 000. 00 | 3, 854, 268. 22 | |
| 4. 5 ITALY GOVT 531001 | 1, 530, 000. 00 | 1, 548, 852. 66 | |
| 4. 5 O. A. T 410425 | 6, 030, 000. 00 | 7, 133, 894. 01 | |
| 4. 65 SPAIN GOVT 250730 | 2, 890, 000. 00 | 2, 958, 863. 49 | |
| 4. 7 SPAIN GOVT 410730 | 3, 300, 000. 00 | 3, 752, 040. 93 | |
| 4. 75 BUND 280704 | 2, 340, 000. 00 | 2, 589, 882. 75 | |
| 4. 75 BUND 340704 | 4, 170, 000. 00 | 5, 105, 748. 00 | |
| 4. 75 BUND 400704 | 3, 230, 000. 00 | 4, 197, 821. 05 | |
| 4. 75 ITALY GOVT 280901 | 3, 930, 000. 00 | 4, 201, 747. 71 | |

| | | | | |
|-------|--------------------------|------------------|---------------------------------------|--|
| | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 2,900,000.00 | 3,072,732.70 | |
| | 4.75 O.A.T 350425 | 4,900,000.00 | 5,774,194.30 | |
| | 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 1,370,000.00 | 1,430,985.55 | |
| | 4.9 SPAIN GOVT 400730 | 3,310,000.00 | 3,825,956.18 | |
| | 5 BEL GOVT 350328 | 2,950,000.00 | 3,523,249.31 | |
| | 5 ITALY GOVT 250301 | 4,280,000.00 | 4,355,670.40 | |
| | 5 ITALY GOVT 340801 | 3,850,000.00 | 4,239,523.75 | |
| | 5 ITALY GOVT 390801 | 3,980,000.00 | 4,347,155.00 | |
| | 5 ITALY GOVT 400901 | 3,600,000.00 | 3,935,385.36 | |
| | 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 3,250,000.00 | 3,593,222.75 | |
| | 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 2,640,000.00 | 3,183,808.32 | |
| | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 4,660,000.00 | 5,151,084.78 | |
| | 5.4 IRISH GOVT 250313 | 2,100,000.00 | 2,152,237.08 | |
| | 5.5 BEL GOVT 280328 | 3,380,000.00 | 3,779,745.84 | |
| | 5.5 BUND 310104 | 4,280,000.00 | 5,189,196.12 | |
| | 5.5 NETH GOVT 280115 | 2,180,000.00 | 2,431,726.78 | |
| | 5.5 O.A.T 290425 | 6,800,000.00 | 7,777,207.60 | |
| | 5.625 BUND 280104 | 2,540,000.00 | 2,862,319.90 | |
| | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 3,820,000.00 | 4,426,799.36 | |
| | 5.75 O.A.T 321025 | 5,490,000.00 | 6,776,526.60 | |
| | 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 3,980,000.00 | 4,782,268.50 | |
| | 5.9 SPAIN GOVT 260730 | 4,650,000.00 | 4,994,000.49 | |
| | 6 ITALY GOVT 310501 | 5,030,000.00 | 5,862,314.10 | |
| | 6 O.A.T 251025 | 5,760,000.00 | 6,070,988.16 | |
| | 6 SPAIN GOVT 290131 | 4,230,000.00 | 4,861,604.56 | |
| | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 1,630,000.00 | 1,827,960.24 | |
| | 6.25 BUND 300104 | 1,700,000.00 | 2,081,426.79 | |
| | 6.5 BUND 270704 | 1,750,000.00 | 1,990,886.97 | |
| | 6.5 ITALY GOVT 271101 | 3,900,000.00 | 4,383,221.70 | |
| | 7.25 ITALY GOVT 261101 | 2,300,000.00 | 2,561,719.30 | |
| ユーロ合計 | | 1,136,870,000.00 | 1,062,846,365.83 (170,236,102,414) | |
| 合計 | | | 521,627,234,978 (521,627,234,978) | |

(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 269 銘柄 | 100.00% | 47.24% |
| カナダドル | 国債証券 40 銘柄 | 100.00% | 2.03% |
| オーストラリアドル | 国債証券 27 銘柄 | 100.00% | 1.36% |
| イギリスポンド | 国債証券 59 銘柄 | 100.00% | 5.23% |
| シンガポールドル | 国債証券 19 銘柄 | 100.00% | 0.42% |
| マレーシアリングgit | 国債証券 28 銘柄 | 100.00% | 0.51% |
| ニュージーランドドル | 国債証券 10 銘柄 | 100.00% | 0.23% |
| スウェーデンクローネ | 国債証券 8 銘柄 | 100.00% | 0.20% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 10 銘柄 | 100.00% | 0.16% |
| デンマーククローネ | 国債証券 7 銘柄 | 100.00% | 0.27% |
| メキシコペソ | 国債証券 16 銘柄 | 100.00% | 0.86% |
| イスラエルシェケル | 国債証券 10 銘柄 | 100.00% | 0.29% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 13 銘柄 | 100.00% | 0.51% |
| 中国元 | 国債証券 75 銘柄 | 100.00% | 8.04% |
| ユーロ | 国債証券 366 銘柄 | 100.00% | 32.64% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

| 資産の部 | |
|----------|----------------|
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,916,851,441 |
| コール・ローン | 34,625,300 |
| 国債証券 | 84,312,998,200 |
| 派生商品評価勘定 | 435,651 |
| 未収入金 | 194,897,024 |
| 未収利息 | 1,238,196,857 |
| 前払費用 | 116,021,982 |
| 流動資産合計 | 87,814,026,455 |
| 資産合計 | 87,814,026,455 |
| 負債の部 | |

| | |
|-------------|----------------|
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 450,202 |
| 前受収益 | 188,001 |
| 未払金 | 3,894,125 |
| 未払解約金 | 65,300,606 |
| 未払利息 | 8 |
| 流動負債合計 | 69,832,942 |
| 負債合計 | 69,832,942 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 49,510,869,131 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 38,233,324,382 |
| 元本等合計 | 87,744,193,513 |
| 純資産合計 | 87,744,193,513 |
| 負債純資産合計 | 87,814,026,455 |

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1月26日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首 | 2023年1月27日 |
| 期首元本額 | 43,842,059,667円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,525,241,433円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,856,431,969円 |
| 元本の内訳※ | |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 3,418,521,516円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 305,210,639円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 1,185,760,687円 |
| 海外債券セレクション(ラップ向け) | 521,700,608円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 17,019,451,149円 |
| つみたて8資産均等バランス | 8,379,537,851円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,520,803円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 3,834,032円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 1,617,811円 |
| ラップ向けインデックスf 新興国債券 | 2,179,237,577円 |
| eMAXIS 新興国債券インデックス | 3,108,700,752円 |
| 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド | 12,067,881,762円 |

| | |
|----------------------------------|------------------|
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 90,816,773 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 540,095,515 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 429,232,924 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 204,942,771 円 |
| アドバンスト・バランスⅠ (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 6,099,084 円 |
| アドバンスト・バランスⅡ (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 10,364,781 円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 36,342,096 円 |
| 合計 | 49,510,869,131 円 |
| 2. 受益権の総数 | 49,510,869,131 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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 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 1 月 26 日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年 1月 26日現在] | |
|------|---------------------|--|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額 (円) | |
| 国債証券 | 1,571,642,902 | |
| 合計 | 1,571,642,902 | |

(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 1月 26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|-------------|------------|-------------|------------|----------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカドル | 81,465,841 | — | 81,048,869 | △416,972 |
| | メキシコペソ | 17,155,000 | — | 17,150,600 | △4,400 |
| | ハンガリーフォリント | 6,238,365 | — | 6,230,790 | △7,575 |
| | ポーランドズロチ | 10,977,240 | — | 10,974,330 | △2,910 |
| | 南アフリカランド | 4,687,800 | — | 4,687,380 | △420 |
| | 売建 | | | | |
| | メキシコペソ | 12,850,500 | — | 12,867,450 | △16,950 |
| | チリペソ | 31,668,981 | — | 31,660,592 | 8,389 |
| | チェココルナ | 9,706,050 | — | 9,706,800 | △750 |
| | コロンビアペソ | 49,796,860 | — | 49,403,678 | 393,182 |
| | ポーランドズロチ | 11,010,420 | — | 10,976,340 | 34,080 |
| | 南アフリカランド | 3,906,875 | — | 3,907,100 | △225 |
| 合計 | 239,463,932 | — | 238,613,929 | △14,551 | |

(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1月26日現在] |
|---------------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.7722円 (17,722円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------------------|--------------|--------------------------|----------------|-----------------------------------|----|
| マレーシア リング ット | 国債証券 | 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 21,700,000.00 | 20,180,490.91 | |
| | | 3.502MALAYSIAGOV 270531 | 14,600,000.00 | 14,599,790.78 | |
| | | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 14,700,000.00 | 14,398,255.45 | |
| | | 3.733 MALAYSIAGO 280615 | 11,450,000.00 | 11,500,595.26 | |
| | | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 13,700,000.00 | 13,185,384.02 | |
| | | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 11,570,000.00 | 11,540,556.08 | |
| | | 3.882 MALAYSIAGOV 250314 | 8,400,000.00 | 8,456,091.84 | |
| | | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 25,550,000.00 | 25,830,462.35 | |
| | | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 13,200,000.00 | 13,357,408.68 | |
| | | 3.9 MALAYSIAGOV 261130 | 10,720,000.00 | 10,847,141.34 | |
| | | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 19,100,000.00 | 19,320,142.78 | |
| | | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 25,600,000.00 | 25,819,486.72 | |
| | | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 9,400,000.00 | 9,149,476.93 | |
| | | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 9,550,000.00 | 9,803,600.25 | |
| | | 4.369 MALAYSIA IN 281031 | 12,800,000.00 | 13,210,636.80 | |
| | | 4.457 MALAYSIAGOV 530331 | 3,400,000.00 | 3,528,483.28 | |
| | | 4.504 MALAYSIAGOV 290430 | 2,800,000.00 | 2,913,326.08 | |
| | | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 14,740,000.00 | 15,889,450.25 | |
| | | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 12,400,000.00 | 13,346,082.80 | |
| 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 8,200,000.00 | 9,003,348.26 | | | |
| 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 6,100,000.00 | 6,744,129.50 | | | |
| マレーシアリングット合計 | | | 269,680,000.00 | 272,624,340.36 (8,496,010,418) | |

| | | | | | |
|-----------------------|---------------|---------------------------|-------------------|-------------------|-----------------|
| タイバーツ | 国債証券 | 0.75 THAILAND 240917 | 51,300,000.00 | 50,787,729.48 | |
| | | 0.95 THAILAND 250617 | 89,000,000.00 | 87,371,402.35 | |
| | | 1 THAILAND 270617 | 114,200,000.00 | 109,229,499.81 | |
| | | 1.45 THAILAND 241217 | 120,600,000.00 | 119,656,172.34 | |
| | | 1.585 THAILAND 351217 | 78,900,000.00 | 69,521,956.25 | |
| | | 1.6 THAILAND 291217 | 90,700,000.00 | 86,364,875.59 | |
| | | 1.6 THAILAND 350617 | 38,200,000.00 | 33,966,465.13 | |
| | | 2 THAILAND 311217 | 127,900,000.00 | 122,346,305.73 | |
| | | 2 THAILAND 420617 | 57,500,000.00 | 49,027,812.57 | |
| | | 2.125 THAILAND 261217 | 96,300,000.00 | 95,754,019.44 | |
| | | 2.25 THAILAND 270317 | 45,800,000.00 | 45,680,598.02 | |
| | | 2.35 THAILAND 260617 | 95,300,000.00 | 95,380,919.23 | |
| | | 2.4 THAILAND 290317 | 38,000,000.00 | 37,936,581.04 | |
| | | 2.65 THAILAND 280617 | 98,600,000.00 | 99,633,101.22 | |
| | | 2.875 THAILAND 281217 | 84,900,000.00 | 86,703,997.65 | |
| | | 2.875 THAILAND 460617 | 67,200,000.00 | 62,004,973.63 | |
| | | 3.3 THAILAND 380617 | 97,000,000.00 | 101,761,642.70 | |
| | | 3.35 THAILAND 330617 | 88,800,000.00 | 93,473,117.76 | |
| | | 3.39 THAILAND 370617 | 72,900,000.00 | 77,231,331.63 | |
| | | 3.4 THAILAND 360617 | 74,000,000.00 | 78,150,993.00 | |
| 3.45 THAILAND 430617 | 61,300,000.00 | 64,329,844.45 | | | |
| 3.65 THAILAND 310620 | 78,100,000.00 | 83,903,353.27 | | | |
| 3.775 THAILAND 320625 | 88,600,000.00 | 96,191,221.42 | | | |
| 3.85 THAILAND 251212 | 74,700,000.00 | 76,778,221.23 | | | |
| 4.875 THAILAND 290622 | 76,300,000.00 | 85,618,045.94 | | | |
| タイバーツ合計 | | | 2,006,100,000.00 | 2,008,804,180.88 | (8,316,449,308) |
| フィリピンペソ | 国債証券 | 6.25 PHILIPPI (GL) 360114 | 20,000,000.00 | 18,790,990.00 | |
| フィリピンペソ合計 | | | 20,000,000.00 | 18,790,990.00 | (49,074,549) |
| インドネシアルピア | 国債証券 | 10.5 INDONESIA 300815 | 7,050,000,000.00 | 8,520,344,475.00 | |
| | | 11 INDONESIA 250915 | 8,250,000,000.00 | 8,842,395,375.00 | |
| | | 5.125 INDONESIA 270415 | 31,300,000,000.00 | 30,244,003,417.00 | |
| | | 5.5 INDONESIA 260415 | 44,700,000,000.00 | 44,110,236,246.00 | |
| | | 6.125 INDONESIA 280515 | 29,000,000,000.00 | 28,733,610,060.00 | |

| | | | | | |
|------------|------|---------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|
| | | 6. 25 INDONESIA 360615 | 12,000,000,000.00 | 11,613,626,400.00 | |
| | | 6. 375 INDONESIA 280815 | 25,000,000,000.00 | 24,911,999,000.00 | |
| | | 6. 375 INDONESIA 320415 | 48,200,000,000.00 | 47,564,546,624.00 | |
| | | 6. 375 INDONESIA 370715 | 4,000,000,000.00 | 3,922,448,520.00 | |
| | | 6. 5 INDONESIA 250615 | 29,900,000,000.00 | 29,962,790,000.00 | |
| | | 6. 5 INDONESIA 310215 | 47,600,000,000.00 | 47,072,019,372.00 | |
| | | 6. 625 INDONESIA 330515 | 24,400,000,000.00 | 24,278,000,000.00 | |
| | | 6. 625 INDONESIA 340215 | 11,500,000,000.00 | 11,500,460,000.00 | |
| | | 6. 875 INDONESIA 290415 | 9,000,000,000.00 | 9,144,180,000.00 | |
| | | 7 INDONESIA 270515 | 32,450,000,000.00 | 33,119,242,310.00 | |
| | | 7 INDONESIA 300915 | 44,700,000,000.00 | 45,797,358,180.00 | |
| | | 7 INDONESIA 330215 | 41,100,000,000.00 | 42,214,722,420.00 | |
| | | 7. 125 INDONESIA 380615 | 13,700,000,000.00 | 14,175,253,000.00 | |
| | | 7. 125 INDONESIA 420615 | 30,600,000,000.00 | 31,303,800,000.00 | |
| | | 7. 125 INDONESIA 430615 | 13,500,000,000.00 | 13,828,252,500.00 | |
| | | 7. 5 INDONESIA 320815 | 8,400,000,000.00 | 8,823,564,960.00 | |
| | | 7. 5 INDONESIA 350615 | 44,800,000,000.00 | 47,663,280,000.00 | |
| | | 7. 5 INDONESIA 380515 | 23,200,000,000.00 | 24,687,952,880.00 | |
| | | 7. 5 INDONESIA 400415 | 29,400,000,000.00 | 31,202,937,360.00 | |
| | | 8. 25 INDONESIA 290515 | 35,200,000,000.00 | 37,993,996,480.00 | |
| | | 8. 25 INDONESIA 320615 | 19,000,000,000.00 | 20,845,281,900.00 | |
| | | 8. 25 INDONESIA 360515 | 26,600,000,000.00 | 29,966,855,100.00 | |
| | | 8. 375 INDONESIA 260915 | 38,930,000,000.00 | 40,895,237,009.00 | |
| | | 8. 375 INDONESIA 340315 | 46,700,000,000.00 | 52,586,007,290.00 | |
| | | 8. 375 INDONESIA 390415 | 23,200,000,000.00 | 26,529,220,880.00 | |
| | | 8. 75 INDONESIA 310515 | 18,400,000,000.00 | 20,638,838,400.00 | |
| | | 9 INDONESIA 290315 | 24,600,000,000.00 | 27,261,970,920.00 | |
| | | 9. 5 INDONESIA 310715 | 15,700,000,000.00 | 18,336,621,890.00 | |
| | | インドネシアルピア合計 | 862,080,000,000.00 | 898,291,052,968.00 (8,443,935,897) | |
| メキシコ ペソ | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205 | 68,700,000.00 | 68,301,904.79 | |
| | | 10 MEXICAN BONOS 361120 | 15,700,000.00 | 16,601,808.00 | |
| | | 5 MEXICAN BONOS 250306 | 56,000,000.00 | 53,299,680.00 | |
| | | 5. 5 MEXICAN BONOS 270304 | 86,200,000.00 | 77,147,276.00 | |
| | | 5. 75 MEXICAN BONO 260305 | 120,200,000.00 | 111,021,875.37 | |
| | | 7 MEXICAN BONOS 260903 | 27,000,000.00 | 25,332,210.00 | |

| | | | | | |
|-------------|------|---------------------------|------------------|------------------|-----------------|
| | | 7. 5 MEXICAN BONOS 270603 | 98,200,000.00 | 93,032,716.00 | |
| | | 7. 5 MEXICAN BONOS 330526 | 68,800,000.00 | 61,343,456.00 | |
| | | 7. 75 MEXICAN BONO 310529 | 108,500,000.00 | 100,118,375.00 | |
| | | 7. 75 MEXICAN BONO 341123 | 24,400,000.00 | 21,874,356.00 | |
| | | 7. 75 MEXICAN BONO 421113 | 81,600,000.00 | 69,936,912.00 | |
| | | 8 MEXICAN BONOS 240905 | 24,000,000.00 | 23,535,285.12 | |
| | | 8 MEXICAN BONOS 350524 | 10,000,000.00 | 9,122,352.70 | |
| | | 8 MEXICAN BONOS 471107 | 66,400,000.00 | 57,789,248.00 | |
| | | 8 MEXICAN BONOS 530731 | 51,200,000.00 | 44,066,304.00 | |
| | | 8. 5 MEXICAN BONOS 290301 | 22,000,000.00 | 21,359,140.00 | |
| | | 8. 5 MEXICAN BONOS 290531 | 75,100,000.00 | 73,193,211.00 | |
| | | 8. 5 MEXICAN BONOS 381118 | 57,500,000.00 | 53,728,000.00 | |
| メキシコペソ合計 | | | 1,061,500,000.00 | 980,804,109.98 | (8,422,655,294) |
| ブラジル リアル | 国債証券 | 10 (IN)BRAZIL NT 270101 | 40,270,000.00 | 40,609,323.87 | |
| | | 10 (IN)BRAZIL NTN 250101 | 30,900,000.00 | 31,069,805.38 | |
| | | 10 (IN)BRAZIL NTN 310101 | 12,600,000.00 | 12,378,378.60 | |
| | | 10 (IN)BRAZIL NTN 330101 | 20,700,000.00 | 20,191,557.07 | |
| | | 10(IN) BRAZIL NTN 290101 | 42,300,000.00 | 42,164,193.73 | |
| | | BRAZIL-LTN 250701 | 33,300,000.00 | 29,156,951.49 | |
| | | BRAZIL-LTN 260101 | 52,700,000.00 | 44,027,018.16 | |
| | | BRAZIL-LTN 260701 | 61,800,000.00 | 49,247,721.02 | |
| | | BRAZIL-LTN 270701 | 29,200,000.00 | 21,027,180.73 | |
| ブラジルリアル合計 | | | 323,770,000.00 | 289,872,130.05 | (8,699,932,239) |
| チリペソ | 国債証券 | 2. 3 BONOS TESORER 281001 | 480,000,000.00 | 426,360,000.00 | |
| | | 2. 5 BONOS TESORER 250301 | 1,860,000,000.00 | 1,817,127,000.00 | |
| | | 4. 5 BONOS TESORER 260301 | 1,420,000,000.00 | 1,427,455,000.00 | |
| | | 4. 7 BONOS TESORER 300901 | 1,570,000,000.00 | 1,544,016,500.00 | |
| | | 5 BONOS TESORERIA 281001 | 410,000,000.00 | 411,156,909.00 | |
| | | 5 BONOS TESORERIA 350301 | 1,470,000,000.00 | 1,445,018,202.00 | |
| | | 6 BONOS TESORERIA 330401 | 950,000,000.00 | 1,010,712,457.00 | |
| | | 6 BONOS TESORERIA 430101 | 1,315,000,000.00 | 1,424,342,250.00 | |
| | | 7 BONOS TESORERIA 340501 | 350,000,000.00 | 398,982,650.00 | |
| チリペソ合計 | | | 9,825,000,000.00 | 9,905,170,968.00 | (1,607,361,618) |

| | | | | | |
|--------------------------|--------------|--------------------------|--------------------|--------------------|-----------------|
| チェコ コ ル ナ | 国債証券 | 0.05 CZECH REPUBL 291129 | 83,000,000.00 | 66,888,704.00 | |
| | | 0.25 CZECH REPUBL 270210 | 143,500,000.00 | 128,822,820.00 | |
| | | 1.5 CZECH REPUBLI 400424 | 20,500,000.00 | 14,391,000.00 | |
| | | 1.75 CZECH REPUBL 320623 | 119,200,000.00 | 101,267,552.00 | |
| | | 1.95 CZECH REPUBL 370730 | 24,300,000.00 | 19,183,878.00 | |
| | | 3.5 CZECH REPUBLI 350530 | 81,500,000.00 | 78,158,500.00 | |
| | | 4.5 CZECH REPUBLI 321111 | 21,000,000.00 | 21,897,750.00 | |
| | | 4.9 CZECH REPUBLI 340414 | 32,000,000.00 | 34,561,600.00 | |
| | | 5 CZECH REPUBLIC 300930 | 79,700,000.00 | 84,992,877.00 | |
| | | 5.5 CZECH REPUBLI 281212 | 108,000,000.00 | 116,316,000.00 | |
| | | 6 CZECH REPUBLIC 260226 | 138,500,000.00 | 144,923,353.00 | |
| 6.2 CZECH REPUBLI 310616 | 5,000,000.00 | 5,768,000.00 | | | |
| チェココルナ合計 | | | 856,200,000.00 | 817,172,034.00 | (5,291,270,637) |
| コロンビ アペソ | 国債証券 | 13.25 TITULOS DE 330209 | 7,900,000,000.00 | 9,535,673,749.00 | |
| | | 5.75 TITULOS DE T 271103 | 6,900,000,000.00 | 6,203,379,036.00 | |
| | | 6 TITULOS DE TESO 280428 | 11,980,000,000.00 | 10,729,133,098.60 | |
| | | 6.25 TITULOS DE T 251126 | 6,690,000,000.00 | 6,428,670,871.50 | |
| | | 6.25 TITULOS DE T 360709 | 4,900,000,000.00 | 3,669,331,925.00 | |
| | | 7 TITULOS DE TESO 310326 | 12,080,000,000.00 | 10,662,043,801.60 | |
| | | 7 TITULOS DE TESO 320630 | 11,700,000,000.00 | 10,020,114,936.00 | |
| | | 7.25 TITULOS DE T 341018 | 10,000,000,000.00 | 8,419,269,300.00 | |
| | | 7.25 TITULOS DE T 501026 | 9,400,000,000.00 | 7,008,575,892.00 | |
| | | 7.5 TITULOS DE TE 260826 | 11,120,000,000.00 | 10,751,066,533.60 | |
| | | 7.75 TITULOS DE T 300918 | 8,340,000,000.00 | 7,754,790,790.20 | |
| | | 9.25 TITULOS DE T 420528 | 12,100,000,000.00 | 11,200,835,206.00 | |
| コロンビアペソ合計 | | | 113,110,000,000.00 | 102,382,885,139.50 | (3,833,624,751) |
| ハンガリ ーフォリ ント | 国債証券 | 1 HUNGARY 251126 | 427,000,000.00 | 392,248,092.60 | |
| | | 1.5 HUNGARY 260422 | 560,000,000.00 | 511,196,000.00 | |
| | | 1.5 HUNGARY 260826 | 270,000,000.00 | 241,683,750.00 | |
| | | 2 HUNGARY 290523 | 330,000,000.00 | 274,543,500.00 | |
| | | 2.25 HUNGARY 330420 | 505,000,000.00 | 376,277,722.00 | |
| | | 2.25 HUNGARY 340622 | 150,000,000.00 | 108,870,300.00 | |
| | | 2.5 HUNGARY 241024 | 290,000,000.00 | 281,453,642.00 | |
| | | 2.75 HUNGARY 261222 | 373,000,000.00 | 341,340,021.10 | |

| | | | | | |
|---------------|------|---------------------|------------------|------------------|-----------------|
| | | 3 HUNGARY 271027 | 541,000,000.00 | 491,868,760.40 | |
| | | 3 HUNGARY 300821 | 518,000,000.00 | 440,245,195.60 | |
| | | 3 HUNGARY 381027 | 392,000,000.00 | 271,885,280.80 | |
| | | 3 HUNGARY 410425 | 205,000,000.00 | 136,058,500.00 | |
| | | 3.25 HUNGARY 311022 | 618,000,000.00 | 520,870,299.60 | |
| | | 4.5 HUNGARY 280323 | 360,000,000.00 | 343,131,120.00 | |
| | | 4.75 HUNGARY 321124 | 440,000,000.00 | 405,064,167.20 | |
| | | 5.5 HUNGARY 250624 | 492,000,000.00 | 489,581,918.40 | |
| | | 6.75 HUNGARY 281022 | 582,000,000.00 | 603,613,792.20 | |
| | | 9.5 HUNGARY 261021 | 180,000,000.00 | 194,978,232.00 | |
| ハンガリーフォロント合計 | | | 7,233,000,000.00 | 6,424,910,293.90 | (2,672,062,367) |
| ペルーヌ エボソル | 国債証券 | 5.35 PERU 400812 | 3,250,000.00 | 2,784,805.69 | |
| | | 5.4 PERU 340812 | 5,200,000.00 | 4,716,694.32 | |
| | | 5.94 PERU 290212 | 6,600,000.00 | 6,728,965.78 | |
| | | 6.15 PERU 320812 | 6,900,000.00 | 6,783,228.19 | |
| | | 6.35 PERU 280812 | 4,900,000.00 | 5,105,919.02 | |
| | | 6.9 PERU 370812 | 7,000,000.00 | 7,039,493.16 | |
| | | 6.95 PERU 310812 | 6,800,000.00 | 7,098,976.75 | |
| | | 7.3 PERU 330812 | 6,400,000.00 | 6,740,675.45 | |
| | | 8.2 PERU 260812 | 3,000,000.00 | 3,216,326.58 | |
| ペルーヌエボソル合計 | | | 50,050,000.00 | 50,215,084.94 | (1,968,325,877) |
| ポーランド ドズロチ | 国債証券 | 0 POLAND 251025 | 10,700,000.00 | 9,849,981.39 | |
| | | 0.25 POLAND 261025 | 12,200,000.00 | 10,750,542.40 | |
| | | 0.75 POLAND 250425 | 12,500,000.00 | 11,876,875.00 | |
| | | 1.25 POLAND 301025 | 15,100,000.00 | 11,808,939.90 | |
| | | 1.75 POLAND 320425 | 14,100,000.00 | 10,853,136.60 | |
| | | 2.25 POLAND 241025 | 8,500,000.00 | 8,332,805.00 | |
| | | 2.5 POLAND 260725 | 17,000,000.00 | 16,027,991.00 | |
| | | 2.5 POLAND 270725 | 10,900,000.00 | 10,044,033.90 | |
| | | 2.75 POLAND 280425 | 14,750,000.00 | 13,467,649.75 | |
| | | 2.75 POLAND 291025 | 17,200,000.00 | 15,233,403.60 | |
| | | 3.25 POLAND 250725 | 14,500,000.00 | 14,135,557.00 | |
| | | 3.75 POLAND 270525 | 12,900,000.00 | 12,413,876.40 | |
| | | 6 POLAND 331025 | 12,500,000.00 | 13,087,825.00 | |

| | | | | | |
|--------------|------|--------------------------|------------------|-----------------------------------|--|
| | | 7.5 POLAND 280725 | 17,000,000.00 | 18,577,659.50 | |
| ポーランドズロチ合計 | | | 189,850,000.00 | 176,460,276.44 (6,459,822,507) | |
| 南アフリ カランド | 国債証券 | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 105,600,000.00 | 110,388,960.00 | |
| | | 11.625 SOUTH AFRI 530331 | 12,200,000.00 | 11,615,992.10 | |
| | | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 39,800,000.00 | 26,238,150.00 | |
| | | 6.5 SOUTH AFRICA 410228 | 35,300,000.00 | 21,326,495.00 | |
| | | 7 SOUTH AFRICA 310228 | 71,000,000.00 | 59,629,350.00 | |
| | | 8 SOUTH AFRICA 300131 | 135,300,000.00 | 125,003,670.00 | |
| | | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 120,700,000.00 | 105,389,205.00 | |
| | | 8.5 SOUTH AFRICA 370131 | 103,400,000.00 | 80,838,120.00 | |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 97,200,000.00 | 71,947,440.00 | |
| | | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 146,200,000.00 | 107,530,100.00 | |
| | | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 112,500,000.00 | 94,950,000.00 | |
| | | 9 SOUTH AFRICA 400131 | 88,900,000.00 | 69,386,450.00 | |
| 南アフリカランド合計 | | | 1,068,100,000.00 | 884,243,932.10 (6,914,787,549) | |
| ウルグアイ ペソ | 国債証券 | 8.25 URUGUAY 310521 | 17,000,000.00 | 16,150,666.74 | |
| | | 8.5 URUGUAY(GL) 280315 | 7,000,000.00 | 6,761,439.09 | |
| | | 9.75 URUGUAY 330720 | 17,000,000.00 | 17,552,500.00 | |
| ウルグアイペソ合計 | | | 41,000,000.00 | 40,464,605.83 (153,223,276) | |
| 中国元 | 国債証券 | 1.99 CHINA GOVT 250409 | 14,000,000.00 | 13,975,314.64 | |
| | | 2.18 CHINA GOVT 250825 | 3,000,000.00 | 2,999,433.69 | |
| | | 2.18 CHINA GOVT 260815 | 8,000,000.00 | 7,990,636.48 | |
| | | 2.24 CHINA GOVT 250525 | 3,000,000.00 | 3,002,873.10 | |
| | | 2.26 CHINA GOVT 250224 | 6,000,000.00 | 6,010,859.40 | |
| | | 2.28 CHINA GOVT 251125 | 4,000,000.00 | 4,006,997.60 | |
| | | 2.3 CHINA GOVT 260515 | 5,000,000.00 | 5,005,520.50 | |
| | | 2.37 CHINA GOVT 270120 | 8,000,000.00 | 8,025,675.20 | |
| | | 2.4 CHINA GOVT 280715 | 5,000,000.00 | 5,002,370.00 | |
| | | 2.44 CHINA GOVT 271015 | 5,000,000.00 | 5,018,624.50 | |
| | | 2.46 CHINA GOVT 260215 | 8,000,000.00 | 8,041,025.60 | |
| | | 2.48 CHINA GOVT 270415 | 5,000,000.00 | 5,020,897.00 | |
| | | 2.48 CHINA GOVT 280925 | 3,000,000.00 | 3,014,713.20 | |
| | | 2.5 CHINA GOVT 270725 | 7,000,000.00 | 7,039,258.10 | |

| | | | |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 2.52 CHINA GOVT 330825 | 9,000,000.00 | 8,985,137.76 | |
| 2.55 CHINA GOVT 281015 | 6,000,000.00 | 6,055,955.40 | |
| 2.6 CHINA GOVT 300915 | 7,000,000.00 | 7,051,919.00 | |
| 2.6 CHINA GOVT 320901 | 6,000,000.00 | 6,016,253.40 | |
| 2.62 CHINA GOVT 280415 | 7,000,000.00 | 7,084,623.70 | |
| 2.62 CHINA GOVT 290925 | 6,000,000.00 | 6,062,739.00 | |
| 2.62 CHINA GOVT 300625 | 5,000,000.00 | 5,040,303.50 | |
| 2.64 CHINA GOVT 280115 | 7,000,000.00 | 7,080,840.20 | |
| 2.67 CHINA GOVT 330525 | 8,000,000.00 | 8,077,725.60 | |
| 2.67 CHINA GOVT 331125 | 7,000,000.00 | 7,090,783.00 | |
| 2.68 CHINA GOVT 300521 | 16,000,000.00 | 16,194,305.60 | |
| 2.69 CHINA GOVT 260812 | 10,000,000.00 | 10,112,034.00 | |
| 2.69 CHINA GOVT 320815 | 7,000,000.00 | 7,074,574.50 | |
| 2.75 CHINA GOVT 290615 | 3,000,000.00 | 3,053,419.20 | |
| 2.75 CHINA GOVT 320217 | 7,000,000.00 | 7,117,208.70 | |
| 2.76 CHINA GOVT 320515 | 5,000,000.00 | 5,082,915.50 | |
| 2.79 CHINA GOVT 291215 | 4,000,000.00 | 4,076,497.60 | |
| 2.8 CHINA GOVT 290324 | 2,000,000.00 | 2,040,035.20 | |
| 2.8 CHINA GOVT 300325 | 4,000,000.00 | 4,074,566.00 | |
| 2.8 CHINA GOVT 321115 | 6,000,000.00 | 6,112,263.00 | |
| 2.85 CHINA GOVT 270604 | 12,000,000.00 | 12,214,293.60 | |
| 2.88 CHINA GOVT 330225 | 7,000,000.00 | 7,195,867.70 | |
| 2.89 CHINA GOVT 311118 | 5,000,000.00 | 5,136,295.00 | |
| 2.91 CHINA GOVT 281014 | 4,000,000.00 | 4,100,139.60 | |
| 2.94 CHINA GOVT 241017 | 4,000,000.00 | 4,026,287.60 | |
| 3 CHINA GOVT 531015 | 1,000,000.00 | 1,057,842.70 | |
| 3.01 CHINA GOVT 280513 | 12,000,000.00 | 12,348,663.60 | |
| 3.02 CHINA GOVT 251022 | 15,000,000.00 | 15,238,374.00 | |
| 3.02 CHINA GOVT 310527 | 10,000,000.00 | 10,349,781.00 | |
| 3.03 CHINA GOVT 260311 | 7,000,000.00 | 7,131,924.80 | |
| 3.12 CHINA GOVT 261205 | 7,000,000.00 | 7,180,182.80 | |
| 3.12 CHINA GOVT 521025 | 4,000,000.00 | 4,246,778.00 | |
| 3.13 CHINA GOVT 291121 | 14,000,000.00 | 14,557,148.20 | |
| 3.19 CHINA GOVT 530415 | 4,000,000.00 | 4,356,556.00 | |
| 3.22 CHINA GOVT 251206 | 9,000,000.00 | 9,188,791.20 | |
| 3.25 CHINA GOVT 260606 | 12,200,000.00 | 12,517,916.14 | |

| | | | | | |
|---------------------------|--------------|---------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| | | 3. 25 CHINA GOVT 281122 | 10,000,000.00 | 10,448,946.00 | |
| | | 3. 27 CHINA GOVT 301119 | 10,000,000.00 | 10,530,776.00 | |
| | | 3. 28 CHINA GOVT 271203 | 11,000,000.00 | 11,438,647.00 | |
| | | 3. 29 CHINA GOVT 290523 | 15,000,000.00 | 15,712,041.00 | |
| | | 3. 32 CHINA GOVT 520415 | 5,000,000.00 | 5,546,898.50 | |
| | | 3. 53 CHINA GOVT 511018 | 4,000,000.00 | 4,566,136.80 | |
| | | 3. 72 CHINA GOVT 510412 | 5,000,000.00 | 5,929,099.00 | |
| | | 3. 81 CHINA GOVT 500914 | 8,000,000.00 | 9,518,552.00 | |
| 中国元合計 | | | 411,200,000.00 | 422,176,237.11 (8,687,035,995) | |
| ドミニカ ペソ | 国債証券 | 11. 25 DOMINICAN 350915 | 32,000,000.00 | 34,604,758.40 | |
| | | 13. 625 DOMINICAN 330203 | 16,000,000.00 | 19,495,551.20 | |
| ドミニカペソ合計 | | | 48,000,000.00 | 54,100,309.60 (135,651,116) | |
| セルビア ディナール | 国債証券 | 4. 5 SERBIA TREASU 260111 | 61,000,000.00 | 60,351,570.00 | |
| | | 4. 5 SERBIA TREASU 320820 | 74,000,000.00 | 66,877,500.00 | |
| | | 5. 875 SERBIA TREA 280208 | 50,000,000.00 | 51,125,000.00 | |
| セルビアディナール合計 | | | 185,000,000.00 | 178,354,070.00 (243,553,897) | |
| ルーマニ アレイ | 国債証券 | 2. 5 ROMANIA GOVER 271025 | 4,000,000.00 | 3,535,226.12 | |
| | | 3. 25 ROMANIA GOVE 260624 | 3,200,000.00 | 3,020,936.89 | |
| | | 3. 5 ROMANIA GOVER 251125 | 4,500,000.00 | 4,326,826.36 | |
| | | 3. 65 ROMANIA GOVE 250728 | 4,000,000.00 | 3,887,353.52 | |
| | | 3. 65 ROMANIA GOVE 310924 | 5,500,000.00 | 4,634,650.57 | |
| | | 3. 7 ROMANIA GOVER 241125 | 1,000,000.00 | 984,192.49 | |
| | | 4. 15 ROMANIA GOVE 280126 | 5,200,000.00 | 4,848,332.89 | |
| | | 4. 15 ROMANIA GOVE 301024 | 5,000,000.00 | 4,437,900.00 | |
| | | 4. 25 ROMANIA GOVE 360428 | 3,800,000.00 | 3,122,571.56 | |
| | | 4. 75 ROMANIA GOVE 250224 | 6,900,000.00 | 6,816,514.41 | |
| | | 4. 75 ROMANIA GOVE 341011 | 5,200,000.00 | 4,548,038.14 | |
| | | 4. 85 ROMANIA GOVE 260422 | 4,900,000.00 | 4,787,792.35 | |
| | | 4. 85 ROMANIA GOVE 290725 | 4,800,000.00 | 4,498,464.00 | |
| | | 5 ROMANIA GOVERN 290212 | 6,260,000.00 | 5,936,519.69 | |
| | | 5. 8 ROMANIA GOV 270726 | 5,800,000.00 | 5,746,676.94 | |
| | | 6. 7 ROMANIA GOVER 320225 | 5,900,000.00 | 6,039,884.28 | |
| 7. 2 ROMANIA GOVER 261028 | 3,200,000.00 | 3,299,161.28 | | | |

| | | | | | |
|-----------|------|---------------------------|-------------------|--|--|
| | | 7. 2 ROMANIA GOVER 270531 | 1, 500, 000. 00 | 1, 551, 759. 75 | |
| | | 7. 2 ROMANIA GOVER 331030 | 2, 200, 000. 00 | 2, 321, 726. 00 | |
| | | 7. 35 ROMANIA GOVE 310428 | 2, 800, 000. 00 | 2, 954, 112. 00 | |
| | | 7. 9 ROMANIA GOVER 380224 | 3, 900, 000. 00 | 4, 425, 096. 00 | |
| | | 8 ROMANIA GOVERN 300429 | 2, 900, 000. 00 | 3, 145, 659. 00 | |
| | | 8. 25 ROMANIA GOVE 320929 | 5, 200, 000. 00 | 5, 825, 948. 96 | |
| | | 8. 75 ROMANIA GOVE 281030 | 5, 500, 000. 00 | 6, 053, 781. 25 | |
| ルーマニアレイ合計 | | | 103, 160, 000. 00 | 100, 749, 124. 45 (3, 242, 116, 899) | |
| トルコリラ | 国債証券 | 10. 5 TURKEY GOVT 270811 | 23, 900, 000. 00 | 15, 570, 850. 00 | |
| | | 10. 6 TURKEY GOVT 260211 | 9, 600, 000. 00 | 6, 412, 800. 00 | |
| | | 11 TURKEY GOVT 270224 | 4, 500, 000. 00 | 2, 866, 500. 00 | |
| | | 11. 7 TURKEY GOVT 301113 | 14, 100, 000. 00 | 9, 038, 100. 00 | |
| | | 12. 4 TURKEY GOVT 280308 | 29, 100, 000. 00 | 19, 409, 700. 00 | |
| | | 12. 6 TURKEY GOVT 251001 | 14, 600, 000. 00 | 10, 077, 650. 00 | |
| | | 16. 9 TURKEY GOVT 260902 | 17, 200, 000. 00 | 12, 805, 400. 00 | |
| | | 17. 3 TURKEY GOVT 280719 | 48, 000, 000. 00 | 36, 816, 000. 00 | |
| | | 17. 8 TURKEY GOVT 330713 | 28, 000, 000. 00 | 20, 888, 000. 00 | |
| | | 8 TURKEY GOVT 250312 | 6, 300, 000. 00 | 4, 737, 600. 00 | |
| トルコリラ合計 | | | 195, 300, 000. 00 | 138, 622, 600. 00 (676, 104, 006) | |
| 合計 | | | | 84, 312, 998, 200 (84, 312, 998, 200) | |

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

| 種類 | 銘柄数 | 組入債券 時価比率 | 有価証券の 合計金額に 対する比率 |
|------------|------------|--------------|-------------------------|
| マレーシアリングット | 国債証券 21 銘柄 | 100. 00% | 10. 08% |
| タイバーツ | 国債証券 25 銘柄 | 100. 00% | 9. 86% |
| フィリピンペソ | 国債証券 1 銘柄 | 100. 00% | 0. 06% |
| インドネシアルピア | 国債証券 33 銘柄 | 100. 00% | 10. 01% |
| メキシコペソ | 国債証券 18 銘柄 | 100. 00% | 9. 99% |
| ブラジルリアル | 国債証券 9 銘柄 | 100. 00% | 10. 32% |
| チリペソ | 国債証券 9 銘柄 | 100. 00% | 1. 91% |
| チェココルナ | 国債証券 12 銘柄 | 100. 00% | 6. 28% |

| | | | | |
|------------|------|-------|---------|--------|
| コロンビアペソ | 国債証券 | 12 銘柄 | 100.00% | 4.55% |
| ハンガリーフォリント | 国債証券 | 18 銘柄 | 100.00% | 3.17% |
| ペルーヌエボソル | 国債証券 | 9 銘柄 | 100.00% | 2.33% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 | 14 銘柄 | 100.00% | 7.66% |
| 南アフリカランド | 国債証券 | 12 銘柄 | 100.00% | 8.20% |
| ウルグアイペソ | 国債証券 | 3 銘柄 | 100.00% | 0.18% |
| 中国元 | 国債証券 | 58 銘柄 | 100.00% | 10.30% |
| ドミニカペソ | 国債証券 | 2 銘柄 | 100.00% | 0.16% |
| セルビアディナール | 国債証券 | 3 銘柄 | 100.00% | 0.29% |
| ルーマニアレイ | 国債証券 | 24 銘柄 | 100.00% | 3.85% |
| トルコリラ | 国債証券 | 10 銘柄 | 100.00% | 0.80% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

東証REIT指数マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月26日現在]

| 資産の部 | |
|----------|-----------------|
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 11,019,994,112 |
| 投資証券 | 100,546,877,425 |
| 派生商品評価勘定 | 1,883,400 |
| 未収配当金 | 749,152,064 |
| 未収利息 | 109,013 |
| 前払金 | 8,907,650 |
| その他未収収益 | 231,550 |
| 差入委託証拠金 | 106,347,456 |
| 流動資産合計 | 112,433,502,670 |
| 資産合計 | 112,433,502,670 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 7,800,810 |
| 未払金 | 580,943,276 |
| 未払解約金 | 67,188,016 |
| 未払利息 | 2,816 |
| 受入担保金 | 9,576,322,875 |
| 流動負債合計 | 10,232,257,793 |
| 負債合計 | 10,232,257,793 |
| 純資産の部 | |

| | |
|-------------|-----------------|
| 元本等 | |
| 元本 | 28,967,583,332 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 73,233,661,545 |
| 元本等合計 | 102,201,244,877 |
| 純資産合計 | 102,201,244,877 |
| 負債純資産合計 | 112,433,502,670 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | [2024年1月26日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首 | 2023年1月27日 |
| 期首元本額 | 22,777,413,306円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,412,859,047円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,222,689,021円 |
| 元本の内訳※ | |
| eMAXIS 国内リートインデックス | 4,005,255,931円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,695,074,917円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 150,884,725円 |
| 三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド | 698,361,080円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 438,307,742円 |
| J-REITインデックスファンド(ラップ向け) | 84,480,105円 |
| オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け) | 1,157,018,741円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 8,498,954,748円 |
| つみたて8資産均等バランス | 4,160,894,592円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 759,099円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 1,427,207円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 538,674円 |
| eMAXIS Slim 国内リートインデックス | 4,416,581,169円 |
| ラップ向けインデックスf 国内リート | 513,469,091円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 104,487,466円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 865,517,622円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 105,723,123円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 3,885,032円 |
| 三菱UFJ 国内リートインデックスファンド | 36,663,864円 |
| アクティブアロケーションファンド(ラップ向け) | 4,977,713円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型) | 2,964,387円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型) | 22,277,579円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー) | 27,504,631円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 45,142,333円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 201,173,222円 |

| | |
|---|---------------------|
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 171, 204, 247 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 70, 532, 341 円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 13, 433, 589 円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 243, 749 円 |
| MUKAM 3資産インカムバランスファンド (適格機関投資家転売制限付) | 377, 898, 956 円 |
| 日本リートインデックスファンドS | 397, 889, 264 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 36, 872, 615 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 36, 352, 853 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定) | 36, 383, 347 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定) | 36, 098, 235 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 36, 247, 289 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定) | 36, 375, 423 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定) | 35, 735, 992 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 35, 712, 758 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定) | 36, 183, 882 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定) | 36, 150, 033 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定) | 41, 025, 580 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定) | 40, 524, 225 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定) | 41, 189, 187 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定) | 40, 129, 598 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定) | 41, 380, 171 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定) | 43, 683, 780 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定) | 42, 265, 508 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定) | 41, 745, 917 円 |
| 合計 | 28, 967, 583, 332 円 |
| 2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っており ます。 投資証券 | 9, 053, 501, 950 円 |
| 3. 受益権の総数 | 28, 967, 583, 332 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 1 月 27 日 至 2024 年 1 月 26 日 |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |

| | |
|--------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [2024年 1月 26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年 1月 26日現在] |
|------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | △1,323,836,122 |
| 合計 | △1,323,836,122 |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[2024年 1月 26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|-------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 1,798,195,150 | — | 1,792,290,500 | △5,904,650 |
| 合計 | | 1,798,195,150 | — | 1,792,290,500 | △5,904,650 |

(注) 時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| | [2024年1月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 3,5281円 |
| (1万口当たり純資産額) | (35,281円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|------|----------------------|--------|---------------|------------------|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人 | 1,982 | 242,200,400 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 3,124 | 288,032,800 | 貸付有価証券 283口 |
| | S O S i L A物流リート投資法人 | 4,865 | 583,313,500 | 貸付有価証券 258口 |
| | 東海道リート投資法人 | 1,447 | 185,939,500 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 3,367 | 2,047,136,000 | 貸付有価証券 384口 |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 11,467 | 1,609,966,800 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 14,878 | 2,060,603,000 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 9,567 | 3,166,677,000 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 5,116 | 2,092,444,000 | 貸付有価証券 580口 |
| | G L P投資法人 | 32,938 | 4,354,403,600 | 貸付有価証券 3,326口 |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 4,795 | 1,515,220,000 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 16,987 | 4,588,188,700 | 貸付有価証券 1,750口 |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 1,799 | 948,073,000 | 貸付有価証券 176口 |
| | O n e リート投資法人 | 1,701 | 463,352,400 | 貸付有価証券 180口 |

| | | | |
|---------------------|--------|---------------|-------------------|
| イオンリート投資法人 | 11,961 | 1,703,246,400 | |
| ヒューリックリート投資法人 | 9,123 | 1,427,749,500 | 貸付有価証券 931 口 |
| 日本リート投資法人 | 3,167 | 1,086,281,000 | 貸付有価証券 376 口 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 29,301 | 2,300,128,500 | 貸付有価証券 3,402 口 |
| トーセイ・リート投資法人 | 2,053 | 288,035,900 | 貸付有価証券 256 口 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 2,404 | 331,752,000 | |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 2,657 | 294,661,300 | |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 31,533 | 5,073,659,700 | 貸付有価証券 3,740 口 |
| いちごホテルリート投資法人 | 1,615 | 194,123,000 | |
| ラサールロジポート投資法人 | 12,465 | 1,873,489,500 | 貸付有価証券 1,081 口 |
| スターアジア不動産投資法人 | 15,028 | 892,663,200 | |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 1,503 | 186,822,900 | 貸付有価証券 108 口 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 4,056 | 1,877,928,000 | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 1,491 | 112,570,500 | 貸付有価証券 187 口 |
| 投資法人みらい | 13,382 | 605,535,500 | 貸付有価証券 1,249 口 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 3,367 | 1,269,359,000 | 貸付有価証券 230 口 |
| CRE ロジスティクスファンド投資法人 | 4,198 | 645,232,600 | 貸付有価証券 316 口 |
| ザイマックス・リート投資法人 | 1,582 | 190,156,400 | 貸付有価証券 177 口 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 4,623 | 485,415,000 | 貸付有価証券 347 口 |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 4,273 | 549,935,100 | 貸付有価証券 365 口 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 11,375 | 6,756,750,000 | 貸付有価証券 1,120 口 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 10,016 | 5,669,056,000 | 貸付有価証券 1,157 口 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 46,740 | 4,678,674,000 | 貸付有価証券 5,787 口 |
| オリックス不動産投資法人 | 19,429 | 3,316,530,300 | 貸付有価証券 2,304 口 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 6,669 | 2,364,160,500 | 貸付有価証券 720 口 |
| N T T都市開発リート投資法人 | 9,886 | 1,248,601,800 | 貸付有価証券 1,045 口 |

| | | | |
|-------------------|---------|-----------------|-------------------|
| 東急リアル・エステート投資法人 | 6,538 | 1,154,610,800 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 7,200 | 790,560,000 | 貸付有価証券 803 口 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 21,813 | 3,295,944,300 | 貸付有価証券 2,473 口 |
| 森トラストリート投資法人 | 18,795 | 1,403,986,500 | 貸付有価証券 2,114 口 |
| インヴィンシブル投資法人 | 47,213 | 2,875,271,700 | 貸付有価証券 4,836 口 |
| フロンティア不動産投資法人 | 3,618 | 1,555,740,000 | 貸付有価証券 384 口 |
| 平和不動産リート投資法人 | 7,285 | 1,008,244,000 | 貸付有価証券 720 口 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 6,246 | 1,768,242,600 | |
| 福岡リート投資法人 | 5,043 | 874,960,500 | 貸付有価証券 598 口 |
| KDX不動産投資法人 | 28,062 | 4,534,819,200 | 貸付有価証券 3,156 口 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 7,990 | 660,773,000 | 貸付有価証券 959 口 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 2,020 | 1,242,300,000 | 貸付有価証券 247 口 |
| 阪急阪神リート投資法人 | 4,649 | 675,964,600 | 貸付有価証券 522 口 |
| スターツプロシード投資法人 | 1,690 | 344,253,000 | 貸付有価証券 180 口 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 14,698 | 3,742,110,800 | 貸付有価証券 1,650 口 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 32,642 | 2,480,792,000 | 貸付有価証券 3,726 口 |
| 大和証券リビング投資法人 | 14,359 | 1,532,105,300 | 貸付有価証券 1,459 口 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 8,474 | 1,028,743,600 | 貸付有価証券 1,073 口 |
| 東海道リート投資法人（新） | 75 | 9,387,225 | |
| 合計 | 616,340 | 100,546,877,425 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

MUAM G-REITマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年1月26日現在]

| 資産の部 | |
|-------------|-----------------|
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,689,286,206 |
| コール・ローン | 63,549,592 |
| 投資証券 | 114,243,194,378 |
| 派生商品評価勘定 | 1,143,085 |
| 未収配当金 | 121,253,203 |
| 差入委託証拠金 | 976,900,976 |
| 流動資産合計 | 117,095,327,440 |
| 資産合計 | 117,095,327,440 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 76,042,068 |
| 未払金 | 4,932,000 |
| 未払解約金 | 21,936,492 |
| 未払利息 | 16 |
| 流動負債合計 | 102,910,576 |
| 負債合計 | 102,910,576 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 45,744,488,251 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 71,247,928,613 |
| 元本等合計 | 116,992,416,864 |
| 純資産合計 | 116,992,416,864 |
| 負債純資産合計 | 117,095,327,440 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 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1月26日現在] |
|-------|-----------------|
| 1. 期首 | 2023年1月27日 |
| 期首元本額 | 41,064,470,321円 |

| | |
|------------------------------|-----------------|
| 期中追加設定元本額 | 10,702,168,351円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,022,150,421円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 106,582,570円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 95,500,282円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型) | 28,829,170円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型) | 54,285,579円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型) | 25,656,879円 |
| eMAXIS 先進国リートインデックス | 5,942,148,124円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 2,335,075,502円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 210,075,177円 |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド | 3,258,768,710円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 600,883,350円 |
| オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け) | 1,567,691,742円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 11,694,445,104円 |
| つみたて8資産均等バランス | 5,744,131,977円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,574,407円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 2,949,479円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 1,115,972円 |
| eMAXIS Slim 先進国リートインデックス | 10,101,239,116円 |
| 三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド | 97,475,181円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート | 875,051,316円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 64,670,216円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 777,967,410円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 300,321,949円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート(為替ヘッジあり) | 303,009円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型) | 3,944,730円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型) | 34,400,995円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー) | 57,075,291円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 93,671,219円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 417,450,558円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 356,143,118円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 141,510,853円 |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定) | 18,416,331円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 151,675円 |
| 海外リートインデックスファンドS | 734,981,260円 |
| 合計 | 45,744,488,251円 |
| 2. 受益権の総数 | 45,744,488,251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1月27日 至 2024年1月26日 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用しております。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 |

| | |
|-------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してあります。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |
|-------------------|--|

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [2024年 1月 26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [2024年 1月 26日現在] |
|------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | △2,021,629,380 |
| 合計 | △2,021,629,380 |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[2024年 1月 26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|-------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 3,324,406,491 | — | 3,249,540,315 | △74,866,176 |
| 合計 | | 3,324,406,491 | — | 3,249,540,315 | △74,866,176 |

(注) 時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[2024年1月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------------|-------------|-------|-------------|----------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカドル | 397,095,922 | — | 397,069,206 | △26,716 |
| | オーストラリアドル | 34,303,509 | — | 34,305,351 | 1,842 |
| | イギリスポンド | 24,378,919 | — | 24,376,225 | △2,694 |
| | シンガポールドル | 15,972,168 | — | 15,967,582 | △4,586 |
| | ユーロ | 17,130,700 | — | 17,130,047 | △653 |
| 合計 | | 488,881,218 | — | 488,848,411 | △32,807 |

(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1月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.5575円 |
| (1万口当たり純資産額) | (25,575円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 通貨 | 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|----------------------------|---------|------------------------------|---------|---------------|----|
| アメリカ ドル | 投資証券 | ACADIA REALTY TRUST | 54,731 | 962,718.29 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 58,629 | 3,498,392.43 | |
| | | ALEXANDER & BALDWIN INC | 42,082 | 753,688.62 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 1,131 | 259,225.20 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 90,567 | 11,177,779.14 | |
| | | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 8,816 | 140,967.84 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 29,861 | 709,198.75 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 184,085 | 6,413,521.40 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST INC | 153,871 | 4,396,094.47 | |
| | | APARTMENT INCOME REIT CO | 83,510 | 2,774,202.20 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 84,829 | 649,790.14 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 127,458 | 2,091,585.78 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 38,034 | 460,972.08 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 15,953 | 22,653.26 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 82,502 | 14,530,252.24 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 83,248 | 5,952,232.00 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 34,741 | 83,378.40 | |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 96,861 | 491,085.27 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 176,710 | 4,032,522.20 | |
| | | BROADSTONE NET LEASE INC | 111,165 | 1,833,110.85 | |
| | | BRT APARTMENTS CORP | 8,081 | 143,599.37 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 61,631 | 5,907,947.66 | |
| | | CARETRUST REIT INC | 71,487 | 1,532,681.28 | |
| | | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 15,865 | 384,091.65 | |
| | | CENTERSPACE | 8,971 | 505,964.40 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 29,966 | 326,030.08 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 25,899 | 146,070.36 | |
| | | CLIPPER REALTY INC | 11,551 | 58,448.06 | |
| | | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 14,982 | 391,030.20 | |
| | | COPT DEFENSE PROPERTIES | 67,568 | 1,652,037.60 | |
| | | COUSINS PROPERTIES INC | 90,985 | 2,111,761.85 | |
| | | CTO REALTY GROWTH INC | 12,027 | 202,294.14 | |
| CUBESMART | 130,093 | 5,894,513.83 | | | |
| DIAMONDRock HOSPITALITY CO | 126,684 | 1,162,959.12 | | | |

| | | | |
|------------------------------|---------|---------------|--|
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 423,000 | 262,260.00 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 176,078 | 25,036,530.82 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 131,456 | 381,222.40 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 95,343 | 1,383,426.93 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 202,000 | — | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 57,051 | 731,393.82 | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 27,135 | 4,845,225.60 | |
| ELME COMMUNITIES | 51,661 | 756,833.65 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 78,964 | 808,591.36 | |
| EPR PROPERTIES | 45,244 | 2,017,882.40 | |
| EQUINIX INC | 54,575 | 44,495,543.25 | |
| EQUITY COMMONWEALTH | 63,262 | 1,210,202.06 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 108,343 | 7,188,558.05 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 200,612 | 11,808,022.32 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 92,599 | 2,307,567.08 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 37,274 | 8,719,134.08 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 122,744 | 18,267,989.52 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 29,083 | 335,617.82 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 42,267 | 4,381,819.89 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 77,849 | 4,073,059.68 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 52,314 | 1,242,457.50 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 64,997 | 159,892.62 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 155,102 | 7,142,447.10 | |
| GETTY REALTY CORP | 27,482 | 763,449.96 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 24,371 | 325,109.14 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 18,797 | 262,594.09 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 36,267 | 372,462.09 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 115,380 | 1,026,882.00 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 227,647 | 3,767,557.85 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 316,762 | 6,132,512.32 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 63,623 | 1,433,426.19 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 408,175 | 7,987,984.75 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 78,151 | 687,728.80 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 130,032 | 1,976,486.40 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 36,445 | 150,882.30 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 17,158 | 1,606,675.12 | |

| | | | |
|------------------------------|-----------|---------------|--|
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 39,857 | 1,028,709.17 | |
| INVITATION HOMES INC | 333,726 | 11,099,726.76 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 169,544 | 11,601,895.92 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 51,300 | 859,275.00 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 477,700 | 157,641.00 | |
| KILROY REALTY CORP | 62,598 | 2,435,688.18 | |
| KIMCO REALTY CORP | 384,072 | 8,015,582.64 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 125,382 | 2,744,611.98 | |
| LTC PROPERTIES INC | 24,391 | 776,609.44 | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 174,052 | 1,636,088.80 | |
| MACERICH CO/THE | 121,861 | 2,026,548.43 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 1,011,020 | 65,716.30 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 365,098 | 1,244,984.18 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 67,585 | 8,919,868.30 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 44,841 | 1,738,485.57 | |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 24,630 | 1,330,758.90 | |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | 8,717 | 217,401.98 | |
| NETSTREIT CORP | 39,142 | 720,604.22 | |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 16,397 | 114,287.09 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 13,180 | 426,109.40 | |
| NNN REIT INC | 105,455 | 4,361,618.80 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 30,313 | 112,461.23 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 141,919 | 4,102,878.29 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 9,253 | 196,348.66 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 36,842 | 198,209.96 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 102,100 | 514,584.00 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 123,544 | 1,918,638.32 | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 21,921 | 352,708.89 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 74,248 | 1,159,753.76 | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 69,835 | 2,497,997.95 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 140,351 | 1,802,106.84 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 73,777 | 544,474.26 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 20,594 | 470,984.78 | |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 11,862 | 171,880.38 | |
| PRIME US REIT | 348,400 | 65,150.80 | |
| PROLOGIS INC | 537,478 | 67,829,723.60 | |

| | | | | | |
|-----|------|------------------------------|------------|------------------------------------|--|
| | | PUBLIC STORAGE | 92,010 | 26,837,476.80 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 482,968 | 26,766,086.56 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 95,124 | 6,085,082.28 | |
| | | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 72,391 | 1,020,713.10 | |
| | | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 122,123 | 6,571,438.63 | |
| | | RLJ LODGING TRUST | 95,326 | 1,124,846.80 | |
| | | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 35,313 | 3,884,783.13 | |
| | | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 131,793 | 1,742,303.46 | |
| | | SAFEHOLD INC | 27,619 | 567,570.45 | |
| | | SAUL CENTERS INC | 8,150 | 326,326.00 | |
| | | SERVICE PROPERTIES TRUST | 100,591 | 785,615.71 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 189,649 | 27,087,566.67 | |
| | | SITE CENTERS CORP | 107,265 | 1,485,620.25 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 36,506 | 1,714,686.82 | |
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 104,417 | 3,946,962.60 | |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 61,291 | 412,488.43 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 72,217 | 9,017,014.62 | |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 113,652 | 1,209,257.28 | |
| | | TANGER INC | 62,667 | 1,750,289.31 | |
| | | TERRENO REALTY CORP | 49,857 | 3,003,385.68 | |
| | | UDR INC | 174,913 | 6,389,571.89 | |
| | | UMH PROPERTIES INC | 35,545 | 550,947.50 | |
| | | UNITI GROUP INC | 146,642 | 802,131.74 | |
| | | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 7,436 | 314,096.64 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 69,540 | 1,237,812.00 | |
| | | VENTAS INC | 233,648 | 11,084,261.12 | |
| | | VERIS RESIDENTIAL INC | 47,834 | 742,383.68 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 601,464 | 18,356,681.28 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 93,353 | 2,671,762.86 | |
| | | WELLTOWER INC | 322,009 | 28,085,624.98 | |
| | | WHITESTONE REIT | 27,990 | 357,152.40 | |
| | | WP CAREY INC | 126,967 | 8,058,595.49 | |
| | | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 64,037 | 868,341.72 | |
| | | アメリカドル合計 | 15,539,109 | 604,021,220.78 (89,213,934,309) | |
| カナダ | 投資証券 | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 36,000 | 744,120.00 | |

| | | | | | |
|-----------|------------------------------|------------------------------|-----------|----------------------------------|--|
| ル | | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 36,990 | 249,682.50 | |
| | | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 13,410 | 940,309.20 | |
| | | BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | 13,300 | 210,007.00 | |
| | | BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 52,400 | 164,012.00 | |
| | | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 48,780 | 2,277,050.40 | |
| | | CHOICE PROPERTIES REIT | 92,687 | 1,308,740.44 | |
| | | CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 30,230 | 417,476.30 | |
| | | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 29,700 | 436,887.00 | |
| | | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 79,000 | 1,068,870.00 | |
| | | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 12,310 | 135,779.30 | |
| | | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 64,500 | 979,755.00 | |
| | | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 18,200 | 1,342,796.00 | |
| | | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 74,409 | 742,601.82 | |
| | | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 41,700 | 552,942.00 | |
| | | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 34,500 | 638,940.00 | |
| | | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 12,300 | 201,597.00 | |
| | | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 10,800 | 165,456.00 | |
| | | NEXUS INDUSTRIAL REIT | 14,500 | 119,770.00 | |
| | | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 66,500 | 334,495.00 | |
| | | PRIMARIS REIT | 31,077 | 431,970.30 | |
| | | PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | 13,000 | 72,800.00 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 76,170 | 1,397,719.50 | |
| | | SLATE GROCERY REIT-CL U | 20,200 | 256,944.00 | |
| | | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 41,700 | 1,022,484.00 | |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 5,182 | 48,399.88 | | |
| カナダドル合計 | | | 969,545 | 16,261,604.64 (1,782,271,868) | |
| オーストラリアドル | 投資証券 | ABACUS GROUP | 258,313 | 272,520.21 | |
| | | ABACUS STORAGE KING | 349,661 | 379,382.18 | |
| | | ARENA REIT | 193,872 | 684,368.16 | |
| | | BWP TRUST | 286,513 | 971,279.07 | |
| | | CENTURIA CAPITAL GROUP | 502,926 | 809,710.86 | |
| | | CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 327,007 | 1,039,882.26 | |
| | | CENTURIA OFFICE REIT | 223,021 | 284,351.77 | |
| | | CHARTER HALL GROUP | 270,715 | 3,080,736.70 | |
| | | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 398,836 | 1,423,844.52 | |

| | | | | | |
|-------------|------|------------------------------|------------|----------------------------------|--|
| | | CHARTER HALL RETAIL REIT | 320,766 | 1,145,134.62 | |
| | | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 195,853 | 526,844.57 | |
| | | CROMWELL PROPERTY GROUP | 821,364 | 320,331.96 | |
| | | DEXUS INDUSTRIA REIT | 114,607 | 311,731.04 | |
| | | DEXUS/AU | 623,225 | 4,599,400.50 | |
| | | GDI PROPERTY GROUP | 148,753 | 97,433.21 | |
| | | GOODMAN GROUP | 1,004,916 | 25,042,506.72 | |
| | | GPT GROUP | 1,092,975 | 4,820,019.75 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 156,679 | 358,794.91 | |
| | | HEALTHCO REIT | 303,509 | 391,526.61 | |
| | | HMC CAPITAL LTD | 151,349 | 885,391.65 | |
| | | HOMECO DAILY NEEDS REIT | 1,044,796 | 1,232,859.28 | |
| | | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 115,529 | 332,723.52 | |
| | | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 236,027 | 1,014,916.10 | |
| | | MIRVAC GROUP | 2,346,665 | 4,904,529.85 | |
| | | NATIONAL STORAGE REIT | 744,264 | 1,644,823.44 | |
| | | REGION RE LTD | 703,188 | 1,539,981.72 | |
| | | RURAL FUNDS GROUP | 228,339 | 465,811.56 | |
| | | SCENTRE GROUP | 2,989,451 | 8,669,407.90 | |
| | | STOCKLAND | 1,373,704 | 5,948,138.32 | |
| | | VICINITY CENTRES | 2,220,258 | 4,329,503.10 | |
| | | WAYPOINT REIT | 384,457 | 915,007.66 | |
| | | オーストラリアドル合計 | 20,131,538 | 78,442,893.72 (7,627,002,556) | |
| イギリス ポンド | 投資証券 | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 189,691 | 102,433.14 | |
| | | AEW UK REIT PLC | 118,804 | 114,527.05 | |
| | | ASSURA PLC | 1,769,948 | 795,768.62 | |
| | | BALANCED COMM PROPERTY TRUST | 417,405 | 308,879.70 | |
| | | BIG YELLOW GROUP PLC | 112,854 | 1,253,807.94 | |
| | | BRITISH LAND CO PLC | 533,482 | 1,985,086.52 | |
| | | CLS HOLDINGS PLC | 90,000 | 85,680.00 | |
| | | CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE | 291,411 | 207,193.22 | |
| | | DERWENT LONDON PLC | 63,419 | 1,320,383.58 | |
| | | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 372,068 | 343,046.69 | |
| | | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 155,948 | 636,891.63 | |
| | | HAMMERSON PLC | 2,333,062 | 617,794.81 | |

| | | | | | |
|------|------|------------------------------|------------|----------------------------------|--|
| | | HELICAL PLC | 60,734 | 126,326.72 | |
| | | HOME REIT PLC | 398,800 | 151,743.40 | |
| | | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 246,077 | 213,348.75 | |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 440,897 | 2,883,466.38 | |
| | | LIFE SCIENCE REIT PLC | 209,200 | 125,520.00 | |
| | | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 623,621 | 1,164,300.40 | |
| | | LXI REIT PLC | 989,382 | 1,014,116.55 | |
| | | NEWRIVER REIT PLC | 188,335 | 146,336.29 | |
| | | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 360,527 | 236,505.71 | |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 742,515 | 712,443.14 | |
| | | PRS REIT PLC/THE | 310,645 | 266,222.76 | |
| | | REGIONAL REIT LTD | 125,644 | 37,441.91 | |
| | | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 121,233 | 988,655.11 | |
| | | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 308,300 | 140,276.50 | |
| | | SEGRO PLC | 711,005 | 6,052,074.56 | |
| | | SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 1,105,659 | 1,439,568.01 | |
| | | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 754,928 | 604,697.32 | |
| | | TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 371,700 | 310,741.20 | |
| | | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 175,846 | 109,903.75 | |
| | | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 1,083,502 | 1,734,686.70 | |
| | | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 464,477 | 287,511.26 | |
| | | UNITE GROUP PLC/THE | 231,814 | 2,306,549.30 | |
| | | URBAN LOGISTICS REIT PLC | 260,093 | 319,394.20 | |
| | | WAREHOUSE REIT PLC | 260,780 | 219,576.76 | |
| | | WORKSPACE GROUP PLC | 72,738 | 377,510.22 | |
| | | イギリスポンド合計 | 17,066,544 | 29,740,409.80 (5,579,895,686) | |
| 香港ドル | 投資証券 | CHAMPION REIT | 1,129,000 | 2,167,680.00 | |
| | | FORTUNE REIT | 855,000 | 3,890,250.00 | |
| | | LINK REIT | 1,487,500 | 58,310,000.00 | |
| | | PROSPERITY REIT | 760,000 | 995,600.00 | |
| | | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 635,000 | 1,244,600.00 | |
| | | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 1,304,000 | 1,434,400.00 | |
| | | 香港ドル合計 | 6,170,500 | 68,042,530.00 (1,285,323,391) | |
| シンガポ | 投資証券 | AIMS APAC REIT | 411,000 | 538,410.00 | |

| | | | | | |
|--------------|-------------|------------------------------|--------------|----------------|-----------------|
| ールドル | | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 2,052,000 | 5,971,320.00 | |
| | | CAPITALAND ASCOTT TRUST | 1,381,074 | 1,291,304.19 | |
| | | CAPITALAND CHINA TRUST | 703,900 | 577,198.00 | |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 2,909,132 | 5,701,898.72 | |
| | | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 427,700 | 436,254.00 | |
| | | EC WORLD REIT | 199,400 | 55,832.00 | |
| | | ESR-LOGOS REIT | 3,783,668 | 1,172,937.08 | |
| | | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 677,200 | 430,022.00 | |
| | | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 653,900 | 1,490,892.00 | |
| | | FRASERS LOGISTICS & COMMERC | 1,768,966 | 1,945,862.60 | |
| | | KEPPEL DC REIT | 758,200 | 1,364,760.00 | |
| | | KEPPEL REIT | 1,267,700 | 1,159,945.50 | |
| | | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 1,007,000 | 619,305.00 | |
| | | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 1,217,200 | 2,969,968.00 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,896,000 | 2,957,760.00 | |
| | | MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 1,393,200 | 1,992,276.00 | |
| | | PARAGON REIT | 719,700 | 615,343.50 | |
| | | PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 234,000 | 835,380.00 | |
| | | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 272,500 | 182,575.00 | |
| | | STARHILL GLOBAL REIT | 704,300 | 355,671.50 | |
| | SUNTEC REIT | 1,267,600 | 1,533,796.00 | | |
| シンガポールドル合計 | | | 25,705,340 | 34,198,711.09 | (3,767,672,000) |
| ニュージーランドドル | 投資証券 | ARGOSY PROPERTY LTD | 451,499 | 528,253.83 | |
| | | GOODMAN PROPERTY TRUST | 596,091 | 1,335,243.84 | |
| | | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 876,670 | 753,936.20 | |
| | | PRECINCT PROPERTIES GROUP | 831,046 | 1,030,497.04 | |
| ニュージーランドドル合計 | | | 2,755,306 | 3,647,930.91 | (329,043,368) |
| 韓国ウォン | 投資証券 | D&D PLATFORM REIT CO LTD | 42,272 | 135,270,400.00 | |
| | | ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 96,143 | 351,402,665.00 | |
| | | JR REIT XXVII | 87,237 | 352,873,665.00 | |
| | | KORAMCO LIFE INFRA REIT | 18,324 | 92,169,720.00 | |
| | | LOTTE REIT CO LTD | 80,098 | 242,296,450.00 | |
| | | NH ALL-ONE REIT CO LTD | 32,547 | 106,591,425.00 | |
| | | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 44,672 | 291,708,160.00 | |

| | | | | |
|-------------------------|--------|------------------------------|---------|-----------------------------------|
| | | SK REITS CO LTD | 62,600 | 235,689,000.00 |
| 韓国ウォン合計 | | | 463,893 | 1,808,001,485.00 (199,964,964) |
| イスラエル シエケ ル | 投資証券 | MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 406,762 | 716,307.88 |
| | | REIT 1 LTD | 109,796 | 1,824,809.52 |
| | | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 113,370 | 905,259.45 |
| イスラエルシエケル合計 | | | 629,928 | 3,446,376.85 (137,354,660) |
| ユーロ | 投資証券 | AEDIFICA | 28,472 | 1,661,341.20 |
| | | ALTAREA | 2,731 | 219,572.40 |
| | | CARE PROPERTY INVEST | 16,132 | 206,812.24 |
| | | CARMILA | 31,800 | 517,704.00 |
| | | COFINIMMO | 21,277 | 1,414,920.50 |
| | | COVIVIO | 27,358 | 1,237,675.92 |
| | | CROMWELL REIT EUR | 199,500 | 281,295.00 |
| | | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 24,838 | 524,081.80 |
| | | GECINA SA | 30,773 | 3,194,237.40 |
| | | HAMBORNER REIT AG | 43,259 | 287,672.35 |
| | | ICADE | 18,221 | 601,657.42 |
| | | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 22,501 | 50,064.72 |
| | | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 170,569 | 978,213.21 |
| | | INTERVEST OFFICES & WAREHOUS | 17,880 | 372,798.00 |
| | | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 229,201 | 271,832.38 |
| | | KLEPIERRE | 116,653 | 2,757,676.92 |
| | | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 32,964 | 207,673.20 |
| | | MERCIALYS | 54,648 | 598,942.08 |
| | | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 194,326 | 1,834,437.44 |
| | | MONTEA NV | 9,378 | 755,866.80 |
| | | NSI NV | 12,706 | 251,578.80 |
| | | RETAIL ESTATES | 6,890 | 420,290.00 |
| | | SHURGARD SELF STORAGE LTD | 19,000 | 816,525.00 |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 58,209 | 3,916,301.52 |
| | | VASTNED RETAIL NV | 6,082 | 125,289.20 |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 100,885 | 2,661,346.30 |
| WERELDHAVE NV | 24,111 | 337,554.00 | | |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 16,907 | 472,550.65 | | |

| | | | |
|-------|-----------|--------------------------------------|--|
| ユーロ合計 | 1,537,271 | 26,975,910.45 (4,320,731,576) | |
| 合計 | | 114,243,194,378 (114,243,194,378) | |

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

| 種類 | 銘柄数 | 組入投資証券 時価比率 | 有価証券の 合計金額に 対する比率 |
|------------|-------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル | 投資証券 139 銘柄 | 100.00% | 78.09% |
| カナダドル | 投資証券 26 銘柄 | 100.00% | 1.56% |
| オーストラリアドル | 投資証券 31 銘柄 | 100.00% | 6.68% |
| イギリスポンド | 投資証券 37 銘柄 | 100.00% | 4.88% |
| 香港ドル | 投資証券 6 銘柄 | 100.00% | 1.13% |
| シンガポールドル | 投資証券 22 銘柄 | 100.00% | 3.30% |
| ニュージーランドドル | 投資証券 4 銘柄 | 100.00% | 0.29% |
| 韓国ウォン | 投資証券 8 銘柄 | 100.00% | 0.18% |
| イスラエルシェケル | 投資証券 3 銘柄 | 100.00% | 0.12% |
| ユーロ | 投資証券 28 銘柄 | 100.00% | 3.78% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

【中間財務諸表】

- 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2024年1月27日から2024年7月26日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月2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

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eMAXIS バランス（波乗り型）の2024年1月27日から2024年7月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、eMAXIS バランス（波乗り型）の2024年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年1月27日から2024年7月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に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。

【eMAXIS バランス（波乗り型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第13期 [2024年1月26日現在] | 第14期中間計算期間末 [2024年7月26日現在] |
|-----------------|--------------------------|---------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 122,110,038 | 113,919,863 |
| 親投資信託受益証券 | 4,103,104,836 | 4,349,609,548 |
| 未収入金 | 113,170,532 | 121,963,480 |
| 未収利息 | - | 205 |
| 流動資産合計 | 4,338,385,406 | 4,585,493,096 |
| 資産合計 | 4,338,385,406 | 4,585,493,096 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 24,644,360 | 8,990,968 |
| 未払受託者報酬 | 1,475,546 | 1,477,342 |
| 未払委託者報酬 | 10,820,590 | 10,833,728 |
| 未払利息 | 31 | - |
| その他未払費用 | 88,464 | 88,577 |
| 流動負債合計 | 37,028,991 | 21,390,615 |
| 負債合計 | 37,028,991 | 21,390,615 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,878,027,316 | 1,858,926,120 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 2,423,329,099 | 2,705,176,361 |
| （分配準備積立金） | 741,990,189 | 689,572,354 |
| 元本等合計 | 4,301,356,415 | 4,564,102,481 |
| 純資産合計 | 4,301,356,415 | 4,564,102,481 |
| 負債純資産合計 | 4,338,385,406 | 4,585,493,096 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第13期中間計算期間 自 2023年1月27日 至 2023年7月26日 | 第14期中間計算期間 自 2024年1月27日 至 2024年7月26日 |
|-------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 383 | 27,103 |
| 有価証券売買等損益 | 397,510,834 | 317,773,546 |
| 営業収益合計 | 397,511,217 | 317,800,649 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 21,547 | 1,082 |
| 受託者報酬 | 1,402,850 | 1,477,342 |
| 委託者報酬 | 10,287,502 | 10,833,728 |

| | | |
|---|---------------|---------------|
| その他費用 | 84,103 | 88,577 |
| 営業費用合計 | 11,796,002 | 12,400,729 |
| 営業利益又は営業損失(△) | 385,715,215 | 305,399,920 |
| 経常利益又は経常損失(△) | 385,715,215 | 305,399,920 |
| 中間純利益又は中間純損失(△) | 385,715,215 | 305,399,920 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△) | 10,915,571 | 14,339,628 |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△) | 2,133,066,839 | 2,423,329,099 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 139,555,867 | 167,564,985 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 139,555,867 | 167,564,985 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 170,955,651 | 176,778,015 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 170,955,651 | 176,778,015 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金(△) | 2,476,466,699 | 2,705,176,361 |

(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13期 [2024年1月26日現在] | 第14期中間計算期間末 [2024年7月26日現在] |
|-----------|------------------------|-------------------------------|
| 1. 期首元本額 | 2,069,127,970円 | 1,878,027,316円 |
| 期中追加設定元本額 | 264,340,736円 | 117,973,914円 |
| 期中一部解約元本額 | 455,441,390円 | 137,075,110円 |
| 2. 受益権の総数 | 1,878,027,316口 | 1,858,926,120口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第13期中間計算期間 自2023年1月27日 至2023年7月26日 | 第14期中間計算期間 自2024年1月27日 至2024年7月26日 |
|--|--|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 第13期 [2024年1月26日現在] | 第14期中間計算期間末 [2024年7月26日現在] |
|------------------------|--|---|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン | (1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左 |

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

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| | 第13期 [2024年1月26日現在] | 第14期中間計算期間末 [2024年7月26日現在] |
|--------------|------------------------|-------------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 2,2904円 | 2,4552円 |
| (1万口当たり純資産額) | (22,904円) | (24,552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7月26日現在]

| 資産の部 | |
|----------|-------------------|
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 38,576,069,392 |
| 株式 | 1,469,855,967,560 |
| 派生商品評価勘定 | 14,298,700 |
| 未収入金 | 16,883,038,503 |
| 未収配当金 | 1,792,043,787 |
| 未収利息 | 69,669 |
| 前払金 | 975,538,000 |
| その他未収収益 | 10,581,780 |
| 差入委託証拠金 | 872,315,080 |
| 流動資産合計 | 1,528,979,922,471 |
| 資産合計 | 1,528,979,922,471 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 989,414,950 |

| | |
|-------------|-------------------|
| 未払解約金 | 5,924,811,003 |
| 未払利息 | 650,619 |
| 受入担保金 | 19,414,577,222 |
| 流動負債合計 | 26,329,453,794 |
| 負債合計 | 26,329,453,794 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 453,266,096,216 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 1,049,384,372,461 |
| 元本等合計 | 1,502,650,468,677 |
| 純資産合計 | 1,502,650,468,677 |
| 負債純資産合計 | 1,528,979,922,471 |

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7月26日現在] |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 417,817,127,461円 |
| 期中追加設定元本額 | 111,359,486,723円 |
| 期中一部解約元本額 | 75,910,517,968円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ トピックスインデックスオープン | 6,469,545,180円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 742,353,184円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 3,639,373,600円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 3,836,478,940円 |
| 三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金) | 3,720,573,583円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 5,459,130,148円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 32,639,817,546円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 42,015,419,604円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 81,101,644円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 228,254,039円 |
| ファンド・マネジャー(国内株式) | 408,834,236円 |
| eMAXIS TOPIXインデックス | 7,880,344,623円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,922,273,570円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 124,283,671円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 2,755,781,597円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 799,047,877円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 1,107,448,258円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 1,109,603,438円 |
| eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX) | 59,779,378,917円 |
| 国内株式セレクション(ラップ向け) | 5,844,794,677円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 10,547,129,163円 |

| | |
|--|------------------|
| つみたて日本株式 (TOPIX) | 11,232,643,913 円 |
| つみたて8資産均等バランス | 5,314,838,146 円 |
| つみたて4資産均等バランス | 2,022,819,268 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 3,132,725 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 5,217,272 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 10,012,565 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金) | 695,433,087 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 949,169,980 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 692,548,758 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15) | 506,116,544 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式40) | 1,767,327,215 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65) | 4,513,620,058 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型) | 1,657,555,434 円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式) | 5,237,073,530 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 652,759,109 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 148,986,391 円 |
| 国内株式インデックス・オープン (ラップ向け) | 21,903,306,326 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 320,280,034 円 |
| ラップ向けインデックスf 国内株式 | 4,052,059,212 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) | 4,013,855,895 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型) | 2,604,317,127 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 65,796,298 円 |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け) | 2,732,444,058 円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド | 83,342,762 円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 23,146,436 円 |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け) | 35,666,650 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金) | 5,539,793 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 | 3,146,634 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 | 63,520,015 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型) | 945,778,964 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型) | 2,192,935,488 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 224,866,398 円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) | 1,417,137,340 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型) | 255,396,951 円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 16,790,705 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) | 823,813,511 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 146,834,614 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 189,359,823 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 808,792,462 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフワード) | 670,813,962 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 1,262,147,703 円 |
| 三菱UFJ トピックスオープン | 915,791,064 円 |
| 三菱UFJ DCトピックスオープン | 8,005,353,047 円 |
| 三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定) | 40,848,655 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 | 3,627,081,712 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) | 6,960,877円 |
| 三菱UFJ | バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 3,304,361,206円 |
| 三菱UFJ | バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 53,479,491円 |
| 三菱UFJ | バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 1,102,555,662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) | 57,127,835,429円 |
| 三菱UFJ | バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定) | 171,620,475円 |
| 三菱UFJ | バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 201,843円 |
| 三菱UFJ | バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 117,599円 |
| 三菱UFJ | バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 173,412,640円 |
| 三菱UFJ | バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 304,610,774円 |
| MUAM | インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定) | 4,024,519,267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) | 3,075,021,951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) | 933,126,492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) | 334,372,701円 |
| | 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 90,555,885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) | 2,579,289,802円 |
| MUKAM | バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付) | 140,884,285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) | 3,773,536,391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) | 236,842,446円 |
| MUKAM | 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定) | 4,355,108,795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) | 28,584,727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 (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 74,756,404円 |
| | 日本株式インデックスファンドS | 4,114,154,444円 |
| | グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定) | 4,767,431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) | 79,523,277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) | 200,861,027円 |
| MUKAM | アセットアロケーションファンド2021-07 (適 | 34,450,377円 |

| | |
|---|------------------|
| 格機関投資家限定) | |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 34,305,177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) | 372,299,051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 | 5,463,020,035円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 2,442,916円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 5,958,788円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 1,400,790円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 5,411,622円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1 | 437,782,436円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA | 61,977,288円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 2,743,591円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 23,896,120円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 1,316,306円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 13,954,272円 |
| 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド | 1,575,274,528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) | 288,220,084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) | 1,261,437,625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) | 1,226,031,660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) | 1,203,234,891円 |
| 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド | 60,318,628,075円 |
| 合計 | 453,266,096,216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 | 18,106,712,280円 |
| 3. 受益権の総数 | 453,266,096,216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7月26日現在] |
|----|----------------|

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

(有価証券に関する注記)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
株式関連

[2024年7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|----------------|----------------|-------|----------------|--------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 20,283,298,000 | — | 19,308,575,000 | △974,723,000 |
| 合計 | | 20,283,298,000 | — | 19,308,575,000 | △974,723,000 |

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

| | [2024年7月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 3.3152円 |
| (1万口当たり純資産額) | (33,152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7月26日現在]

| | |
|------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 43,899,715,992 |

| | |
|-------------|-------------------|
| コール・ローン | 862,322,643 |
| 株式 | 5,760,642,070,763 |
| 投資証券 | 111,186,711,986 |
| 派生商品評価勘定 | 137,625,067 |
| 未収入金 | 23,755,056 |
| 未収配当金 | 3,520,566,206 |
| 未収利息 | 1,557 |
| 差入委託証拠金 | 107,039,102,239 |
| 流動資産合計 | 6,027,311,871,509 |
| 資産合計 | 6,027,311,871,509 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 4,057,599,280 |
| 未払解約金 | 3,693,972,420 |
| 流動負債合計 | 7,751,571,700 |
| 負債合計 | 7,751,571,700 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 841,155,258,516 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 5,178,405,041,293 |
| 元本等合計 | 6,019,560,299,809 |
| 純資産合計 | 6,019,560,299,809 |
| 負債純資産合計 | 6,027,311,871,509 |

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7月26日現在] |
|-----------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 660,378,109,832円 |
| 期中追加設定元本額 | 212,088,946,453円 |
| 期中一部解約元本額 | 31,311,797,769円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 159,709,870円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 857,118,389円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 876,967,097円 |
| MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信 | 3,121,627,877円 |
| MAXIS 全世界株式(オール・カンントリー)上場投信 | 6,431,622,422円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 1,174,470,248円 |

| | |
|-----------------------------------|-------------------|
| 三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金) | 7,687,066,999 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金) | 9,604,115,328 円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型) | 37,480,985 円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型) | 106,371,926 円 |
| ファンド・マネジャー (海外株式) | 776,741 円 |
| eMAXIS 先進国株式インデックス | 14,207,375,154 円 |
| eMAXIS バランス (8資産均等型) | 901,465,305 円 |
| eMAXIS バランス (波乗り型) | 147,437,104 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金) | 1,574,834,120 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金) | 185,210,807 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金) | 268,397,482 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金) | 251,759,108 円 |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス | 107,253,072,526 円 |
| 海外株式セレクション (ラップ向け) | 2,031,905,184 円 |
| eMAXIS Slim バランス (8資産均等型) | 4,948,246,986 円 |
| つみたて先進国株式 | 36,983,806,824 円 |
| つみたて8資産均等バランス | 2,480,394,359 円 |
| つみたて4資産均等バランス | 942,179,940 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,878,700 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 3,339,544 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 7,571,514 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金) | 161,413,145 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 221,288,020 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 157,837,130 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15) | 57,845,394 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式40) | 484,784,588 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65) | 1,466,172,459 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本) | 65,423,215,056 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型) | 775,334,515 円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式) | 5,067,319,198 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カンントリー) | 453,270,313,831 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 154,965,599 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 38,312,113 円 |
| つみたて全世界株式 | 3,930,788,129 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 76,246,298 円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式 | 2,492,627,633 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 66,176,807 円 |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け) | 2,198,617,761 円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド | 67,411,446 円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 4,289,873 円 |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け) | 6,631,342 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金) | 1,316,173 円 |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド | 34,212,054,018 円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 7,057,314,867 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型) | 443,065,236 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型) | 1,019,077,020 円 |

| | |
|--|----------------|
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 166,931,269円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) | 670,705,945円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型) | 116,694,125円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 384,217,003円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 75,973,449円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 113,497,395円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 514,570,451円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 442,253,309円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 946,985,346円 |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定) | 1,045,880,790円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 3,975,653円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 2,546,400,579円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 24,911,379円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 515,538,516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) | 8,286,379,968円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 53,811円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 404,996,946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) | 4,159,135,599円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 5,976,634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) | 1,447,849,566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) | 439,880,202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) | 108,569,803円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 51,749,371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) | 1,419,865,475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) | 65,573,408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) | 2,569,983,634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) | 77,065,196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) | 6,728,825,608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) | 13,460,605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 | 9,940,180,533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) | 314,710,363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) | 169,242,050円 |
| グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定) | 1,972,885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) | 57,634,025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 | 2,985,320,662円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 569,114円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 1,387,441円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 372,582円 |

| | |
|---|------------------|
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA | 1,567,352円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA | 19,911,252円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定） | 631,740円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定） | 5,523,319円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定） | 611,354円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定） | 6,482,956円 |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド | 7,345,576,554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） | 67,146,637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） | 292,294,014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） | 325,339,441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） | 349,194,495円 |
| 合計 | 841,155,258,516円 |
| 2. 受益権の総数 | 841,155,258,516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7月26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>（3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

（有価証券に関する注記）

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7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等（円） | | 時価（円） | 評価損益（円） |
|------|----------|-----------------|-------|-----------------|----------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 151,428,541,286 | — | 147,523,239,944 | △3,905,301,342 |
| 合計 | | 151,428,541,286 | — | 147,523,239,944 | △3,905,301,342 |

（注）時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

- 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[2024年7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|-------------|---------------|-------------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカドル | 2,220,431,488 | — | 2,231,869,547 | △11,438,059 |
| | カナダドル | 88,105,416 | — | 88,513,849 | △408,433 |
| | オーストラリアドル | 65,053,262 | — | 65,244,968 | △191,706 |
| | イギリスポンド | 105,162,568 | — | 105,370,473 | △207,905 |
| | スイスフラン | 79,537,815 | — | 80,238,983 | △701,168 |
| | スウェーデンクローネ | 28,760,928 | — | 28,763,354 | △2,426 |
| | イスラエルシケル | 32,228,121 | — | 32,108,236 | 119,885 |
| ユーロ | 289,798,736 | — | 291,641,795 | △1,843,059 | |
| 合計 | | 2,909,078,334 | — | 2,923,751,205 | △14,672,871 |

(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7月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 7.1563円 |
| (1万口当たり純資産額) | (71,563円) |

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

資産の部

| 流動資産 | |
|--------------|-----------------|
| 預金 | 10,892,100,974 |
| コール・ローン | 3,132,261,686 |
| 株式 | 871,613,950,721 |
| 投資証券 | 974,127,626 |
| 派生商品評価勘定 | 14,928,221 |
| 未収入金 | 26,712,404 |
| 未収配当金 | 4,421,715,886 |
| 未収利息 | 5,656 |
| 差入委託証拠金 | 6,266,108,269 |
| 流動資産合計 | 897,341,911,443 |
| 資産合計 | 897,341,911,443 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 676,909,196 |
| 未払金 | 4,894,054,681 |
| 未払解約金 | 346,994,731 |
| 流動負債合計 | 5,917,958,608 |
| 負債合計 | 5,917,958,608 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 224,974,798,088 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金 (△) | 666,449,154,747 |
| 元本等合計 | 891,423,952,835 |
| 純資産合計 | 891,423,952,835 |
| 負債純資産合計 | 897,341,911,443 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | [2024年7月26日現在] |
|---------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 179,683,584,344円 |
| 期中追加設定元本額 | 48,767,330,310円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,476,116,566円 |
| 元本の内訳※ | |
| MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信 | 1,381,422,293円 |
| eMAXIS 新興国株式インデックス | 10,210,420,387円 |

| | |
|--------------------------------------|-------------------|
| eMAXIS バランス (8資産均等型) | 1,635,542,717 円 |
| eMAXIS バランス (波乗り型) | 117,740,676 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金) | 571,999,163 円 |
| eMAXIS Slim バランス (8資産均等型) | 8,955,525,836 円 |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス つみたて新興国株式 | 42,250,937,183 円 |
| つみたて8資産均等バランス | 9,365,155,962 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 4,484,354,133 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 565,309 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 1,392,624 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本) | 7,502,646 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型) | 14,308,705,717 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カンントリー) | 1,407,503,495 円 |
| 新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け) | 98,946,458,952 円 |
| つみたて全世界株式 | 4,155,197,194 円 |
| ラップ向けインデックスf 新興国株式 | 861,137,604 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 987,233,020 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型) | 32,396,019 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型) | 1,400,322,620 円 |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド | 1,631,455,340 円 |
| 新興国株式インデックスオープン | 17,395,905,192 円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 420,446,779 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 1,540,619,838 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 286,124,095 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 34,078,014 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 214,681,412 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 234,891,295 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) | 945,084,375 円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 899,826,620 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) | 18,796,172 円 |
| グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定) | 36,534,431 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) | 430,918 円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 12,589,862 円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 46,603,672 円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定) | 46,280,543 円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定) | 46,049,309 円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 40,750,531 円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定) | 42,136,140 円 |
| 合計 | 224,974,798,088 円 |
| 2. 受益権の総数 | 224,974,798,088 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7月26日現在] |
|----------------------|------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 |

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

(有価証券に関する注記)
 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7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------------|----------------|-------|----------------|--------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 19,755,383,096 | — | 19,079,356,585 | △676,026,511 |
| 合計 | | 19,755,383,096 | — | 19,079,356,585 | △676,026,511 |

(注) 時価の算定方法

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

通貨関連

[2024年7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|------------------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 アメリカドル | 3,008,823,971 | — | 3,022,882,507 | 14,058,536 |
| | 売建 オフショア元 | 1,784,151 | — | 1,797,151 | △13,000 |
| 合計 | | 3,010,608,122 | — | 3,024,679,658 | 14,045,536 |

(注) 時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - 為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
 - 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

(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7月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 3,9623円 |
| (1万口当たり純資産額) | (39,623円) |

(追加情報)

| 自 2024年1月27日 至 2024年7月26日 |
|---|
| <p>当ファンドは、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、「当該株式」）を組み入れております。2022年2月24日に発生したロシアのウクライナ侵攻による当ファンドへの影響は以下の通りです。</p> <p>ロシアが、2022年2月24日に首都キーウを含むウクライナ国内の複数の都市への軍事侵攻に踏み切った以降、期末日時点においてロシア軍とウクライナ軍の戦闘が続いております。</p> <p>2022年2月24日以降、ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やSWIFTからの除外による取引後の受渡が行えない状況となり、市場でのロシア関連資産の取引が成立しない状況となりました。このため、組入株式の時価については金融商品取引所等における最終相場で評価していますが、当該株式の取引停止等に伴い、取引停止日以降の最終相場の価格が入手できない状況となりました。当該株式のロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引についても、実現が困難な状況となっております。</p> <p>時価の算定に関する会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る時価は秩序ある取引が行われると想定した場合の出口価格である必要があり、上記状況を総合的に勘案した結果、当ファンドが組み入れている当該株式において、2022年3月14日付けで評価額をゼロとすることとし、期末日時点においても当該取り扱いを継続しております。2022年3月11日時点の当ファンドにおける当該株式の保有割合は0.55%です。</p> <p>なお、2022年3月24日にモスクワ証券取引所は一部取引を再開しておりますが、ロシア国外の投資家による取引が制限されており、当該株式に係る証券決済や為替取引について、実現が困難な状況に変わりありません。</p> <p>今後、当該株式のロシア国外の投資家による取引の再開、市場の流動性の回復、最終相場価格の提供再開、ならびに当該株式に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価額をゼロから回復させる可能性もあります。</p> |

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

| 資産の部 | |
|---------|-----------------|
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 5,663,968,144 |
| 国債証券 | 800,586,951,440 |
| 地方債証券 | 49,697,647,040 |
| 特殊債券 | 39,499,997,602 |
| 社債券 | 59,009,483,000 |
| 未収入金 | 3,035,924,000 |
| 未収利息 | 1,642,465,948 |
| 前払金 | 15,760,000 |
| 前払費用 | 100,328,008 |
| 差入委託証拠金 | 34,226,646 |
| 流動資産合計 | 959,286,751,828 |

| | |
|-------------|-----------------|
| 資産合計 | 959,286,751,828 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 13,941,505 |
| 未払金 | 1,290,557,000 |
| 未払解約金 | 1,351,380,419 |
| 流動負債合計 | 2,655,878,924 |
| 負債合計 | 2,655,878,924 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 768,502,608,869 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 188,128,264,035 |
| 元本等合計 | 956,630,872,904 |
| 純資産合計 | 956,630,872,904 |
| 負債純資産合計 | 959,286,751,828 |

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7月26日現在] |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 608,533,464,538円 |
| 期中追加設定元本額 | 200,687,788,854円 |
| 期中一部解約元本額 | 40,718,644,523円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 8,112,589,418円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 12,843,684,803円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 3,616,867,627円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 59,660,204,015円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 115,190,396,348円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 39,611,166,477円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 223,700,644円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 212,210,476円 |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド | 1,679,579,109円 |
| eMAXIS 国内債券インデックス | 6,148,661,704円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 4,947,233,289円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 94,565,296円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 20,058,461,598円 |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金) | 42,913,042,699円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 12,211,995,410円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 6,100,528,283円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 2,872,206,485円 |

| | |
|--|-------------------|
| eMAXIS Slim 国内債券インデックス | 19,022,703,775 円 |
| 国内債券セレクション (ラップ向け) | 5,608,998,231 円 |
| eMAXIS Slim バランス (8資産均等型) | 27,323,106,124 円 |
| つみたて8資産均等バランス | 13,736,620,772 円 |
| つみたて4資産均等バランス | 5,479,716,370 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 22,316,531 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 16,384,194 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 541,682 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金) | 7,218,991,651 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 3,365,316,628 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 1,368,669,715 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15) | 7,835,672,623 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式40) | 8,232,779,300 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65) | 5,599,049,335 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 1,064,248,025 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 1,471,915,639 円 |
| 国内債券インデックスファンド (ラップ向け) | 934,440,964 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 524,387,742 円 |
| ラップ向けインデックスf 国内債券 | 6,812,013,292 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 2,344,764,362 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 14,595,052 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金) | 8,917,049 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) | 78,063,593 円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 2,245,105,987 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 2,265,951,217 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 1,346,683,181 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 2,542,521,377 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 159,100,660 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 68,125,914 円 |
| 三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定) | 5,572,978,877 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 28,850,401 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 9,202,447,087 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 609,779,981 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 4,674,595,732 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) | 183,461,651,089 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定) | 475,934,550 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 1,673,192 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 320,173 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 4,452,127,567 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 2,486,108,246 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) | 2,373,014,600 円 |

| | |
|--|-----------------|
| 世界8資産バランスファンドV L (適格機関投資家限定) | 659,139,418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) | 31,261,308,084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) | 1,680,407,460円 |
| マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 2,156,260円 |
| 日本債券インデックスファンドS | 6,103,935,191円 |
| グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定) | 12,971,101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) | 9,088,555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 | 19,691,951円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 23,549,907円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 3,620,358円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 10,249,957円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 19,156,054円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 50,128,541円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 9,801,149円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 32,954,991円 |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド | 4,230,893,174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) | 2,323,320,110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) | 4,942,244,229 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) | 3,173,006,368 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) | 2,302,165,879 円 |
| 合計 | 768,502,608,869 円 |
| 2. 受益権の総数 | 768,502,608,869 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7月26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はあります。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(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7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|--------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 買建 | 3,298,780,000 | — | 3,284,860,000 | △13,920,000 |
| | 合計 | 3,298,780,000 | — | 3,284,860,000 | △13,920,000 |

(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7月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.2448 円 |
| (1万口当たり純資産額) | (12,448 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7月26日現在]

| | |
|-------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 3,328,388,967 |
| コール・ローン | 3,642,490,967 |
| 国債証券 | 646,764,907,362 |
| 派生商品評価勘定 | 108 |
| 未収入金 | 1,713,840 |
| 未収利息 | 5,239,743,486 |
| 前払費用 | 658,789,630 |
| 流動資産合計 | 659,636,034,360 |
| 資産合計 | 659,636,034,360 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 132,330,646 |
| 未払金 | 156,437,693 |
| 未払解約金 | 658,242,724 |
| 流動負債合計 | 947,011,063 |
| 負債合計 | 947,011,063 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 242,154,492,738 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 416,534,530,559 |
| 元本等合計 | 658,689,023,297 |
| 純資産合計 | 658,689,023,297 |
| 負債純資産合計 | 659,636,034,360 |

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7月26日現在] |
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 206,647,867,531円 |
| 期中追加設定元本額 | 51,824,637,279円 |

| | |
|----------------------------------|------------------|
| 期中一部解約元本額 | 16,318,012,072 円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型） | 268,377,806 円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型） | 677,796,769 円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型） | 471,570,755 円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン | 794,251,205 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金） | 1,973,624,085 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金） | 6,078,868,984 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金） | 5,164,477,696 円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型） | 509,119,898 円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型） | 95,644,770 円 |
| ファンド・マネジャー（海外債券） | 638,383,364 円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス | 6,645,549,623 円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型） | 2,420,957,247 円 |
| eMAXIS バランス（波乗り型） | 211,680,514 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金） | 1,058,546,509 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 418,291,508 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 258,779,849 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 178,893,666 円 |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス | 53,949,249,983 円 |
| 海外債券セレクション（ラップ向け） | 3,197,362,310 円 |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型） | 13,247,320,894 円 |
| つみたて8資産均等バランス | 6,649,056,451 円 |
| つみたて4資産均等バランス | 2,534,085,959 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 5,111,272 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 3,814,563 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 725,841 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 243,403,396 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 175,723,189 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 102,093,719 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式15） | 777,641,057 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式40） | 1,303,412,772 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式65） | 2,190,019,408 円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス（先進国債券） | 2,768,952,198 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 91,121,005 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25） | 171,694,469 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 44,995,591 円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国債券 | 3,345,395,052 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式80） | 48,524,799 円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 35,994,638 円 |
| アクティブアロケーションファンド（ラップ向け） | 55,713,257 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金） | 772,848 円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン（確定拠出年金） | 3,199,614,761 円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン（毎月分配型） | 15,905,541,724 円 |
| ワールド・インカムオープン | 937,503,256 円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド | 15,420,579,974 円 |

| | |
|--|------------------|
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型) | 381,454,854円 |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型) | 2,442,171,795円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 1,038,201,380円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 553,429,410円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 307,044,915円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 588,303,290円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 246,390,714円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 91,443,063円 |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定) | 947,590,132円 |
| 三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定) | 8,774,645円 |
| MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定) | 761,398,330円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 10,709,156円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 1,384,658,755円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 1,047,735,900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) | 48,891,841,064円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定) | 432,088,393円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 372,713円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 100,210円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定) | 1,138,939,018円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 29,936,841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) | 735,473,134円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 34,784,432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) | 4,360,027,365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) | 33,906,959円 |
| 海外債券インデックスファンドS | 6,355,392,493円 |
| グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定) | 5,986,410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 | 1,533,506円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 2,504,478円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 500,819円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 848,319円 |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA | 4,217,231円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 3,423,562円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 7,479,279円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 3,309,681円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 8,819,715円 |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド | 1,743,666,878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) | 181,156,325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) | 526,644,328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) | 439,087,959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) | 188,527,096円 |
| 合計 | 242,154,492,738円 |

| | |
|-----------|-------------------|
| 2. 受益権の総数 | 242,154,492,738 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7月26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありませぬ。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[2024年7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|-----------|-----------|---------------|-------|---------------|--------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | | | | |
| | アメリカドル | 3,207,660,000 | — | 3,077,954,000 | △129,706,000 |
| | オフショア円 | 74,951,530 | — | 74,317,950 | △633,580 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカドル | 285,551,850 | — | 286,537,774 | △985,924 |
| | カナダドル | 8,916,960 | — | 8,917,160 | △200 |
| | オーストラリアドル | 8,066,320 | — | 8,066,376 | △56 |
| | イギリスポンド | 33,626,120 | — | 33,669,318 | △43,198 |
| | ユーロ | 211,408,670 | — | 212,370,250 | △961,580 |
| | 合計 | 3,830,181,450 | — | 3,701,832,828 | △132,330,538 |

(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7月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.7201円 |
| (1万口当たり純資産額) | (27,201円) |

新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

| | |
|-------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,564,984,737 |
| コール・ローン | 92,023,434 |
| 国債証券 | 97,371,353,852 |
| 派生商品評価勘定 | 617,304 |
| 未収入金 | 252,602,388 |
| 未収利息 | 1,431,779,194 |
| 前払費用 | 178,179,780 |
| 流動資産合計 | 100,891,540,689 |
| 資産合計 | 100,891,540,689 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 62,402 |
| 前受収益 | 99,558 |
| 未払金 | 123,655,505 |
| 未払解約金 | 25,668,385 |
| 流動負債合計 | 149,485,850 |
| 負債合計 | 149,485,850 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 54,769,397,082 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 45,972,657,757 |
| 元本等合計 | 100,742,054,839 |
| 純資産合計 | 100,742,054,839 |
| 負債純資産合計 | 100,891,540,689 |

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7月26日現在] |
|-----------------------------------|-----------------|
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 49,510,869,131円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,455,730,682円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,197,202,731円 |
| 元本の内訳※ | |
| eMAXIS バランス (8資産均等型) | 3,545,559,839円 |
| eMAXIS バランス (波乗り型) | 311,563,916円 |
| 三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金) | 1,261,308,348円 |
| 海外債券セレクション (ラップ向け) | 722,068,741円 |
| eMAXIS Slim バランス (8資産均等型) | 19,504,428,016円 |
| つみたて8資産均等バランス | 9,798,392,908円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,250,067円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 2,038,896円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 1,427,886円 |
| ラップ向けインデックスf 新興国債券 | 3,089,396,931円 |
| eMAXIS 新興国債券インデックス | 3,178,712,726円 |
| 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド | 12,415,196,820円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 75,309,781円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 314,987,693円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 310,524,324円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 179,319,046円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 6,099,084円 |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 10,364,781円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 41,447,279円 |
| 合計 | 54,769,397,082円 |
| 2. 受益権の総数 | 54,769,397,082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7月26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
通貨関連

[2024年7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------------|-------------|-------|-------------|----------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | インドネシアルピア | 47,471,183 | — | 47,747,617 | 276,434 |
| | メキシコペソ | 26,681,970 | — | 26,729,470 | 47,500 |
| | チェココルナ | 13,073,600 | — | 13,184,000 | 110,400 |
| | ハンガリーフォリント | 5,586,100 | — | 5,537,298 | △48,802 |
| | ポーランドズロチ | 15,456,920 | — | 15,602,240 | 145,320 |
| | 南アフリカランド | 16,734,000 | — | 16,766,120 | 32,120 |
| | 中国元 | 36,126,700 | — | 36,127,380 | 680 |
| | トルコリラ | 3,253,040 | — | 3,244,290 | △8,750 |
| 合計 | | 164,383,513 | — | 164,938,415 | 554,902 |

(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7月26日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.8394円 |
| (1万口当たり純資産額) | (18,394円) |

東証REIT指数マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

| 資産の部 | |
|-------------|-----------------|
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 2,748,086,069 |
| 投資証券 | 118,084,178,030 |
| 未収配当金 | 828,565,212 |
| 未収利息 | 4,963 |
| 前払金 | 7,265,000 |
| その他未収収益 | 220,033 |
| 差入委託証拠金 | 83,411,336 |
| 流動資産合計 | 121,751,730,643 |
| 資産合計 | 121,751,730,643 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 2,819,250 |
| 未払解約金 | 17,530,132 |
| 未払利息 | 120,632 |
| 受入担保金 | 2,103,881,325 |
| 流動負債合計 | 2,124,351,339 |
| 負債合計 | 2,124,351,339 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 35,077,782,712 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 84,549,596,592 |
| 元本等合計 | 119,627,379,304 |
| 純資産合計 | 119,627,379,304 |
| 負債純資産合計 | 121,751,730,643 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | [2024年7月26日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 28,967,583,332円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,733,346,108円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,623,146,728円 |
| 元本の内訳※ | |
| eMAXIS 国内リートインデックス | 4,193,487,518円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,946,854,717円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 171,049,950円 |
| 三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド | 761,249,504円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 518,620,285円 |
| J-REITインデックスファンド(ラップ向け) | 62,480,022円 |
| オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け) | 889,269,208円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 10,737,610,316円 |

| | |
|--|----------------|
| つみたて8資産均等バランス | 5,394,555,339円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 914,802円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 1,699,200円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 781,173円 |
| eMAXIS Slim 国内リートインデックス | 5,602,919,227円 |
| ラップ向けインデックスf 国内リート | 685,378,837円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 137,186,187円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型) | 1,299,823,062円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型) | 190,872,755円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 4,660,971円 |
| 三菱UFJ 国内リートインデックスファンド | 65,370,680円 |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け) | 7,718,798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 | 1,554,509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 | 12,606,656円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 2,964,387円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型) | 16,263,810円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 33,520,254円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 55,865,294円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 263,516,964円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 230,466,125円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 98,851,896円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 17,042,278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) | 241,171円 |
| MUKAM 3資産インカムバランスファンド (適格機関投資家転売制限付) | 383,566,480円 |
| 日本リートインデックスファンドS | 597,917,684円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 36,726,590円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 36,230,204円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定) | 36,241,552円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定) | 36,025,976円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 36,223,712円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定) | 36,352,007円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定) | 35,722,908円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定) | 35,571,556円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定) | 36,160,507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) | 37,092,372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) | 38,938,060円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定) | 40,203,912円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定) | 41,261,256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) | 41,579,926円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定) | 41,642,416円 |

| | |
|---|------------------|
| 格機関投資家限定) | |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定) | 41,643,078 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) | 41,636,571 円 |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定) | 41,650,050 円 |
| 合計 | 35,077,782,712 円 |
| 2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 投資証券 | 1,997,284,100 円 |
| 3. 受益権の総数 | 35,077,782,712 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7月26日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[2024年7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等 (円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|-------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 1,519,114,000 | — | 1,516,314,000 | △2,800,000 |
| 合計 | | 1,519,114,000 | — | 1,516,314,000 | △2,800,000 |

(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7月26日現在] |
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 3.4103円 (34,103円) |

MUAM G-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年7月26日現在]

| | |
|-------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 2,504,929,335 |
| コール・ローン | 129,736,336 |
| 投資証券 | 134,309,695,812 |
| 派生商品評価勘定 | 177,033,909 |
| 未収配当金 | 209,884,956 |
| 未収利息 | 234 |
| 差入委託証拠金 | 881,054,594 |
| 流動資産合計 | 138,212,335,176 |
| 資産合計 | 138,212,335,176 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,843,681 |
| 未払解約金 | 151,499,164 |
| 流動負債合計 | 153,342,845 |
| 負債合計 | 153,342,845 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 48,758,929,467 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 89,300,062,864 |
| 元本等合計 | 138,058,992,331 |
| 純資産合計 | 138,058,992,331 |
| 負債純資産合計 | 138,212,335,176 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | [2024年7月26日現在] |
|---|-----------------|
| 1. 期首 | 2024年1月27日 |
| 期首元本額 | 45,744,488,251円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,955,754,780円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,941,313,564円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 99,603,258円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 92,925,886円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型) | 25,613,843円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型) | 50,169,379円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型) | 23,224,114円 |
| eMAXIS 先進国リートインデックス | 5,845,764,963円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 2,324,051,665円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 199,903,563円 |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド | 3,278,090,233円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 630,053,740円 |
| オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け) | 2,027,973,131円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 12,915,748,068円 |
| つみたて8資産均等バランス | 6,479,399,381円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,086,019円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 2,012,501円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 912,946円 |
| eMAXIS Slim 先進国リートインデックス | 10,768,225,193円 |
| 三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド | 109,160,875円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート | 935,936,431円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 31,626,896円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 763,559,488円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 336,673,531円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート(為替ヘッジあり) | 259,898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 | 230,564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 | 5,474,045円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型) | 12,475,937円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型) | 36,211,802円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー) | 39,827,224円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 66,474,622円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 313,807,503円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 274,819,422円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 114,991,663円 |
| 世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定) | 20,703,718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) | 87,011円 |
| 海外リートインデックスファンドS | 918,551,326円 |
| 先進国リートインデックスオープンV(適格機関投資家限定) | 13,299,628円 |
| 合計 | 48,758,929,467円 |
| 2. 受益権の総数 | 48,758,929,467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7月26日現在] |
|---------------------|------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |

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

(有価証券に関する注記)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
投資証券関連

[2024年7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|-------------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 買建 | 3,602,572,968 | — | 3,777,943,623 | 175,370,655 |
| 合計 | | 3,602,572,968 | — | 3,777,943,623 | 175,370,655 |

(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7月26日現在]

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|-----------|------------------------|------------|-------|------------|---------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 アメリカドル | 28,035,644 | — | 28,034,752 | △892 |
| | 売建 アメリカドル | 11,648,596 | — | 11,708,582 | △59,986 |
| | オーストラリアドル | 8,445,990 | — | 8,470,753 | △24,763 |
| | ニュージーランドドル | 3,084,310 | — | 3,084,119 | 191 |
| | ユーロ | 14,955,345 | — | 15,050,322 | △94,977 |

| | | | | |
|----|------------|---|------------|----------|
| 合計 | 66,169,885 | — | 66,348,528 | △180,427 |
|----|------------|---|------------|----------|

(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7月26日現在] |
| 1口当たり純資産額 | 2.8315円 |
| (1万口当たり純資産額) | (28,315円) |

2【ファンドの現況】

【eMAXIS バランス（波乗り型）】

【純資産額計算書】

2024年7月31日現在

(単位：円)

| | |
|-------------------------|----------------|
| I 資産総額 | 4,589,268,822 |
| II 負債総額 | 9,685,571 |
| III 純資産総額 (I - II) | 4,579,583,251 |
| IV 発行済口数 | 1,859,566,279口 |
| V 1口当たり純資産価額 (III / IV) | 2.4627 |
| (10,000口当たり) | (24,627) |

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

| | |
|--------------------|-------------------|
| I 資産総額 | 1,601,497,667,234 |
| II 負債総額 | 51,538,500,564 |
| III 純資産総額 (I - II) | 1,549,959,166,670 |

| | |
|--------------------|------------------|
| IV 発行済口数 | 451,652,779,706口 |
| V 1口当たり純資産価額 (Ⅲ/Ⅳ) | 3.4317 |
| (10,000口当たり) | (34,317) |

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7月31日現在

(単位：円)

| | |
|--------------------|-------------------|
| I 資産総額 | 6,018,604,062,820 |
| II 負債総額 | 3,950,196,949 |
| III 純資産総額 (I - II) | 6,014,653,865,871 |
| IV 発行済口数 | 843,820,834,651口 |
| V 1口当たり純資産価額 (Ⅲ/Ⅳ) | 7.1279 |
| (10,000口当たり) | (71,279) |

新興国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

| | |
|--------------------|------------------|
| I 資産総額 | 886,663,843,107 |
| II 負債総額 | 1,193,253,891 |
| III 純資産総額 (I - II) | 885,470,589,216 |
| IV 発行済口数 | 226,079,280,822口 |
| V 1口当たり純資産価額 (Ⅲ/Ⅳ) | 3.9166 |
| (10,000口当たり) | (39,166) |

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7月31日現在

(単位：円)

| | |
|--------------------|------------------|
| I 資産総額 | 963,209,864,827 |
| II 負債総額 | 6,876,083,743 |
| III 純資産総額 (I - II) | 956,333,781,084 |
| IV 発行済口数 | 769,145,686,189口 |
| V 1口当たり純資産価額 (Ⅲ/Ⅳ) | 1.2434 |
| (10,000口当たり) | (12,434) |

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7月31日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------------|------------------|
| I 資産総額 | 656,256,655,600 |
| II 負債総額 | 1,534,964,404 |
| III 純資産総額 (I - II) | 654,721,691,196 |
| IV 発行済口数 | 242,296,010,466口 |
| V 1口当たり純資産価額 (III/IV) | 2.7022 |
| (10,000口当たり) | (27,022) |

新興国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------------|-----------------|
| I 資産総額 | 100,286,822,961 |
| II 負債総額 | 172,537,109 |
| III 純資産総額 (I - II) | 100,114,285,852 |
| IV 発行済口数 | 54,920,108,709口 |
| V 1口当たり純資産価額 (III/IV) | 1.8229 |
| (10,000口当たり) | (18,229) |

東証REIT指数マザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------------|-----------------|
| I 資産総額 | 124,171,588,046 |
| II 負債総額 | 3,028,318,652 |
| III 純資産総額 (I - II) | 121,143,269,394 |
| IV 発行済口数 | 35,133,369,489口 |
| V 1口当たり純資産価額 (III/IV) | 3.4481 |
| (10,000口当たり) | (34,481) |

MUAM G-REITマザーファンド

純資産額計算書

2024年7月31日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------------|-----------------|
| I 資産総額 | 140,421,983,098 |
| II 負債総額 | 142,618,964 |
| III 純資産総額 (I - II) | 140,279,364,134 |
| IV 発行済口数 | 48,840,395,663口 |
| V 1口当たり純資産価額 (III/IV) | 2.8722 |
| (10,000口当たり) | (28,722) |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

2024年7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ファンドに關係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に關する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に關する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を

担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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7月31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 | 829 | 35,602,157 |
| 追加型公社債投資信託 | 16 | 1,535,876 |
| 単位型株式投資信託 | 94 | 419,510 |
| 単位型公社債投資信託 | 48 | 101,839 |
| 合計 | 987 | 37,659,382 |

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

3 【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ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。

なお、財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 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。

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、継続企業的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。

(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、記載していません。

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 役員の兼任 | 投資助言料 (注3) | 463,416 千円 | 未払費用 | 253,093 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 役員の兼任 | 投資助言料 (注3) | 463,831 千円 | 未払費用 | 260,800 千円 |

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、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第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 |

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通常の見積り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

eMAXIS バランス（波乗り型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

eMAXIS バランス (波乗り型)

運用の基本方針

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

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、公社債および上場投資信託証券(不動産投資信託証券を含みます。)に直接投資することがあります。

(2) 投資態度

① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証REIT指数マザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券等への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

② 各投資対象資産への実質的な基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して以下の比率とします。なお、国内株式、先進国株式、新興国株式および国内債券への実質的な投資にあたっては、市況動向等を勘案し、以下の範囲内で機動的に資金を配分します。

| | |
|--------------|----------|
| 国内株式 | ・・・5～35% |
| 先進国株式 | ・・・5～35% |
| 新興国株式 | ・・・5～35% |
| 国内債券 | ・・・5～35% |
| 先進国債券 | ・・・12.5% |
| 新興国債券 | ・・・12.5% |
| 国内不動産投資信託証券 | ・・・12.5% |
| 先進国不動産投資信託証券 | ・・・12.5% |

③ 組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等を活用する場合があります。

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は行いません。

⑤ 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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

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

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

- ⑤外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
- ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑧金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑨外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- 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減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

追加型証券投資信託
『eMAXIS バランス（波乗り型）』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

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

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

(信託事務の委託)

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

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

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金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1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

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

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

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

(当初の受益者)

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

(受益権の分割および再分割)

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

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

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

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

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

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

- ③ 第30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

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

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

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

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

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

(受益権の設定に係る受託者の通知)

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

(受益権の申込単位および価額)

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

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

- ③ 委託者は、金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情(投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等)があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受け付けを中

止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け取りを取消することができます。

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

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

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

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

（受益権の譲渡の対抗要件）

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

（投資の対象とする資産の種類等）

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

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権
 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

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

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびM U A M G - R E I T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します。

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

21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
 25. 外国の者に対する権利で前2号の有価証券の性質を有するもの
なお、第1号の証券または証書ならびに第13号および第19号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第16号の証券ならびに第13号および第19号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、前各号に該当するものを除きます。）
 7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
 8. 外国の者に対する権利で前3号の権利の性質を有するもの
- ③ 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の60を超えることとなる投資の指図をしません。
- ④ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- ⑤ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- ⑦ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下本項および次項において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑧ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の

時価総額の割合を乗じて得た額とします。

(利害関係人等との取引等)

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

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

(投資する株式等の範囲)

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

② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができます。

③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式会社について、委託者が議決権行使権限を委託する、または、議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使している場合に限り。）において投資するモルガン・スタンレー株式会社については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。

④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替は委託者と受託者の協議にて定めます。

(信用取引の指図範囲)

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

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

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

(先物取引等の運用指図)

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

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

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

(スワップ取引の運用指図)

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

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

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

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

(金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の運用指図)

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

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

③ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額または価格情報会社の提供する価額で評価する

ものとしします。

- ④ 委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

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

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

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、投資信託証券(金融商品取引所に上場されているものに限り、以下本条において同じ。)および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとしします。
2. 投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとしします。
3. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとしします。

- ② 前項各号に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとしします。

- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとしします。

(有価証券の空売りの指図範囲)

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

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

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

(有価証券の借入れ)

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

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

- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当

する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

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

(外国為替予約取引の指図および範囲)

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

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

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

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

(信託業務の委託等)

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

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

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

1. 信託財産の保存に係る業務

2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

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

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

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

ことがあります。

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

（有価証券売却等の指図）

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

（再投資の指図）

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

（資金の借入れ）

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

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

（損益の帰属）

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

（受託者による資金立替え）

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

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

（信託の計算期間）

第39条 この信託の計算期間は、毎年1月27日から翌年1月26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2011年10月31日から2012年1月26日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間

の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

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

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

(信託事務の諸費用および監査報酬)

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

- ② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

(信託報酬等)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。

- 500億円未満の部分 年10,000分の50
- 500億円以上1,000億円未満の部分 年10,000分の48
- 1,000億円以上の部分 年10,000分の46

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

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

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信

託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。)については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金(第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。)については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとします。当該取得申込みに応じるにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。

- ⑤ 前各項(第2項を除きます。)に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとします。

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

(信託契約の一部解約)

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

ます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

（信託契約の解約）

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

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

同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

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

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

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

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

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

② 委託者は、前項の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に

当たる多数をもって行います。

- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、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54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第54条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

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

(公告)

第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45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満

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

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

第5条 第24条に規定する「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

信託契約締結日 2011年10月31日

(付表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

- ニューヨーク証券取引所の休業日
- ニューヨークの銀行の休業日
- ロンドン証券取引所の休業日
- ロンドンの銀行の休業日
- 香港取引所の休業日
- 香港の銀行の休業日
- オーストラリア証券取引所の休業日
- シドニーの銀行の休業日
- その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント