

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年4月24日提出
【計算期間】	第9期(自 2019年1月29日至 2020年1月27日)
【ファンド名】	eMAXIS バランス(波乗り型)
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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	M M F	インデックス型
		債券		
	海外	不動産投信	M R F	特殊型
		その他資産 ()		
	内外	資産複合	E T F	()

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	年2回	日本			T O P I X	条件付運用型
大型株	年4回	北米			その他 ()	ロング・ ショート型 / 絶対収益 追求型
中小型株	年6回 (隔月)	欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし		その他 ()
債券	年12回	アジア				
一般	(毎月)	オセアニア				
公債		中南米				
社債	日々	アフリカ				
その他債券	その他 ()	中近東 (中東)				
クレジット		エマージング				
属性						
()						
不動産投信						
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、債券、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

については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネジメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（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「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRF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。
決算頻度	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。
	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。
投資対象地域	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。
	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標・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・特色]

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



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(預託証書)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(預託証書)とは、Depository 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-BP複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世界国债インデックス(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プローバル・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>

ステップ1：投資対象ユニバースの作成

→ ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

ステップ2：ポートフォリオ案の作成

モニタリング結果に加えて、ファンドの資金動向やベンチマーク構成の変動などを考慮してポートフォリオ案を作成します。

ステップ3：売買執行

→ 売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

ステップ4：モニタリング

一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

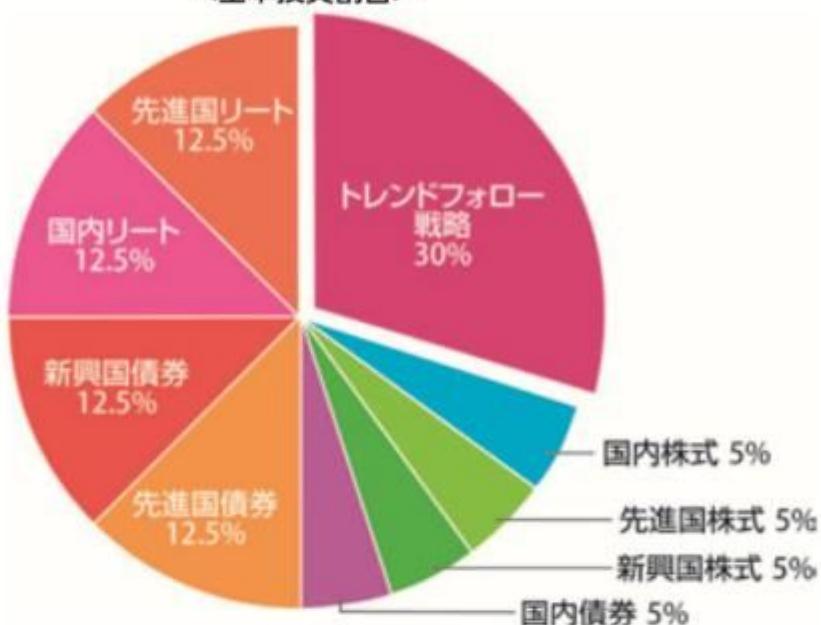
！ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

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

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

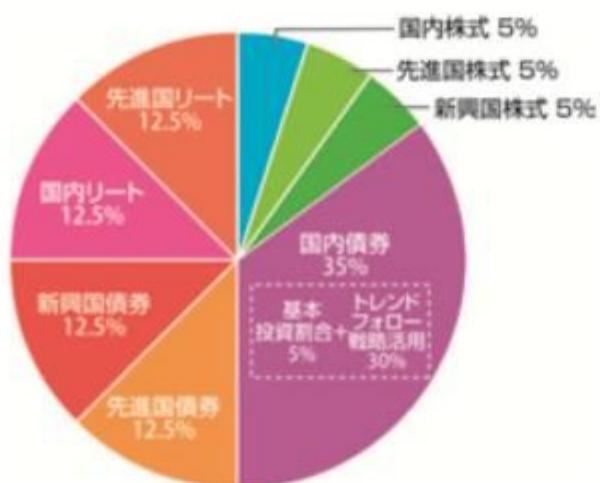
<戦略の目的>

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。

! 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



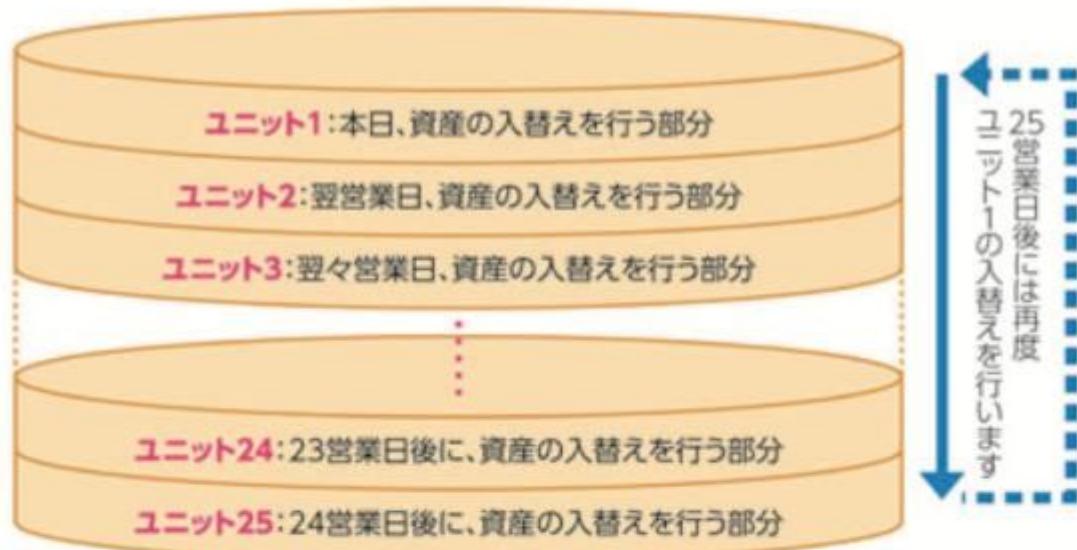
II. 過去の国内株式と先進国株式の運用成績が
好調だった場合



<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。

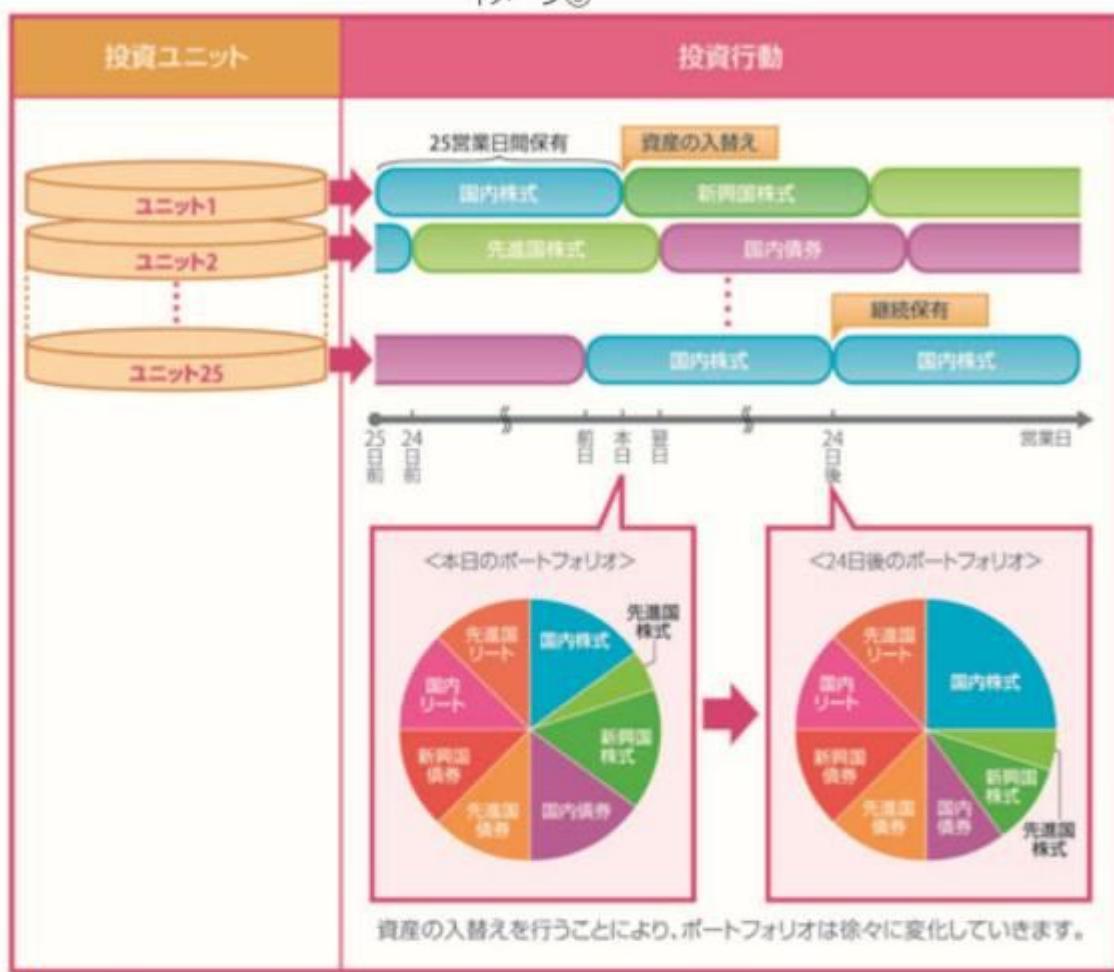
イメージ②

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。

! 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



- 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。
- 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。
- 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が、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。

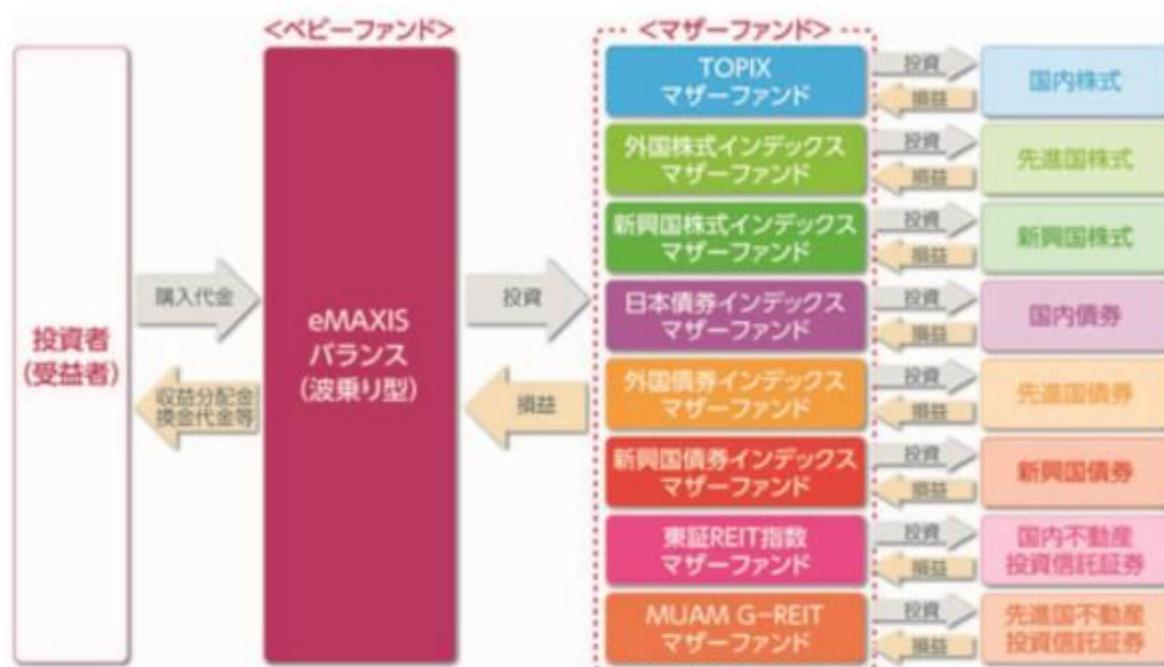
特色3

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	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- 年1回の決算時(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)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- ・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、野村證券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。当該指標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、当該指標の正確性、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、当該指標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)・データに基づき当社が計算したもので、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、当指標の著作権は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標です。
- ・東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数值の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。
- ・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標です。
- ・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、
- ・S&P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC([SPDJI])の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信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SPDJIに、特定目的での利用を許諾するサプライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、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】

委託会社およびファンドの関係法人の役割
投資家(受益者)

お申込金 収益分配金、解約代金等

販売会社	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等を行います。
------	--

お申込金 収益分配金、解約代金等

受託会社(受託者) 三菱UFJ信託銀行株式会社 (再信託受託会社:日本マスター・トラスト信託 銀行株式会社)	委託会社(委託者) 三菱UFJ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

投資 損益

マザーファンド

投資 損益

有価証券等

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。

委託会社の概況(2020年1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ワフ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
- ・大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

(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 - 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。このほか、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証書))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】

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

二. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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国際投信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 - REITマザーファンド(「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。)の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

- 1. 株券または新株引受権証書
- 2. 国債証券
- 3. 地方債証券
- 4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から12.の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16.において同じ。）で16.で定めるもの以外のもの
 16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16.において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1.から23.に該当するものを除きます。）
 25. 外国の者に対する権利で23.および24.の有価証券の性質を有するもの
なお、1.の証券または証書ならびに13.および19.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに16.の証券ならびに13.および19.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- 金融商品の指図範囲
- この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除ます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1.から5.に該当するものを除きます。）
 7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
 8. 外国の者に対する権利で5.から7.の権利の性質を有するもの

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)**投資対象**

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

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)

株式への投資割合に制限を設けません。

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。

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。

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。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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)**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。

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)

株式への投資割合に制限を設けません。

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。

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。

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。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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。

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)

投資対象

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

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)

株式への投資割合に制限を設けません。

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。

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。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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。

外国為替予約取引を行うことができます。

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。

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)

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。

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)

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。

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。

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。

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。

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。

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。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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)

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。

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、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)

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。

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。

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。

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。

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。

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。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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。

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)

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。

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。

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)

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。

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。

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。

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。

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。

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。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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。

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)**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。

投資態度

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

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

株式への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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。

MUAMG - 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)**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。

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。

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)

株式への直接投資は行いません。

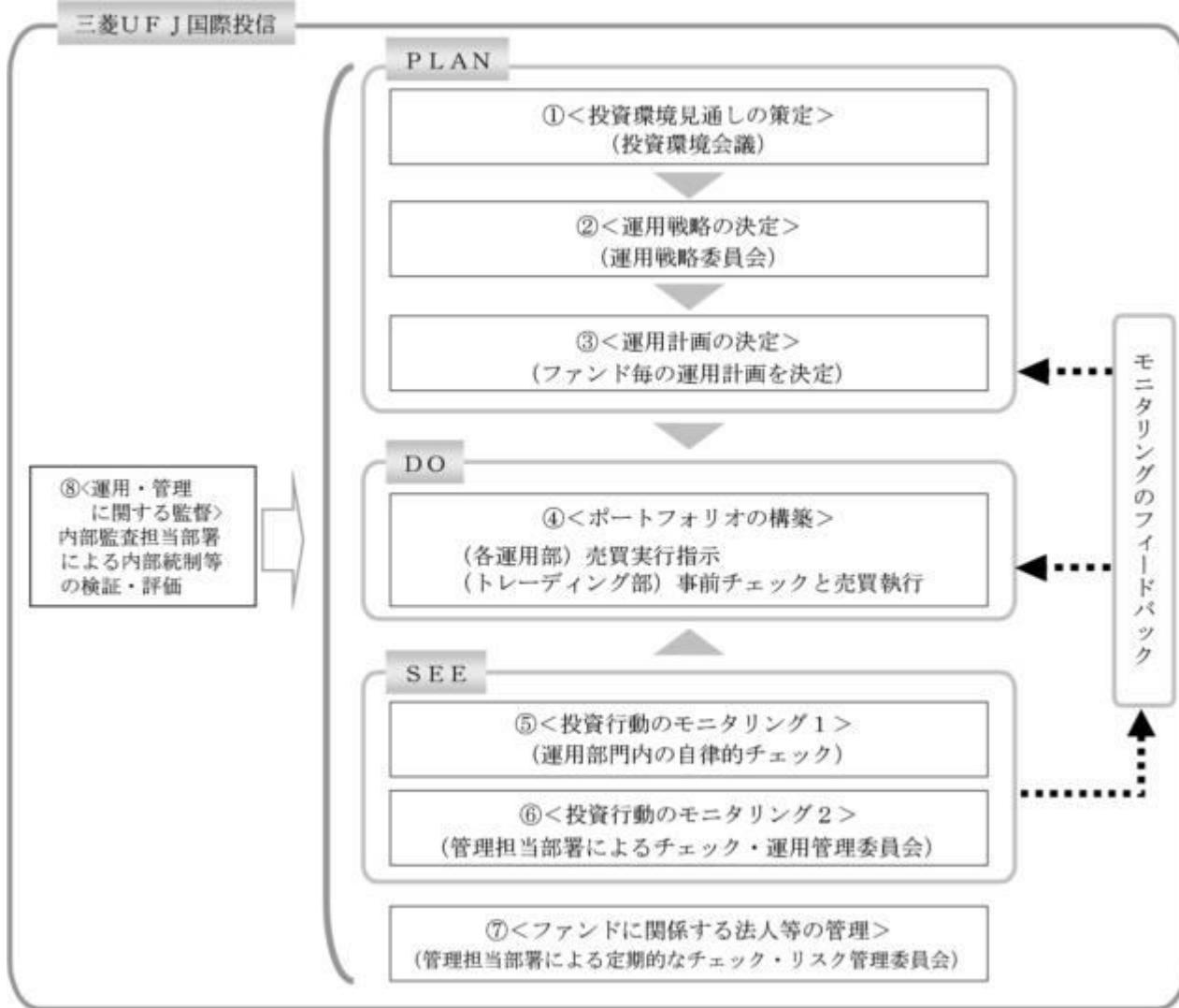
投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

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。

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】



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。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、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。

運用計画の決定

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。

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。

投資行動のモニタリング1

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、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署(40~60名程度)は、運用に関するパフォーマンス測定、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、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、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理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。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(10名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

(4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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。

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。

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>

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。

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。

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。

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。

スワップ取引

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

信用取引

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

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。

有価証券の借入れ

- a . 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b . a . の指図は、当該借入れに係る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。

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。

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。

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け入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

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ます。以下において同じ。）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たときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

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 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。

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。

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。

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- 同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3 【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、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。

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。

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。

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。

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ー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ことがあります。

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・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っています。また、定期的に開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

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。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

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、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

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。

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。

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指數名	注記等
日本株	東証株価指數(TOPIX) (配当込み)	東証株価指數(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指數で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指數です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。
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.が開発した株価指數で、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.が開発した株価指數で、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。
日本債券	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村證券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(純合)のサブインデックスです。当該指數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、当該指數の正確性、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、当該指數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、JP.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數で、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。当指數の著作権はJP.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)海外の指數は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

(2) 【換金(解約)手数料】

かかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.15%）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カ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（税抜）の合計ならびに配分（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（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	0.5%	0.44%	0.06%
500億円以上1,000億円未満の部分	0.48%	0.43%	0.05%
1,000億円以上の部分	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%

上記信託報酬には、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おりません。

(4) 【その他の手数料等】

- 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国

債券インデックスマザーファンド、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAM G-R EIT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。

個人の受益者に対する課税

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

1. 収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

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。

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。

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、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、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2020年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

【eMAXIS バランス（波乗り型）】

(1) 【投資状況】

令和2年1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	3,927,962,547	95.37
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		190,700,168	4.63
純資産総額		4,118,662,715	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】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

令和2年1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	新興国株式インデックスマザーファンド	527,467,782	2.6276	1,385,979,172	2.5249	1,331,803,402	32.34
日本	親投資信託受益証券	東証REIT指数マザーファンド	143,063,868	3.6432	521,210,284	3.7036	529,851,341	12.86
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	244,001,137	2.1351	520,966,828	2.1509	524,822,045	12.74
日本	親投資信託受益証券	MUAM G - REITマザーファンド	273,237,307	1.9061	520,841,901	1.8923	517,046,956	12.55
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	360,991,546	1.4423	520,688,693	1.4295	516,037,415	12.53
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	72,705,540	3.1484	228,909,999	3.1228	227,044,860	5.51
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	95,366,863	1.8739	178,707,965	1.8539	176,800,627	4.29
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	76,715,754	1.3616	104,456,171	1.3629	104,555,901	2.54

(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

令和2年1月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.37
合計	95.37

(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】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和2年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位:円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)

第1計算期間末日	(平成24年 1月26日)	42,391,869	42,391,869	9,968	9,968
第2計算期間末日	(平成25年 1月28日)	453,487,264	453,487,264	12,936	12,936
第3計算期間末日	(平成26年 1月27日)	1,610,204,563	1,610,204,563	14,869	14,869
第4計算期間末日	(平成27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	(平成28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	(平成29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	(平成30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	(平成31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	(令和 2年 1月27日)	4,155,730,755	4,155,730,755	19,737	19,737
	平成31年 1月末日	3,929,639,560		18,264	
	2月末日	3,999,486,538		18,645	
	3月末日	3,976,441,864		18,790	
	4月末日	3,987,341,038		19,058	
	令和 1年 5月末日	3,920,304,709		18,396	
	6月末日	4,012,207,338		18,735	
	7月末日	4,076,845,531		18,963	
	8月末日	3,997,188,239		18,373	
	9月末日	4,054,493,988		18,685	
	10月末日	4,125,426,633		19,316	
	11月末日	4,120,154,785		19,441	
	12月末日	4,151,114,219		19,680	
	令和 2年 1月末日	4,118,662,715		19,479	

【分配の推移】

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

【收益率の推移】

	收益率(%)
第1計算期間	0.32
第2計算期間	29.77

第3計算期間	14.94
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

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

(4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	51,206,550	8,680,675	42,525,875
第2計算期間	422,324,976	114,297,236	350,553,615
第3計算期間	1,700,154,151	967,777,336	1,082,930,430
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

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

令和2年1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	365,316,655,300	99.52
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,779,412,876	0.48
純資産総額		367,096,068,176	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。

他の資産の投資状況

令和2年1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	1,779,740,000	0.48

(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

令和2年1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	1,717,700	7,044.31	12,100,021,734	7,652.00	13,143,840,400	3.58
日本	株式	ソニー	電気機器	973,500	5,788.04	5,634,665,454	7,718.00	7,513,473,000	2.05
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,452,200	555.89	5,810,329,978	568.50	5,942,075,700	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,019,300	2,544.14	5,137,395,666	2,786.50	5,626,779,450	1.53
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,198,600	4,975.27	5,963,360,425	4,524.00	5,422,466,400	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,280,800	4,311.97	5,522,782,371	4,227.00	5,413,941,600	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	139,500	35,245.07	4,916,687,311	37,370.00	5,213,115,000	1.42
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,053,800	3,467.21	3,653,754,145	4,304.00	4,535,555,200	1.24
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,050,100	3,898.96	4,094,304,399	3,884.00	4,078,588,400	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	94,400	37,050.96	3,497,611,482	40,770.00	3,848,688,000	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,125,800	2,761.63	3,109,053,983	3,271.00	3,682,491,800	1.00
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,115,900	2,708.16	3,022,036,050	3,107.00	3,467,101,300	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,212,100	2,952.59	3,578,846,266	2,831.00	3,431,455,100	0.93
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	20,632,200	168.20	3,470,391,210	162.50	3,352,732,500	0.91
日本	株式	信越化学工業	化学	258,900	10,455.61	2,706,957,699	12,715.00	3,291,913,500	0.90
日本	株式	第一三共	医薬品	440,500	5,694.21	2,508,300,723	7,441.00	3,277,760,500	0.89
日本	株式	HOKA	精密機器	307,400	8,468.06	2,603,082,557	10,600.00	3,258,440,000	0.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	543,000	5,638.65	3,061,787,857	5,985.00	3,249,855,000	0.89
日本	株式	花王	化学	368,600	8,513.78	3,138,179,708	8,782.00	3,237,045,200	0.88
日本	株式	日立製作所	電気機器	739,700	3,926.78	2,904,642,340	4,230.00	3,128,931,000	0.85
日本	株式	ダイキン工業	機械	196,100	13,750.19	2,696,413,606	15,635.00	3,066,023,500	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,064,000	2,988.67	3,179,953,354	2,823.00	3,003,672,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	146,300	19,757.39	2,890,507,540	20,320.00	2,972,816,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	452,200	5,638.33	2,549,656,569	6,328.00	2,861,521,600	0.78
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	128,000	23,203.35	2,970,029,502	21,585.00	2,762,880,000	0.75
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,060,500	2,186.92	2,319,233,283	2,568.00	2,723,364,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,354,200	1,680.66	2,275,951,765	1,950.50	2,641,367,100	0.72
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	271,000	10,264.14	2,781,582,849	9,700.00	2,628,700,000	0.72

日本	株式	三井物産	卸売業	1,332,700	1,821.85	2,427,988,435	1,960.50	2,612,758,350	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	185,300	14,420.54	2,672,126,549	14,040.00	2,601,612,000	0.71

(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

令和 2年 1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.27
	建設業	2.84
	食料品	3.82
	繊維製品	0.58
	パルプ・紙	0.23
	化学	7.09
	医薬品	6.08
	石油・石炭製品	0.47
	ゴム製品	0.68
	ガラス・土石製品	0.82
	鉄鋼	0.75
	非鉄金属	0.72
	金属製品	0.57
	機械	5.06
	電気機器	14.47
	輸送用機器	7.59
	精密機器	2.43
	その他製品	2.25
	電気・ガス業	1.48
	陸運業	4.32
	海運業	0.16
	空運業	0.47
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.78
	卸売業	5.03
	小売業	4.53
	銀行業	5.68
	証券、商品先物取引業	0.86
	保険業	2.27
その他金融業	1.22	
不動産業	2.54	
サービス業	5.17	
	小計	99.52

合計	99.52
----	-------

(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の評価金額

令和2年1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 20年03月限	賃貸	106	円	1,794,293,300	1,779,740,000	0.48

(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

令和2年1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	390,837,750,667	65.78
	イギリス	32,688,005,757	5.50
	カナダ	20,990,841,679	3.53
	フランス	20,617,613,782	3.47
	スイス	19,609,081,047	3.30
	ドイツ	17,297,572,018	2.91
	オーストラリア	13,141,256,769	2.21
	オランダ	9,630,312,760	1.62
	香港	6,097,149,610	1.03
	スペイン	5,759,344,673	0.97
	スウェーデン	5,453,379,601	0.92
	イタリア	4,009,517,620	0.67
	デンマーク	3,848,905,256	0.65
	シンガポール	2,297,053,964	0.39
	フィンランド	2,023,307,154	0.34
	ベルギー	1,975,525,608	0.33
	ノルウェー	1,227,069,474	0.21
	アイルランド	1,177,666,754	0.20
	イスラエル	701,035,703	0.12
	ニュージーランド	569,550,202	0.10

ルクセンブルグ	485,479,395	0.08
オーストリア	430,652,416	0.07
ポルトガル	339,878,058	0.06
小計	561,207,949,967	94.45
投資証券		
アメリカ	12,733,274,746	2.14
オーストラリア	1,002,518,733	0.17
イギリス	389,249,785	0.07
フランス	347,426,325	0.06
香港	292,260,150	0.05
シンガポール	289,984,885	0.05
オランダ	266,714,333	0.04
カナダ	173,061,010	0.03
小計	15,494,489,967	2.61
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		17,482,648,266
純資産総額	594,185,088,200	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

令和2年1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	13,382,499,035	2.25
	買建	カナダ	689,628,280	0.12
	買建	ドイツ	2,429,784,513	0.41
	買建	オーストラリア	800,980,913	0.13
	買建	イギリス	1,087,046,396	0.18
	買建	スイス	634,777,305	0.11

(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

令和2年1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	577,906	23,867.78	13,793,333,847	35,321.26	20,412,369,353	3.44

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	927,838	14,739.45	13,675,830,160	18,843.38	17,483,610,322	2.94
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	53,777	202,874.50	10,909,982,127	204,016.36	10,971,387,835	1.85
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	307,628	20,932.97	6,439,569,664	22,851.34	7,029,712,575	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	40,275	132,903.69	5,352,696,128	158,600.50	6,387,635,339	1.08
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	409,093	12,882.16	5,270,004,427	14,820.16	6,062,825,106	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	38,012	131,225.35	4,988,138,171	158,773.91	6,035,313,882	1.02
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	337,565	15,163.70	5,118,735,201	16,398.26	5,535,479,177	0.93
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	220,996	18,450.77	4,077,546,544	22,707.38	5,018,240,725	0.84
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	380,625	11,252.62	4,283,029,820	12,115.26	4,611,374,035	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	320,195	12,211.44	3,910,044,657	13,736.10	4,398,232,781	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	168,561	23,153.43	3,902,766,663	24,852.59	4,189,177,895	0.71
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,131,338	3,332.87	3,770,606,553	3,651.32	4,130,887,022	0.70
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	566,640	5,402.83	3,061,460,951	7,249.21	4,107,697,001	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	115,539	28,667.51	3,312,215,622	35,385.60	4,088,417,716	0.69
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	541,143	8,098.79	4,382,606,547	7,065.99	3,823,715,031	0.64
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	934,521	3,610.97	3,374,533,464	4,082.11	3,814,822,940	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	121,199	27,456.94	3,327,754,350	30,643.67	3,713,983,227	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	140,061	22,241.69	3,115,194,240	25,388.07	3,555,879,509	0.60
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	230,393	15,008.83	3,457,931,028	15,029.55	3,462,705,094	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	529,079	6,317.84	3,342,639,538	6,473.80	3,425,152,477	0.58
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	519,615	5,509.71	2,862,928,585	6,419.27	3,335,549,812	0.56
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	89,896	30,697.56	2,759,588,016	36,788.93	3,307,178,281	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス	327,418	8,897.11	2,913,075,533	9,433.68	3,088,759,912	0.52
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	242,861	13,167.90	3,197,970,430	12,149.28	2,950,587,261	0.50

アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	707,256	4,373.30	3,093,046,908	4,042.85	2,859,332,890	0.48
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	274,756	9,588.06	2,634,379,074	10,373.10	2,850,073,689	0.48
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	547,331	5,622.04	3,077,118,417	5,151.99	2,819,846,247	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	178,816	14,308.67	2,558,619,493	15,686.09	2,804,925,622	0.47
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	535,305	5,297.04	2,835,534,246	5,225.06	2,797,003,206	0.47

(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

令和2年1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	4.73
	素材	3.97
	資本財	6.77
	商業・専門サービス	1.25
	運輸	1.82
	自動車・自動車部品	1.06
	耐久消費財・アパレル	1.83
	消費者サービス	1.70
	メディア・娯楽	5.98
	小売	4.54
	食品・生活必需品小売り	1.43
	食品・飲料・タバコ	4.66
	家庭用品・パーソナル用品	1.99
	ヘルスケア機器・サービス	4.82
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.92
	銀行	7.23
	各種金融	4.43
	保険	3.68
	不動産	0.48
	ソフトウェア・サービス	10.04
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.93
	電気通信サービス	2.21
	公益事業	3.66

半導体・半導体製造装置	3.31
小計	94.45
投資証券	2.61
合計	97.06

(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

令和2年1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 EMINI2003	買建	746	アメリカドル	121,766,947.08	13,279,903,248	122,707,675	13,382,499,035	2.25
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602003	買建	40	カナダドル	8,244,030	681,039,318	8,348,000	689,628,280	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2003	買建	549	ユーロ	20,610,028.6	2,479,386,441	20,197,710	2,429,784,513	0.41
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2003	買建	63	オーストラリアドル	10,908,673.25	799,496,662	10,928,925	800,980,913	0.13
	イギリス	インタークンチネンタル取引所	FTSE100 2003	買建	104	イギリスポンド	7,810,069.8	1,115,824,672	7,608,640	1,087,046,396	0.18
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2003	買建	53	スイスフラン	5,641,808.05	634,534,150	5,643,970	634,777,305	0.11

(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

令和2年1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	香港	22,047,760,499	19.51
	アメリカ	15,241,577,869	13.49
	韓国	12,582,022,796	11.14
	台湾	12,278,436,643	10.87
	インド	9,732,959,689	8.61
	ブラジル	7,852,842,868	6.95
	南アフリカ	4,791,007,291	4.24

中国	4,190,380,162	3.71
サウジアラビア	2,794,085,459	2.47
タイ	2,613,479,280	2.31
メキシコ	2,539,339,172	2.25
インドネシア	2,141,940,356	1.90
マレーシア	1,958,780,636	1.73
フィリピン	990,856,118	0.88
カタール	977,722,496	0.87
ポーランド	925,066,869	0.82
チリ	766,122,062	0.68
アラブ首長国連邦	626,499,719	0.55
トルコ	542,371,275	0.48
コロンビア	383,296,146	0.34
ハンガリー	306,404,871	0.27
ギリシャ	302,670,271	0.27
チェコ	140,842,847	0.12
イギリス	60,337,564	0.05
ベルギー	17,840,798	0.02
小計	106,804,643,756	94.52
投資証券	南アフリカ	155,789,289
	メキシコ	92,131,005
	小計	247,920,294
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		5,940,175,618
純資産総額	112,992,739,668	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

令和2年1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	5,980,326,912	5.29

(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

令和2年1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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	276,981	19,693.38	5,454,693,406	22,747.73	6,300,690,333	5.58
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	938,400	5,255.83	4,932,075,663	5,265.00	4,940,676,000	4.37
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	4,031,000	939.10	3,785,513,436	1,139.40	4,592,921,400	4.06
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	781,538	4,063.64	3,175,890,296	5,268.12	4,117,235,969	3.64
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,731,550	90.08	1,417,124,496	84.24	1,325,225,772	1.17
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	71,794	17,009.29	1,221,165,128	18,203.62	1,306,911,412	1.16
香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	918,000	1,255.69	1,152,726,912	1,263.60	1,159,984,800	1.03
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	466,512	1,966.47	917,383,078	2,223.37	1,037,231,118	0.92
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	268,161	3,075.49	824,726,885	3,719.09	997,317,575	0.88
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	1,004,500	991.06	995,523,468	906.98	911,065,428	0.81
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,663,350	77.35	824,907,999	73.99	788,989,797	0.70
アメリカ	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	437,396	1,573.78	688,368,434	1,783.67	780,172,879	0.69
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	89,547	6,941.14	621,558,602	8,657.40	775,244,198	0.69
アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	63,168	9,013.77	569,381,867	11,058.68	698,554,951	0.62
ブラジル	株式	VALE SA	素材	518,830	1,272.33	660,128,107	1,321.49	685,628,657	0.61
アメリカ	株式	GAZPROM PJSC-SPON ADR	エネルギー	865,782	608.09	526,473,519	789.37	683,427,774	0.60
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	791,330	850.35	672,911,427	858.32	679,219,905	0.60
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	559,029	1,115.45	623,569,760	1,202.27	672,108,268	0.59
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	782,177	696.69	544,940,942	819.58	641,062,883	0.57
アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	45,400	16,040.44	728,236,349	13,713.20	622,579,480	0.55
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	2,042,272	299.44	611,555,989	299.15	610,966,091	0.54
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	134,522	3,328.17	447,712,447	4,416.19	594,075,384	0.53
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	655,253	892.14	584,583,833	858.32	562,421,342	0.50
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	12,977,000	48.10	624,260,887	42.54	552,057,152	0.49
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	688,600	692.61	476,932,786	742.60	511,354,635	0.45
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	5,482,100	79.43	435,461,782	93.25	511,208,566	0.45
アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	小売	121,208	3,166.01	383,745,958	4,197.71	508,797,173	0.45
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	2,934,000	184.58	541,568,762	168.48	494,320,320	0.44
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	147,641	3,305.61	488,043,659	3,292.28	486,076,840	0.43
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	737,034	543.99	400,944,901	609.52	449,237,553	0.40

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 1月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	6.73
	素材	6.93
	資本財	3.01
	商業・専門サービス	0.21
	運輸	1.73
	自動車・自動車部品	2.04
	耐久消費財・アパレル	1.14
	消費者サービス	1.32
	メディア・娯楽	6.84
	小売	9.02
	食品・生活必需品小売り	1.54
	食品・飲料・タバコ	3.47
	家庭用品・パーソナル用品	1.10
	ヘルスケア機器・サービス	0.84
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.93
	銀行	16.42
	各種金融	2.39
	保険	3.74
	不動産	2.43
	ソフトウェア・サービス	1.77
投資証券	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.45
	電気通信サービス	3.98
	公益事業	2.56
	半導体・半導体製造装置	5.94
	小計	94.52
投資証券		0.22
合計		94.74

(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

令和 2年 1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 2003	買建	1,024	アメリカドル	57,467,035.4	6,267,354,881	54,835,200	5,980,326,912	5.29

(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

令和2年1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	533,129,883,320	84.17
地方債証券	日本	33,309,736,096	5.26
特殊債券	日本	36,218,619,004	5.72
社債券	日本	31,907,880,500	5.04
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,149,040,833	0.19
純資産総額		633,417,078,087	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

令和2年1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	611,440,000	0.10

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和2年1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342回利付国債(10年)	11,440,000,000	102.49	11,725,564,200	101.70	11,634,708,800	0.10000	2026/3/20	1.84
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	10,640,000,000	101.09	10,756,547,200	101.25	10,773,957,600	0.10000	2024/9/20	1.70

日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	7,950,000,000	102.86	8,178,023,000	101.74	8,088,966,000	0.100000	2029/6/20	1.28
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	7,650,000,000	104.05	7,960,317,000	103.26	7,899,925,500	0.400000	2025/9/20	1.25
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	7,760,000,000	101.07	7,843,393,500	100.80	7,822,778,400	0.100000	2022/12/20	1.24
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	7,100,000,000	101.18	7,184,129,000	101.02	7,172,562,000	0.100000	2023/9/20	1.13
日本	国債証券	第398回利付国債(2年)	7,100,000,000	100.46	7,133,241,000	100.27	7,119,383,000	0.100000	2021/3/1	1.12
日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	5,770,000,000	119.74	6,909,515,100	119.99	6,923,884,600	1.500000	2034/3/20	1.09
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	6,550,000,000	103.73	6,794,904,500	103.21	6,760,779,000	0.600000	2024/3/20	1.07
日本	国債証券	第407回利付国債(2年)	6,450,000,000	100.43	6,478,286,200	100.47	6,480,637,500	0.100000	2021/12/1	1.02
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,070,000,000	101.79	6,178,653,000	101.97	6,189,700,400	0.100000	2028/3/20	0.98
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	5,860,000,000	103.98	6,093,462,400	103.31	6,053,966,000	0.800000	2023/6/20	0.96
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	5,600,000,000	101.85	5,703,936,000	102.00	5,712,392,000	0.100000	2027/9/20	0.90
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	5,600,000,000	101.70	5,695,242,000	101.83	5,702,816,000	0.100000	2028/12/20	0.90
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,590,000,000	101.81	5,691,665,600	101.94	5,698,781,400	0.100000	2027/3/20	0.90
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	5,590,000,000	102.07	5,705,830,000	101.79	5,690,284,600	0.100000	2029/3/20	0.90
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	5,490,000,000	101.72	5,584,428,000	101.87	5,592,827,700	0.100000	2028/9/20	0.88
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,060,000,000	103.52	5,238,149,200	103.12	5,217,872,000	0.400000	2025/6/20	0.82
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	5,150,000,000	101.49	5,227,035,000	101.09	5,206,289,500	0.100000	2023/12/20	0.82
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	5,040,000,000	103.54	5,218,819,200	103.02	5,192,409,600	0.600000	2023/12/20	0.82
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	5,090,000,000	101.80	5,181,836,000	101.99	5,191,392,800	0.100000	2027/12/20	0.82
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	5,010,000,000	100.79	5,049,759,800	100.56	5,038,256,400	0.100000	2022/3/20	0.80
日本	国債証券	第130回利付国債(5年)	4,950,000,000	100.69	4,984,254,000	100.48	4,974,205,500	0.100000	2021/12/20	0.79
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,850,000,000	101.74	4,934,390,000	101.90	4,942,344,000	0.100000	2028/6/20	0.78
日本	国債証券	第133回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.97	4,846,560,000	100.73	4,835,472,000	0.100000	2022/9/20	0.76
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	4,470,000,000	103.61	4,631,367,000	103.14	4,610,715,600	0.500000	2024/9/20	0.73
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	3,790,000,000	120.69	4,574,312,300	121.19	4,593,214,700	1.600000	2033/12/20	0.73
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	4,410,000,000	102.05	4,500,783,000	101.84	4,491,276,300	0.100000	2026/9/20	0.71
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	4,330,000,000	103.96	4,501,554,600	103.41	4,477,956,100	0.600000	2024/6/20	0.71
日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	3,750,000,000	117.31	4,399,125,000	118.17	4,431,412,500	1.300000	2035/6/20	0.70

(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

令和2年1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.17
地方債証券	5.26
特殊債券	5.72
社債券	5.04
合計	100.18

(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の概要

令和2年1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 20年03月限	買建	4	円	608,044,400	611,440,000	0.10

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

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和2年1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	70,627,598,129	47.75
	フランス	14,175,878,438	9.58
	イタリア	13,099,878,478	8.86
	イギリス	9,707,724,508	6.56
	ドイツ	8,624,122,357	5.83
	スペイン	8,016,249,258	5.42
	ベルギー	3,483,114,919	2.35
	オーストラリア	2,815,051,762	1.90
	カナダ	2,783,159,408	1.88
	オランダ	2,775,143,447	1.88
	オーストリア	2,081,823,800	1.41
	メキシコ	1,286,718,203	0.87
	アイルランド	1,019,128,777	0.69
	南アフリカ	834,240,103	0.56
	ポーランド	826,453,035	0.56
	フィンランド	790,592,933	0.53

デンマーク	697,262,637	0.47
マレーシア	674,871,853	0.46
シンガポール	582,856,023	0.39
スウェーデン	392,719,877	0.27
ノルウェー	319,923,116	0.22
小計	145,614,511,061	98.45
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	2,296,096,859	1.55
純資産総額	147,910,607,920	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

令和2年1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 (%)
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	11,650,000	13,010.44	1,515,716,981	12,974.27	1,511,502,547	1.750000	2023/5/25	1.02
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 210815	12,560,000	11,027.41	1,385,043,254	11,122.84	1,397,028,948	2.750000	2021/8/15	0.94
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	10,800,000	11,858.49	1,280,717,506	12,334.00	1,332,072,473	3.125000	2028/11/15	0.90
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 220430	9,700,000	10,817.88	1,049,335,274	11,025.28	1,069,452,584	1.875000	2022/4/30	0.72
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 241115	9,250,000	10,883.84	1,006,755,865	11,343.94	1,049,314,826	2.250000	2024/11/15	0.71
ドイツ	国債証券	1.75 BUND 240215	7,150,000	13,216.55	944,983,613	13,224.38	945,543,636	1.750000	2024/2/15	0.64
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 231115	8,050,000	11,177.57	899,794,912	11,460.67	922,584,123	2.750000	2023/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 270815	7,670,000	10,894.00	835,570,061	11,504.97	882,431,810	2.250000	2027/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 221215	8,000,000	10,918.32	873,465,903	10,987.36	878,989,518	1.625000	2022/12/15	0.59
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 220831	7,640,000	10,699.80	817,465,365	10,976.71	838,621,300	1.625000	2022/8/31	0.57
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 240131	7,300,000	11,006.36	803,464,787	11,281.74	823,567,442	2.250000	2024/1/31	0.56
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	6,860,000	11,188.87	767,556,782	11,937.80	818,933,755	2.750000	2028/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260515	7,000,000	10,596.77	741,774,350	11,025.28	771,769,907	1.625000	2026/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 210131	7,000,000	10,944.76	766,133,718	11,011.65	770,815,631	2.500000	2021/1/31	0.52
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	6,570,000	10,850.61	712,885,600	11,406.99	749,439,530	2.250000	2025/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 220531	6,760,000	10,880.74	735,538,390	11,031.24	745,712,404	1.875000	2022/5/31	0.50
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240131	6,400,000	11,026.98	705,727,260	11,383.98	728,575,330	2.500000	2024/1/31	0.49
アメリカ	国債証券	3 T-BOND 441115	5,600,000	11,691.78	654,740,149	12,950.87	725,249,000	3.000000	2044/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	3.75 T-BOND 431115	4,900,000	13,257.26	649,606,171	14,485.38	709,783,779	3.750000	2043/11/15	0.48

アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 250630	6,000,000	11,429.05	685,743,106	11,669.42	700,165,200	2.750000	2025/6/30	0.47
フランス	国債証券	0 O.A.T 220525	5,650,000	12,256.13	692,471,572	12,203.56	689,501,299	0.000000	2022/5/25	0.47
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 221130	6,200,000	10,949.73	678,883,368	11,098.55	688,110,661	2.000000	2022/11/30	0.47
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 240215	5,960,000	11,147.12	664,368,640	11,498.16	685,290,438	2.750000	2024/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 250831	5,840,000	11,176.09	652,683,884	11,685.60	682,439,542	2.750000	2025/8/31	0.46
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 211031	6,000,000	10,902.40	654,144,061	10,920.05	655,203,510	1.500000	2021/10/31	0.44
アメリカ	国債証券	3.625 T-BOND 440215	4,550,000	12,857.37	585,010,419	14,246.81	648,230,060	3.625000	2044/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 211231	5,850,000	10,848.06	634,611,619	11,027.84	645,128,666	2.000000	2021/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 290215	5,320,000	11,177.83	594,660,991	11,906.28	633,414,345	2.625000	2029/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 260815	5,700,000	10,403.49	592,999,111	10,937.52	623,438,931	1.500000	2026/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	3 T-BOND 490215	4,700,000	11,316.73	531,886,384	13,238.00	622,186,447	3.000000	2049/2/15	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

令和 2年 1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.45
合計	98.45

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

新興国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 1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	メキシコ	3,083,102,167	10.10
	インドネシア	2,980,424,393	9.77
	ブラジル	2,939,077,683	9.63
	タイ	2,826,943,920	9.27
	南アフリカ	2,663,062,486	8.73

ポーランド	2,642,937,389	8.66
ロシア	2,597,831,009	8.51
マレーシア	1,884,612,060	6.18
コロンビア	1,787,847,878	5.86
トルコ	1,163,793,466	3.81
チェコ	1,114,125,815	3.65
ハンガリー	1,090,856,204	3.58
ペルー	1,055,071,141	3.46
チリ	791,726,237	2.59
ルーマニア	773,273,010	2.53
フィリピン	53,247,531	0.17
ドミニカ共和国	50,221,173	0.16
ウルグアイ	41,776,245	0.14
小計	29,539,929,807	96.82
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	970,820,466	3.18
純資産総額	30,510,750,273	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

令和 2年 1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	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	20,100,000	2,882.04	579,290,887	2,886.27	580,140,869	10.000000	2023/1/1	1.90
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	16,170,000	3,060.52	494,886,836	3,069.69	496,369,021	10.000000	2027/1/1	1.63
南アフリカ	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	53,900,000	832.19	448,552,093	834.86	449,993,852	10.500000	2026/12/21	1.47
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 220101	17,800,000	2,336.65	415,925,050	2,338.88	416,322,026		2022/1/1	1.36
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	13,450,000	2,982.51	401,148,202	2,991.75	402,391,265	10.000000	2025/1/1	1.32
メキシコ	国債証券	8 MEXICAN BONOS 231207	57,300,000	606.01	347,248,234	608.52	348,686,418	8.000000	2023/12/7	1.14
南アフリカ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 480228	53,800,000	645.25	347,149,510	646.76	347,956,880	8.750000	2048/2/28	1.14
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 230701	15,600,000	2,115.50	330,018,968	2,120.80	330,846,145		2023/7/1	1.08
南アフリカ	国債証券	8 SOUTH AFRICA 300131	45,700,000	691.01	315,792,349	692.61	316,526,940	8.000000	2030/1/31	1.04
インドネシア	国債証券	8.375 INDONESIA 240315	36,200,000,000	0.87	315,524,072	0.86	314,505,600	8.375000	2024/3/15	1.03
メキシコ	国債証券	6.5 MEXICAN BONOS 220609	54,200,000	578.51	313,554,220	579.51	314,095,851	6.500000	2022/6/9	1.03
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	45,900,000	660.11	302,992,680	663.37	304,488,749	10.000000	2024/12/5	1.00

メキシコ	国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	48,700,000	605.69	294,972,908	610.35	297,241,483	7.500000	2027/6/3	0.97
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 220701	12,600,000	2,266.31	285,556,197	2,268.59	285,843,240		2022/7/1	0.94
ロシア	国債証券	7.75 RUSSIA OFZ 260916	149,600,000	189.37	283,300,512	188.87	282,551,735	7.750000	2026/9/16	0.93
インドネシア	国債証券	8.375 INDONESIA 340315	31,300,000,000	0.88	277,748,688	0.88	275,940,800	8.375000	2034/3/15	0.90
コロンビア	国債証券	7.5 TITULOS DE TE 260826	7,770,000,000	3.53	274,965,852	3.53	274,442,390	7.500000	2026/8/26	0.90
コロンビア	国債証券	7 TITULOS DE TESO 220504	8,010,000,000	3.34	267,833,151	3.34	268,007,620	7.000000	2022/5/4	0.88
タイ	国債証券	2.875 THAILAND 281217	66,800,000	394.03	263,213,092	395.39	264,126,291	2.875000	2028/12/17	0.87
メキシコ	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	40,200,000	648.95	260,879,412	654.88	263,264,080	8.500000	2029/5/31	0.86
タイ	国債証券	3.775 THAILAND 320625	58,500,000	436.02	255,074,765	438.32	256,422,839	3.775000	2032/6/25	0.84
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 260725	8,600,000	2,864.27	246,327,626	2,881.43	247,803,580	2.500000	2026/7/25	0.81
マレーシア	国債証券	3.955 MALAYSIAGOV 250915	8,800,000	2,794.44	245,910,984	2,797.29	246,162,273	3.955000	2025/9/15	0.81
マレーシア	国債証券	3.9 MALAYSIAGOV 261130	8,620,000	2,796.15	241,028,667	2,794.92	240,922,583	3.900000	2026/11/30	0.79
南アフリカ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 440131	37,000,000	647.64	239,629,760	649.44	240,293,276	8.750000	2044/1/31	0.79
コロンビア	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	6,200,000,000	3.80	236,117,101	3.80	236,048,689	10.000000	2024/7/24	0.77
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 210701	9,800,000	2,406.14	235,802,394	2,408.04	235,988,189		2021/7/1	0.77
コロンビア	国債証券	6 TITULOS DE TESO 280428	7,280,000,000	3.24	236,516,402	3.24	235,987,493	6.000000	2028/4/28	0.77
ポーランド	国債証券	1.75 POLAND 210725	8,300,000	2,812.24	233,416,075	2,813.76	233,542,312	1.750000	2021/7/25	0.77
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 270725	8,000,000	2,857.53	228,602,515	2,876.91	230,153,366	2.500000	2027/7/25	0.75

(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

令和 2年 1月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.82
合計	96.82

(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

令和 2年 1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	35,057,862,100	98.57
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		507,763,363	1.43
純資産総額		35,565,625,463	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

令和 2年 1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	賃建	日本	480,472,000	1.35

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 1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	2,983	858,000	2,559,414,000	878,000	2,619,074,000	7.36
日本	投資証券	ジャパンリアルエスティート投資法人	3,080	783,000	2,411,640,000	791,000	2,436,280,000	6.85
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	9,943	186,300	1,852,380,900	190,800	1,897,124,400	5.33
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,635	299,226.71	1,386,915,840	312,000	1,446,120,000	4.07
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	6,137	232,200	1,425,011,400	229,300	1,407,214,100	3.96
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	5,821	229,800	1,337,665,800	231,700	1,348,725,700	3.79
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,916	195,000	1,348,620,000	194,300	1,343,778,800	3.78
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,152	282,900	1,174,600,800	289,500	1,202,004,000	3.38
日本	投資証券	G L P投資法人	7,671	136,500	1,047,091,500	145,300	1,114,596,300	3.13
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,921	344,500	1,006,284,500	341,500	997,521,500	2.80
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,950	486,000	947,700,000	501,000	976,950,000	2.75
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,543	567,000	874,881,000	577,000	890,311,000	2.50
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	9,006	91,500	824,049,000	93,000	837,558,000	2.35
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	953	856,000	815,768,000	870,000	829,110,000	2.33

日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	13,510	54,300	733,593,000	54,900	741,699,000	2.09
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,023	699,000	715,077,000	719,000	735,537,000	2.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,922	72,300	717,360,600	73,100	725,298,200	2.04
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,967	168,200	667,249,400	166,800	661,695,600	1.86
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,544	184,000	652,096,000	181,700	643,944,800	1.81
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	711	858,000	610,038,000	870,000	618,570,000	1.74
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,012	291,000	585,492,000	293,400	590,320,800	1.66
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	2,849	194,300	553,560,700	196,200	558,973,800	1.57
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,619	196,900	515,681,100	200,900	526,157,100	1.48
日本	投資証券	日本リート投資法人	1,000	502,000	502,000,000	508,000	508,000,000	1.43
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,952	124,100	490,443,200	127,500	503,880,000	1.42
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,864	167,700	480,292,800	175,000	501,200,000	1.41
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,094	449,000	491,206,000	453,500	496,129,000	1.39
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,324	150,500	500,262,000	147,800	491,287,200	1.38
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,295	358,464.2	464,211,150	357,000	462,315,000	1.30
日本	投資証券	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	19,788	23,330	461,654,040	23,100	457,102,800	1.29

(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

令和 2年 1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.57
合計	98.57

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なものの

令和 2年 1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 20年03月限	賃建	218	円	473,332,010	480,472,000	1.35

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

MUAM G - REITマザーファンド

投資状況

令和 2年 1月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	23,233,912,149	73.35
	オーストラリア	2,040,455,590	6.44
	イギリス	1,715,295,769	5.42
	シンガポール	1,166,562,030	3.68
	カナダ	638,116,683	2.01
	フランス	623,055,122	1.97
	香港	600,107,929	1.89
	オランダ	506,343,533	1.60
	ベルギー	341,259,436	1.08
	スペイン	203,417,674	0.64
	ニュージーランド	134,247,839	0.42
	ドイツ	87,191,964	0.28
	アイルランド	42,002,544	0.13
	イスラエル	22,883,503	0.07
	イタリア	6,399,496	0.02
	韓国	3,444,540	0.01
小計		31,364,695,801	99.03
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		308,667,131	0.97
純資産総額		31,673,362,932	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

令和 2年 1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	132,720	9,753.21	1,294,447,236	10,492.66	1,392,586,180	4.40
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	17,916	63,817.88	1,143,361,143	65,763.18	1,178,213,133	3.72
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	64,517	15,851.23	1,022,674,028	14,881.23	960,092,768	3.03
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	85,101	8,898.10	757,237,236	9,313.72	792,607,226	2.50
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	31,512	23,311.16	734,581,424	24,440.34	770,164,183	2.43
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,305	22,819.32	668,720,307	23,776.17	696,760,679	2.20
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	73,289	8,813.03	645,898,206	9,157.76	671,163,674	2.12
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,820	13,080.54	573,189,417	13,713.20	600,912,617	1.90
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	68,437	8,050.66	550,963,524	8,613.55	589,486,124	1.86
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	78,326	6,224.77	487,561,898	6,318.93	494,937,012	1.56
香港	投資証券	LINK REIT	440,500	1,147.88	505,643,177	1,113.37	490,440,366	1.55

アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	30,225	14,903.10	450,446,432	15,659.92	473,321,245	1.49
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,888	32,847.60	456,187,487	34,040.89	472,759,989	1.49
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,732	17,537.70	451,280,351	17,938.18	461,585,474	1.46
オランダ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,905	17,017.17	491,881,519	14,971.33	432,746,438	1.37
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	103,697	3,744.02	388,244,658	3,981.78	412,898,703	1.30
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	113,280	3,280.07	371,566,891	3,436.48	389,284,522	1.23
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	336,577	990.62	333,420,211	1,095.68	368,782,539	1.16
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,972	14,298.20	342,756,552	14,994.65	359,451,975	1.13
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	19,520	16,345.52	319,064,688	17,620.82	343,958,488	1.09
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	36,218	8,739.46	316,525,982	9,221.02	333,967,011	1.05
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	27,456	11,617.07	318,958,307	12,059.85	331,115,373	1.05
アメリカ	投資証券	UDR INC	61,609	5,071.01	312,420,011	5,254.51	323,725,156	1.02
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,120,259	284.41	318,619,460	287.29	321,846,826	1.02
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	76,963	3,817.09	293,775,467	4,005.77	308,296,369	0.97
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	38,372	7,644.75	293,344,610	7,974.46	305,996,255	0.97
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	231,029	1,280.11	295,743,735	1,300.97	300,562,773	0.95
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	96,889	2,760.56	267,468,038	2,926.07	283,504,946	0.90
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	151,195	1,965.86	297,229,695	1,804.94	272,898,357	0.86
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	107,941	2,282.62	246,388,912	2,451.66	264,635,582	0.84

(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

令和 2年 1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.03
合計	99.03

(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

該当事項はありません。

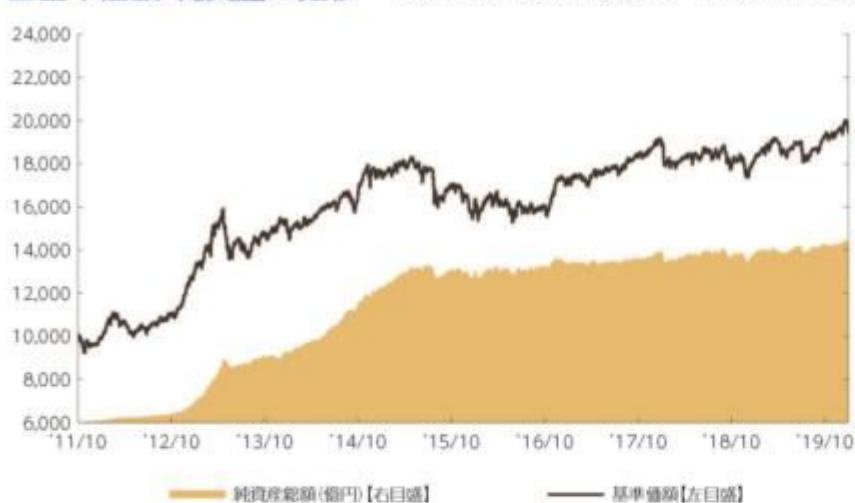
参考情報



運用実績

2020年1月31日現在

■基準価額・純資産の推移



■基準価額・純資産

基準価額	19,479円
純資産総額	41.1億円

■分配の推移

2020年 1月	0円
2019年 1月	0円
2018年 1月	0円
2017年 1月	0円
2016年 1月	0円
2015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	4.3%	1 アメリカドル	25.3%	AUBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株式	小売	アメリカ	1.8%
国内債券	2.5%	2 円	24.3%	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	メディア・娯楽	香港	1.4%
国内リート	12.7%	3 香港ドル	6.6%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製造装置	台湾	1.3%
外国株式	35.8%	4 ユーロ	6.2%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	テクノロジ・ハードウェア・機器	韓国	1.2%
外国債券	24.7%	5 韓国ウォン	3.6%	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	債券	国債	ブラジル	0.2%
外国リート	12.6%	6 ニューヨークドル	3.5%	10(IN)BRAZIL NT 270101	債券	国債	ブラジル	0.2%
コールローン他 (負債控除後)	7.4%	7 ブラジルレアル	3.5%	10.5 SOUTH AFRICA 261221	債券	国債	南アフリカ	0.2%
合計	100.0%	8 インドルピー	2.8%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.9%
		9 南アフリカランド	2.6%	ジャパンリアルエステイト投資法人	リート	-	日本	0.9%
		10 メキシコペソ	2.2%	野村不動産マスターファンド投資法人	リート	-	日本	0.7%

その他資産の状況

	比率
株価指数先物取引（買建）	1.9%
債券先物取引（買建）	0.0%
不動産投信指数先物取引（買建）	0.2%

*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。

■年間收益率の推移



*收益率は基準価額で計算

*2011年は設定日から年末までの、2020年は年初から1月31日までの收益率を表示

*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】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

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。

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

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

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。

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国際投信株式会社

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.jp/>

申込手数料

ありません。

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。

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。

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】

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す。

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

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

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

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。

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国際投信株式会社

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.jp/>

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。

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。

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つ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】

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1万口当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。

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。

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国際投信株式会社

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.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できます。

（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】

ファンドの償還条件等

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

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

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

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

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

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。

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（変更にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、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発します。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。

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。

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カ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。

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。

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せることができます。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できます。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せることができます。これに伴い、この信託契約に関する事業を承継せることができます。

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。

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。

公告

委託会社が受益者に対する公告は、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。

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ヶ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。

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ヶ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（平成31年1月29日から令和2年1月27日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【eMAXIS バランス(波乗り型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第8期 [平成31年 1月28日現在]	第9期 [令和 2年 1月27日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	49,058,485	131,891,554
親投資信託受益証券	3,722,443,392	3,963,004,981
未収入金	146,760,357	108,296,929
流動資産合計	<u>3,918,262,234</u>	<u>4,203,193,464</u>
資産合計	<u>3,918,262,234</u>	<u>4,203,193,464</u>
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,006,574	36,200,737
未払受託者報酬	1,287,338	1,341,779
未払委託者報酬	9,440,447	9,839,698
未払利息	93	56
その他未払費用	77,594	80,439
流動負債合計	<u>17,812,046</u>	<u>47,462,709</u>
負債合計	<u>17,812,046</u>	<u>47,462,709</u>
純資産の部		
元本等		
元本	2,147,615,723	2,105,554,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,752,834,465	2,050,176,232
(分配準備積立金)	<u>522,335,050</u>	<u>508,113,482</u>
元本等合計	<u>3,900,450,188</u>	<u>4,155,730,755</u>
純資産合計	<u>3,900,450,188</u>	<u>4,155,730,755</u>
負債純資産合計	<u>3,918,262,234</u>	<u>4,203,193,464</u>

(2) 【損益及び剩余金計算書】

	(単位：円)	
	第8期 自 平成30年 1月27日 至 平成31年 1月28日	第9期 自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日
営業収益		
受取利息	488	337
有価証券売買等損益	<u>177,652,999</u>	360,357,542
営業収益合計	<u>177,652,511</u>	360,357,879
営業費用		
支払利息	74,814	54,157
受託者報酬	2,523,871	2,623,319
委託者報酬	18,508,288	19,237,588
その他費用	<u>152,752</u>	157,498
営業費用合計	<u>21,259,725</u>	22,072,562
営業利益又は営業損失()	198,912,236	338,285,317
経常利益又は経常損失()	198,912,236	338,285,317
当期純利益又は当期純損失()	198,912,236	338,285,317
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()	26,549,054	42,967,833
期首剩余金又は期首次損金()	1,887,598,730	1,752,834,465
剩余金増加額又は欠損金減少額	357,052,306	464,760,506
当期追加信託に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額	357,052,306	464,760,506
剩余金減少額又は欠損金増加額	319,453,389	462,736,223
当期一部解約に伴う剩余金減少額又は欠損金増加額	319,453,389	462,736,223
分配金	-	-
期末剩余金又は期末欠損金()	1,752,834,465	2,050,176,232

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間および当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成31年 1月29日から令和 2年 1月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第8期 [平成31年 1月28日現在]	第9期 [令和 2年 1月27日現在]
1. 期首元本額	2,068,622,591円	2,147,615,723円
期中追加設定元本額	433,314,738円	521,543,297円
期中一部解約元本額	354,321,606円	563,604,497円
2. 受益権の総数	2,147,615,723口	2,105,554,523口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 平成30年 1月27日 至 平成31年 1月28日			第9期 自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	95,049,756円	費用控除後の配当等収益額	A	106,182,385円
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	B	円	費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	B	円
収益調整金額	C	1,230,499,415円	収益調整金額	C	1,542,062,750円
分配準備積立金額	D	427,285,294円	分配準備積立金額	D	401,931,097円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,752,834,465円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,050,176,232円
当ファンドの期末残存口数	F	2,147,615,723口	当ファンドの期末残存口数	F	2,105,554,523口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	8,161円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	9,736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8期 自 平成30年 1月27日 至 平成31年 1月28日	第9期 自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づいております。	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	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 [平成31年 1月28日現在]	第9期 [令和 2年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <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</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>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>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p>

区分	第8期 [平成31年 1月28日現在]	第9期 [令和 2年 1月27日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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ては、当該価額が異なることがあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 [平成31年 1月28日現在]	第9期 [令和 2年 1月27日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	8,238,329	255,728,977
合計	8,238,329	255,728,977

(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8期 [平成31年 1月28日現在]	第9期 [令和 2年 1月27日現在]
1口当たり純資産額	1.8162円	1.9737円
(1万口当たり純資産額)	(18,162円)	(19,737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	273,712,287	521,750,361	
	新興国株式インデックスマザーファンド	480,081,029	1,262,469,081	
	東証REIT指数マザーファンド	144,963,384	528,130,600	
	新興国債券インデックスマザーファンド	360,275,489	519,661,365	
	TOPIXマザーファンド	121,143,520	227,010,842	
	外国株式インデックスマザーファンド	87,619,529	275,878,849	
	日本債券インデックスマザーファンド	77,530,817	105,565,960	
	外国債券インデックスマザーファンド	244,736,979	522,537,923	
合計		1,790,063,034	3,963,004,981	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

[令和2年1月27日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	66,164,977,536
株式	347,652,977,550
派生商品評価勘定	514,000
未収配当金	484,596,980

[令和 2年 1月27日現在]

未収利息	1,418,355
その他未収収益	56,922,504
差入委託証拠金	366,720,000
流動資産合計	414,728,126,925
資産合計	414,728,126,925
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	139,219,750
前受金	63,926,000
未払金	4,254,749,097
未払解約金	607,855,041
未払利息	28,586
受入担保金	52,876,840,481
流動負債合計	57,942,618,955
負債合計	57,942,618,955
純資産の部	
元本等	
元本	190,399,359,909
剰余金	
剰余金又は欠損金()	166,386,148,061
元本等合計	356,785,507,970
純資産合計	356,785,507,970
負債純資産合計	414,728,126,925

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 2年 1月27日現在]
1. 期首	平成31年 1月29日
期首先元本額	131,381,540,470円
期中追加設定元本額	208,635,948,640円
期中一部解約元本額	149,618,129,201円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー(国内株式)	26,875,720,873円
eMAXIS TOPIXインデックス	9,306,060,351円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,105,073,418円
eMAXIS バランス(波乗り型)	121,143,520円
コアバランス	420,917円

	[令和2年1月27日現在]
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	66,956,617円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	111,076,903円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	78,901,101円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	7,235,081,219円
国内株式セレクション(ラップ向け)	1,310,049,713円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,964,006,905円
つみたて日本株式(TOPIX)	2,365,917,599円
つみたて8資産均等バランス	1,147,441,571円
つみたて4資産均等バランス	304,432,361円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,656,313円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,617,551円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,723,125円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	35,923,541円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	27,845,848円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	21,079,928円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	264,225,326円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	18,504,260円
国内株式インデックス・オープン(ラップ向け)	26,075,713円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	2,031,824,550円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,988,010,551円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,319,487,488円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	574,170,988円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,031,532,713円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	24,394,711円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	168,279,137円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	284,338,641円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	81,568,416円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	96,779,470円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	325,127,557円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	237,075,950円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	471,881,729円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	39,083,595円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,575,900,335円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	212,766,655円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,436,206,292円

	[令和2年1月27日現在]
MUAM 日本株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	30,914,296,462円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	399,245,922円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	5,064,446円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	4,602,766円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	387,330,580円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	774,606,736円
MUAMトピックスリスクコントロール(5%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,360,745円
MUAMトピックスリスクコントロール(10%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	245,796,878円
MUAM インデックスファンドTOPIXi(適格機関投資家限定)	8,726,654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)	3,731,238,683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)	1,415,878,608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)	630,089,209円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	57,866,547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)	3,918,492,460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)	170,235,335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)	3,114,069,258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)	734,518,110円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-04(適格機関投資家限定)	158,613,947円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2019-11(適格機関投資家限定)	76,883,888円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	7,677,811,570円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	4,312,813円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	15,935,581円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	13,687,929円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	13,469,212円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	1,320,297,628円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	237,652,803円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	28,315,219円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	233,546,627円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	21,945,519円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	143,461,172円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,729,601,070円

	[令和2年1月27日現在]
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	509,420,370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)	1,958,646,855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)	1,703,649,156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)	1,420,200,014円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	50,325,125,686円
合計	190,399,359,909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	49,452,007,780円
3. 受益権の総数	190,399,359,909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 平成31年 1月29日 至 令和2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号) 第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づいております。
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あります。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和2年1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	17,983,203,426
合計	17,983,203,426

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,510,749,000			138,274,000
				13,372,475,000	138,274,000
合計		13,510,749,000		13,372,475,000	138,274,000

(注)時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

		[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額		1,8739円
(1万口当たり純資産額)		(18,739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	6,900	2,870.00	19,803,000	貸付有価証券 4,600株(2,500株)
1332	日本水産	196,700	596.00	117,233,200	
1333	マルハニチロ	28,400	2,647.00	75,174,800	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
1376	カネコ種苗	6,000	1,311.00	7,866,000	
1377	サカタのタネ	23,500	3,515.00	82,602,500	貸付有価証券 9,600株(2,400株)
1379	ホクト	15,000	1,938.00	29,070,000	
1384	ホクリヨウ	3,000	707.00	2,121,000	
1514	住石ホールディングス	39,700	142.00	5,637,400	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
1515	日鉄鉱業	4,500	4,620.00	20,790,000	
1518	三井松島ホールディングス	7,600	1,185.00	9,006,000	
1605	国際石油開発帝石	789,300	1,053.00	831,132,900	
1662	石油資源開発	25,700	2,883.00	74,093,100	
1663	K&Oエナジーグループ	9,600	1,684.00	16,166,400	
1413	ヒノキヤグループ	4,900	2,033.00	9,961,700	貸付有価証券 1,500株
1414	ショーボンドホールディングス	28,100	4,575.00	128,557,500	貸付有価証券 19,900株(11,300株)
1417	ミライト・ホールディングス	58,500	1,680.00	98,280,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
1419	タマホーム	9,300	1,338.00	12,443,400	貸付有価証券 3,800株(900株)

1420	サンヨーホームズ	1,700	705.00	1,198,500	貸付有価証券 700株(200株)
1429	日本アクリア	7,800	593.00	4,625,400	貸付有価証券 3,200株(800株)
1430	ファーストコーポレーション	6,000	590.00	3,540,000	貸付有価証券 2,500株(600株)
1433	ベステラ	3,400	1,242.00	4,222,800	貸付有価証券 1,000株
1435	T A T E R U	40,600	214.00	8,688,400	貸付有価証券 12,200株
1446	キャンディル	1,400	921.00	1,289,400	
1448	スペースバリューホールディングス	24,000	561.00	13,464,000	貸付有価証券 9,600株(9,600株)
1712	ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,158.00	4,400,400	
1716	第一カッター興業	2,400	1,782.00	4,276,800	
1717	明豊ファシリティワークス	4,700	787.00	3,698,900	
1719	安藤・間	117,100	937.00	109,722,700	
1720	東急建設	57,600	769.00	44,294,400	
1721	コムシスホールディングス	69,800	3,165.00	220,917,000	
1726	ビーアールホールディングス	21,400	481.00	10,293,400	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
1762	高松コンストラクショングループ	12,200	2,743.00	33,464,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
1766	東建コーポレーション	6,100	7,530.00	45,933,000	貸付有価証券 4,200株(2,400株)
1768	ソネック	2,000	810.00	1,620,000	貸付有価証券 400株(200株)
1780	ヤマウラ	8,500	917.00	7,794,500	貸付有価証券 900株
1801	大成建設	151,500	4,490.00	680,235,000	貸付有価証券 46,400株
1802	大林組	454,300	1,214.00	551,520,200	貸付有価証券 139,300株
1803	清水建設	461,100	1,144.00	527,498,400	貸付有価証券 327,400株(186,000株)
1805	飛島建設	13,000	1,425.00	18,525,000	
1808	長谷工コーポレーション	175,900	1,482.00	260,683,800	貸付有価証券 71,300株(17,100株)
1810	松井建設	17,900	758.00	13,568,200	貸付有価証券 5,500株
1811	錢高組	2,000	4,050.00	8,100,000	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	356,700	1,422.00	507,227,400	貸付有価証券 12,000株
1813	不動テトラ	11,900	1,723.00	20,503,700	
1814	大末建設	5,300	987.00	5,231,100	貸付有価証券 500株(500株)
1815	鉄建建設	9,900	2,799.00	27,710,100	貸付有価証券 4,000株(4,000株)

1820	西松建設	35,000	2,463.00	86,205,000 3,400株 (3,400株)	貸付有価証券
1821	三井住友建設	109,800	629.00	69,064,200 33,700株	貸付有価証券
1822	大豊建設	10,200	2,768.00	28,233,600 2,200株	貸付有価証券
1824	前田建設工業	113,800	1,134.00	129,049,200 45,800株 (11,000株)	貸付有価証券
1826	佐田建設	9,800	467.00	4,576,600	
1827	ナカノフードー建設	12,400	472.00	5,852,800 8,700株 (4,900株)	貸付有価証券
1833	奥村組	24,600	2,959.00	72,791,400 2,400株 (2,400株)	貸付有価証券
1835	東鉄工業	19,500	3,190.00	62,205,000 13,800株 (7,800株)	貸付有価証券
1847	イチケン	3,300	1,771.00	5,844,300 100株 (100株)	貸付有価証券
1848	富士ピー・エス	6,700	565.00	3,785,500 2,600株 (600株)	貸付有価証券
1852	淺沼組	5,100	4,805.00	24,505,500 500株 (500株)	貸付有価証券
1860	戸田建設	188,700	722.00	136,241,400 75,800株 (18,200株)	貸付有価証券
1861	熊谷組	21,100	3,180.00	67,098,000	
1866	北野建設	2,800	2,519.00	7,053,200 800株	貸付有価証券
1867	植木組	2,000	2,504.00	5,008,000	
1870	矢作建設工業	20,100	826.00	16,602,600 8,200株 (2,000株)	貸付有価証券
1871	ピーエス三菱	15,000	713.00	10,695,000	
1873	日本ハウスホールディングス	31,000	485.00	15,035,000 9,500株	貸付有価証券
1878	大東建託	54,400	12,835.00	698,224,000 11,800株 (11,800株)	貸付有価証券
1879	新日本建設	19,300	912.00	17,601,600 5,900株	貸付有価証券
1881	NIPPO	37,600	2,725.00	102,460,000 15,300株 (3,700株)	貸付有価証券
1882	東亞道路工業	2,800	3,485.00	9,758,000	
1883	前田道路	48,100	3,630.00	174,603,000 19,300株 (4,600株)	貸付有価証券
1884	日本道路	4,400	7,350.00	32,340,000 1,700株 (300株)	貸付有価証券
1885	東亞建設工業	14,200	1,636.00	23,231,200 1,400株 (1,400株)	貸付有価証券
1887	日本国土開発	26,500	614.00	16,271,000 10,700株 (2,600株)	貸付有価証券
1888	若築建設	8,200	1,703.00	13,964,600	
1890	東洋建設	50,900	558.00	28,402,200	

1893	五洋建設	180,100	665.00	119,766,500	貸付有価証券 127,800株(72,600株)
1898	世紀東急工業	21,800	964.00	21,015,200	
1899	福田組	5,300	4,855.00	25,731,500	貸付有価証券 2,100株(500株)
1911	住友林業	115,100	1,541.00	177,369,100	貸付有価証券 35,200株
1914	日本基礎技術	15,300	395.00	6,043,500	貸付有価証券 1,200株
1921	巴コー・ポレーション	20,200	434.00	8,766,800	貸付有価証券 14,300株(8,100株)
1925	大和ハウス工業	449,500	3,495.00	1,571,002,500	
1926	ライト工業	26,000	1,581.00	41,106,000	貸付有価証券 18,500株(10,500株)
1928	積水ハウス	497,100	2,431.00	1,208,450,100	
1929	日特建設	11,900	863.00	10,269,700	
1930	北陸電気工事	7,900	1,123.00	8,871,700	貸付有価証券 2,800株(400株)
1934	ユアテック	26,000	670.00	17,420,000	貸付有価証券 7,900株
1939	四電工	2,500	2,861.00	7,152,500	
1941	中電工	18,300	2,496.00	45,676,800	貸付有価証券 1,600株
1942	関電工	64,600	1,021.00	65,956,600	
1944	きんでん	107,900	1,665.00	179,653,500	貸付有価証券 10,400株(10,400株)
1945	東京エネシス	15,100	885.00	13,363,500	貸付有価証券 1,700株
1946	トーエネック	4,600	3,790.00	17,434,000	
1949	住友電設	12,800	2,738.00	35,046,400	貸付有価証券 5,100株(1,200株)
1950	日本電設工業	24,900	2,225.00	55,402,500	貸付有価証券 17,800株(10,100株)
1951	協和エクシオ	68,900	2,761.00	190,232,900	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
1952	新日本空調	12,000	2,071.00	24,852,000	貸付有価証券 8,500株(4,800株)
1959	九電工	31,900	3,260.00	103,994,000	
1961	三機工業	32,700	1,520.00	49,704,000	貸付有価証券 10,100株
1963	日揮ホールディングス	139,900	1,638.00	229,156,200	貸付有価証券 56,200株(56,200株)
1964	中外炉工業	4,900	1,752.00	8,584,800	貸付有価証券 500株(500株)
1967	ヤマト	14,500	889.00	12,890,500	貸付有価証券 10,200株(5,800株)
1968	太平電業	11,000	2,331.00	25,641,000	貸付有価証券 4,400株(1,100株)
1969	高砂熱学工業	39,500	1,918.00	75,761,000	貸付有価証券 12,000株

1972	三晃金属工業	2,000	2,615.00	5,230,000	
1975	朝日工業社	3,100	3,420.00	10,602,000	
1976	明星工業	29,400	897.00	26,371,800	9,000株 貸付有価証券
1979	大氣社	22,100	3,780.00	83,538,000	8,900株 (2,100株) 貸付有価証券
1980	ダイダン	10,900	2,580.00	28,122,000	4,300株 (1,000株) 貸付有価証券
1982	日比谷総合設備	14,600	1,902.00	27,769,200	5,700株 (1,400株) 貸付有価証券
3267	フィル・カンパニー	1,500	4,215.00	6,322,500	
5912	O S J B ホールディングス	71,600	275.00	19,690,000	
6330	東洋エンジニアリング	19,100	609.00	11,631,900	7,600株 (7,600株) 貸付有価証券
6379	レイズネクスト	24,400	1,355.00	33,062,000	9,900株 (2,400株) 貸付有価証券
2001	日本製粉	42,500	1,662.00	70,635,000	13,100株 貸付有価証券
2002	日清製粉グループ本社	164,300	1,795.00	294,918,500	
2003	日東富士製粉	1,100	6,220.00	6,842,000	
2004	昭和産業	13,300	3,020.00	40,166,000	5,300株 (5,300株) 貸付有価証券
2009	鳥越製粉	12,900	835.00	10,771,500	4,000株 貸付有価証券
2053	中部飼料	17,800	1,637.00	29,138,600	7,100株 (1,700株) 貸付有価証券
2060	フィード・ワン	97,700	180.00	17,586,000	29,800株 貸付有価証券
2107	東洋精糖	2,500	1,205.00	3,012,500	
2108	日本甜菜製糖	7,600	1,901.00	14,447,600	
2109	三井製糖	12,700	2,144.00	27,228,800	3,900株 貸付有価証券
2112	塩水港精糖	15,700	219.00	3,438,300	
2117	日新製糖	6,900	2,003.00	13,820,700	
2201	森永製菓	34,100	5,260.00	179,366,000	3,300株 (3,300株) 貸付有価証券
2204	中村屋	3,800	4,130.00	15,694,000	1,100株 貸付有価証券
2206	江崎グリコ	43,100	4,720.00	203,432,000	1,000株 (1,000株) 貸付有価証券
2207	名糖産業	7,000	1,386.00	9,702,000	
2209	井村屋グループ	6,200	1,890.00	11,718,000	1,900株 貸付有価証券
2211	不二家	8,100	2,136.00	17,301,600	5,700株 (3,200株) 貸付有価証券
2212	山崎製パン	109,000	2,069.00	225,521,000	40,000株 (40,000株) 貸付有価証券
2215	第一屋製パン	2,500	915.00	2,287,500	

2217	モロゾフ	2,500	5,100.00	12,750,000	貸付有価証券 800株
2220	亀田製菓	8,300	4,925.00	40,877,500	
2222	寿スピリット	14,000	7,750.00	108,500,000	
2229	カルビー	66,300	3,660.00	242,658,000	貸付有価証券 6,400株 (6,400株)
2264	森永乳業	26,900	4,260.00	114,594,000	
2266	六甲バター	9,600	1,634.00	15,686,400	貸付有価証券 3,900株 (900株)
2267	ヤクルト本社	100,000	5,870.00	587,000,000	
2269	明治ホールディングス	96,100	7,820.00	751,502,000	
2270	雪印メグミルク	35,000	2,499.00	87,465,000	
2281	プリマハム	22,700	2,426.00	55,070,200	貸付有価証券 15,900株 (9,000株)
2282	日本ハム	55,600	4,770.00	265,212,000	
2286	林兼産業	4,800	688.00	3,302,400	
2288	丸大食品	15,500	2,129.00	32,999,500	貸付有価証券 6,300株 (1,500株)
2292	S Foods	11,600	2,679.00	31,076,400	貸付有価証券 3,600株
2294	柿安本店	5,000	3,250.00	16,250,000	
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	93,600	698.00	65,332,800	貸付有価証券 37,600株 (9,000株)
2501	サッポロホールディングス	49,600	2,678.00	132,828,800	貸付有価証券 15,200株
2502	アサヒグループホールディングス	304,500	5,101.00	1,553,254,500	貸付有価証券 57,400株 (29,400株)
2503	キリンホールディングス	616,700	2,460.50	1,517,390,350	
2531	宝ホールディングス	108,900	980.00	106,722,000	貸付有価証券 43,800株 (10,500株)
2533	オエノンホールディングス	38,300	381.00	14,592,300	
2540	養命酒製造	4,500	1,989.00	8,950,500	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	102,100	2,808.00	286,696,800	貸付有価証券 41,100株 (9,900株)
2587	サントリー食品インターナショナル	97,300	4,595.00	447,093,500	
2590	ダイドーグループホールディングス	7,500	4,260.00	31,950,000	貸付有価証券 3,000株 (3,000株)
2593	伊藤園	44,100	5,340.00	235,494,000	貸付有価証券 17,800株 (4,300株)
2594	キーコーヒー	14,300	2,274.00	32,518,200	
2597	ユニカフエ	3,700	966.00	3,574,200	貸付有価証券 1,100株
2599	ジャパンフーズ	2,100	1,289.00	2,706,900	
2602	日清オイリオグループ	18,700	3,700.00	69,190,000	
2607	不二製油グループ本社	35,400	2,851.00	100,925,400	貸付有価証券 25,000株 (14,200株)
2612	かどや製油	1,600	3,840.00	6,144,000	貸付有価証券 500株

2613	J - オイルミルズ	7,500	4,125.00	30,937,500	貸付有価証券 1,600株
2801	キッコーマン	104,600	5,280.00	552,288,000	貸付有価証券 31,800株
2802	味の素	321,100	1,796.00	576,695,600	
2809	キユーピー	81,000	2,320.00	187,920,000	貸付有価証券 24,700株
2810	ハウス食品グループ本社	54,400	3,720.00	202,368,000	
2811	カゴメ	55,200	2,688.00	148,377,600	貸付有価証券 22,200株 (22,200株)
2812	焼津水産化学工業	7,000	1,026.00	7,182,000	
2815	アリアケジャパン	13,300	7,470.00	99,351,000	
2818	ピエトロ	1,900	1,635.00	3,106,500	
2819	エバラ食品工業	3,500	2,205.00	7,717,500	
2820	やまみ	700	2,287.00	1,600,900	
2871	ニチレイ	69,200	2,605.00	180,266,000	
2875	東洋水産	74,800	4,485.00	335,478,000	
2882	イートアンド	5,000	1,873.00	9,365,000	
2883	大冷	1,900	1,947.00	3,699,300	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,022.00	8,176,000	貸付有価証券 3,100株 (700株)
2897	日清食品ホールディングス	61,800	8,300.00	512,940,000	貸付有価証券 9,400株
2899	永谷園ホールディングス	7,100	2,145.00	15,229,500	
2904	一正蒲鉾	5,600	981.00	5,493,600	貸付有価証券 1,600株
2908	フジッコ	15,700	1,923.00	30,191,100	貸付有価証券 6,300株 (6,300株)
2910	ロック・フィールド	15,700	1,453.00	22,812,100	貸付有価証券 11,100株 (6,300株)
2914	日本たばこ産業	839,600	2,317.00	1,945,353,200	
2915	ケンコーマヨネーズ	8,200	2,433.00	19,950,600	貸付有価証券 3,300株 (800株)
2918	わらべや日洋ホールディングス	9,500	1,874.00	17,803,000	貸付有価証券 3,800株 (3,800株)
2922	なとり	8,100	1,702.00	13,786,200	
2924	イフジ産業	2,500	741.00	1,852,500	
2925	ピックルスコーポレーション	3,200	2,609.00	8,348,800	貸付有価証券 300株 (300株)
2930	北の達人コーポレーション	50,800	606.00	30,784,800	貸付有価証券 20,500株 (4,900株)
2931	ユーグレナ	62,000	737.00	45,694,000	貸付有価証券 24,900株 (24,900株)
4404	ミヨシ油脂	5,600	1,175.00	6,580,000	
4526	理研ビタミン	6,900	3,950.00	27,255,000	貸付有価証券 2,100株
3001	片倉工業	20,600	1,245.00	25,647,000	
3002	ゲンゼ	10,400	4,560.00	47,424,000	

3101	東洋紡	56,100	1,519.00	85,215,900	
3103	ユニチカ	41,600	333.00	13,852,800	
3104	富士紡ホールディングス	6,900	4,020.00	27,738,000	2,100株 貸付有価証券
3106	倉敷紡績	14,600	2,334.00	34,076,400	10,400株 (5,900株) 貸付有価証券
3109	シキボウ	7,400	1,407.00	10,411,800	
3201	日本毛織	46,700	1,069.00	49,922,300	4,500株 (4,500株) 貸付有価証券
3202	ダイトウボウ	22,900	86.00	1,969,400	
3204	トーア紡コーポレーション	5,600	511.00	2,861,600	
3205	ダイドーリミテッド	18,700	276.00	5,161,200	
3302	帝国繊維	15,900	2,367.00	37,635,300	6,400株 (1,500株) 貸付有価証券
3401	帝人	115,700	1,984.00	229,548,800	
3402	東レ	1,027,300	725.60	745,408,880	
3408	サカイオーベックス	3,800	1,854.00	7,045,200	
3501	住江織物	4,100	2,410.00	9,881,000	2,500株 (1,400株) 貸付有価証券
3512	日本ファルト	8,000	494.00	3,952,000	
3513	イチカワ	2,000	1,454.00	2,908,000	
3524	日東製綱	1,600	1,712.00	2,739,200	
3529	アツギ	11,700	843.00	9,863,100	
3551	ダイニック	5,400	806.00	4,352,400	1,000株 貸付有価証券
3569	セーレン	34,900	1,405.00	49,034,500	
3571	ソトー	5,600	970.00	5,432,000	
3577	東海染工	2,000	1,132.00	2,264,000	
3580	小松マテーレ	23,300	750.00	17,475,000	9,300株 (2,200株) 貸付有価証券
3591	ワコールホールディングス	37,000	2,945.00	108,965,000	
3593	ホギメディカル	16,200	3,880.00	62,856,000	700株 (700株) 貸付有価証券
3606	レナウン	36,500	110.00	4,015,000	
3607	クラウディアホールディングス	3,500	482.00	1,687,000	
3608	T S I ホールディングス	47,600	545.00	25,942,000	
3611	マツオカコーポレーション	4,100	2,030.00	8,323,000	1,200株 貸付有価証券
3612	ワールド	20,100	2,449.00	49,224,900	
8011	三陽商会	7,400	1,277.00	9,449,800	4,600株 (2,300株) 貸付有価証券
8013	ナイガイ	5,200	445.00	2,314,000	
8016	オンワードホールディングス	85,200	630.00	53,676,000	34,300株 (34,300株) 貸付有価証券
8029	ルックホールディングス	4,800	1,075.00	5,160,000	
8107	キムラタン	74,000	29.00	2,146,000	29,600株 (7,100株) 貸付有価証券

8111	ゴールドワイン	25,700	6,660.00	171,162,000	貸付有価証券 10,300株 (10,300株)
8114	デサント	27,700	1,788.00	49,527,600	貸付有価証券 8,600株
8118	キング	6,700	564.00	3,778,800	
8127	ヤマトイインターナショナル	8,600	403.00	3,465,800	
3708	特種東海製紙	9,000	3,960.00	35,640,000	貸付有価証券 6,400株 (3,600株)
3861	王子ホールディングス	593,100	575.00	341,032,500	
3863	日本製紙	62,700	1,818.00	113,988,600	貸付有価証券 25,300株 (25,300株)
3864	三菱製紙	16,100	462.00	7,438,200	
3865	北越コーポレーション	94,100	524.00	49,308,400	
3877	中越パルプ工業	6,000	1,596.00	9,576,000	
3878	巴川製紙所	4,200	860.00	3,612,000	
3880	大王製紙	62,200	1,448.00	90,065,600	貸付有価証券 25,100株 (25,100株)
3896	阿波製紙	3,700	571.00	2,112,700	貸付有価証券 1,500株 (400株)
3941	レンゴー	134,100	796.00	106,743,600	貸付有価証券 13,000株 (13,000株)
3946	トーモク	8,700	1,780.00	15,486,000	貸付有価証券 1,500株
3950	ザ・パック	10,700	3,820.00	40,874,000	貸付有価証券 7,600株 (4,300株)
3405	クラレ	223,500	1,321.00	295,243,500	貸付有価証券 89,900株 (21,600株)
3407	旭化成	940,500	1,129.00	1,061,824,500	
3553	共和レザー	7,700	797.00	6,136,900	貸付有価証券 1,600株
4004	昭和電工	101,000	2,684.00	271,084,000	貸付有価証券 40,600株 (9,700株)
4005	住友化学	1,042,400	477.00	497,224,800	
4008	住友精化	6,300	3,190.00	20,097,000	
4021	日産化学	79,300	4,525.00	358,832,500	
4022	ラサ工業	5,000	1,462.00	7,310,000	貸付有価証券 1,900株 (1,900株)
4023	クレハ	12,200	6,520.00	79,544,000	貸付有価証券 8,600株 (4,900株)
4025	多木化学	4,100	4,340.00	17,794,000	貸付有価証券 1,700株 (400株)
4027	ティカ	10,400	1,922.00	19,988,800	貸付有価証券 7,400株 (4,200株)
4028	石原産業	25,400	939.00	23,850,600	
4031	片倉コーポアグリ	3,700	1,224.00	4,528,800	
4041	日本曹達	21,000	3,020.00	63,420,000	
4042	東ソー	219,300	1,602.00	351,318,600	貸付有価証券 67,000株
4043	トクヤマ	40,900	2,658.00	108,712,200	

4044	セントラル硝子	29,000	2,441.00	70,789,000	貸付有価証券 8,500株
4045	東亞合成	89,100	1,218.00	108,523,800	
4046	大阪ソーダ	14,400	2,999.00	43,185,600	貸付有価証券 1,400株 (1,400株)
4047	関東電化工業	33,600	1,016.00	34,137,600	
4061	デンカ	51,800	3,010.00	155,918,000	
4063	信越化学工業	243,600	12,395.00	3,019,422,000	
4064	日本カーバイド工業	4,800	1,379.00	6,619,200	
4078	堺化学工業	9,200	2,226.00	20,479,200	貸付有価証券 3,000株 (900株)
4082	第一稀元素化学工業	15,400	929.00	14,306,600	貸付有価証券 1,500株 (1,500株)
4088	エア・ウォーター	132,000	1,523.00	201,036,000	
4091	大陽日酸	136,400	2,401.00	327,496,400	
4092	日本化学工業	4,400	3,255.00	14,322,000	貸付有価証券 3,200株 (1,800株)
4093	東邦アセチレン	2,100	1,365.00	2,866,500	
4095	日本パーカライジング	71,600	1,154.00	82,626,400	
4097	高圧ガス工業	22,500	803.00	18,067,500	貸付有価証券 6,900株
4098	チタン工業	1,800	2,516.00	4,528,800	貸付有価証券 1,200株 (700株)
4099	四国化成工業	21,900	1,261.00	27,615,900	貸付有価証券 8,800株 (2,100株)
4100	戸田工業	3,300	2,090.00	6,897,000	貸付有価証券 1,300株 (1,300株)
4109	ステラ ケミファ	7,700	3,125.00	24,062,500	
4112	保土谷化学工業	5,300	3,980.00	21,094,000	貸付有価証券 1,600株
4114	日本触媒	22,000	6,470.00	142,340,000	貸付有価証券 8,900株 (2,100株)
4116	大日精化工業	12,600	2,960.00	37,296,000	貸付有価証券 3,800株
4118	力ネ力	36,700	3,380.00	124,046,000	貸付有価証券 3,500株 (3,500株)
4182	三菱瓦斯化学	133,900	1,669.00	223,479,100	貸付有価証券 41,100株
4183	三井化学	128,800	2,454.00	316,075,200	
4185	J S R	132,200	2,003.00	264,796,600	
4186	東京応化工業	24,300	4,785.00	116,275,500	貸付有価証券 17,100株 (9,700株)
4187	大阪有機化学工業	13,100	1,868.00	24,470,800	貸付有価証券 4,000株
4188	三菱ケミカルホールディングス	948,500	797.10	756,049,350	
4189	K Hネオケム	25,000	2,291.00	57,275,000	貸付有価証券 12,000株 (10,000株)
4202	ダイセル	194,100	1,033.00	200,505,300	貸付有価証券 59,300株

4203	住友ベークライト	22,300	4,150.00	92,545,000	
4204	積水化学工業	305,100	1,882.00	574,198,200	
4205	日本ゼオン	128,000	1,259.00	161,152,000	39,100株 貸付有価証券
4206	アイカ工業	42,600	3,475.00	148,035,000	16,000株 (4,100株) 貸付有価証券
4208	宇部興産	71,700	2,244.00	160,894,800	6,900株 (6,900株) 貸付有価証券
4212	積水樹脂	25,500	2,259.00	57,604,500	
4215	タキロンシーアイ	30,700	711.00	21,827,700	
4216	旭有機材	8,000	1,692.00	13,536,000	3,200株 (3,200株) 貸付有価証券
4217	日立化成	64,000	4,595.00	294,080,000	
4218	ニチバン	7,500	1,730.00	12,975,000	2,900株 (2,900株) 貸付有価証券
4220	リケンテクノス	35,700	493.00	17,600,100	
4221	大倉工業	6,700	1,779.00	11,919,300	1,500株 貸付有価証券
4228	積水化成品工業	19,000	773.00	14,687,000	1,800株 (1,800株) 貸付有価証券
4229	群栄化学工業	3,200	2,503.00	8,009,600	1,300株 (1,300株) 貸付有価証券
4231	タイガースポリマー	7,500	584.00	4,380,000	
4238	ミライアル	5,000	1,299.00	6,495,000	500株 (500株) 貸付有価証券
4245	ダイキアクシス	5,000	872.00	4,360,000	2,000株 (500株) 貸付有価証券
4246	ダイキヨーニシカワ	29,900	764.00	22,843,600	2,900株 (2,900株) 貸付有価証券
4248	竹本容器	5,100	903.00	4,605,300	2,100株 (500株) 貸付有価証券
4249	森六ホールディングス	7,600	2,240.00	17,024,000	1,600株 貸付有価証券
4272	日本化薬	87,800	1,291.00	113,349,800	26,900株 貸付有価証券
4275	カーリットホールディングス	15,100	585.00	8,833,500	1,500株 (1,500株) 貸付有価証券
4362	日本精化	11,400	1,425.00	16,245,000	4,600株 (1,100株) 貸付有価証券
4368	扶桑化学工業	14,400	3,185.00	45,864,000	5,800株 (1,400株) 貸付有価証券
4369	トリケミカル研究所	3,200	10,670.00	34,144,000	1,300株 (300株) 貸付有価証券
4401	A D E K A	65,300	1,624.00	106,047,200	20,000株 貸付有価証券
4403	日油	53,400	3,490.00	186,366,000	16,300株 貸付有価証券
4406	新日本理化	23,500	197.00	4,629,500	9,500株 (9,500株) 貸付有価証券
4410	ハリマ化成グループ	11,700	1,133.00	13,256,100	4,700株 (1,100株) 貸付有価証券

4452	花王	346,900	9,100.00	3,156,790,000	
4461	第一工業製薬	5,300	4,330.00	22,949,000	貸付有価証券 1,600株
4462	石原ケミカル	3,900	1,957.00	7,632,300	貸付有価証券 1,100株
4463	日華化学	4,800	860.00	4,128,000	貸付有価証券 3,400株 (1,900株)
4465	ニイタカ	2,200	2,795.00	6,149,000	
4471	三洋化成工業	8,500	5,210.00	44,285,000	
4531	有機合成薬品工業	10,900	288.00	3,139,200	貸付有価証券 400株
4611	大日本塗料	16,000	1,149.00	18,384,000	
4612	日本ペイントホールディングス	117,100	5,150.00	603,065,000	貸付有価証券 47,000株 (47,000株)
4613	関西ペイント	159,400	2,609.00	415,874,600	貸付有価証券 64,100株 (15,400株)
4615	神東塗料	11,200	211.00	2,363,200	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	40,400	1,053.00	42,541,200	
4619	日本特殊塗料	10,600	1,332.00	14,119,200	貸付有価証券 4,200株 (4,200株)
4620	藤倉化成	19,100	561.00	10,715,100	
4626	太陽ホールディングス	10,400	4,630.00	48,152,000	貸付有価証券 1,000株 (1,000株)
4631	D I C	59,900	2,928.00	175,387,200	
4633	サカタインクス	31,000	1,126.00	34,906,000	
4634	東洋インキ S C ホールディングス	30,000	2,502.00	75,060,000	貸付有価証券 12,100株 (2,900株)
4636	T & K TOKA	11,000	990.00	10,890,000	
4901	富士フィルムホールディングス	277,800	5,656.00	1,571,236,800	
4911	資生堂	287,900	7,060.00	2,032,574,000	貸付有価証券 27,800株 (27,800株)
4912	ライオン	188,400	2,091.00	393,944,400	貸付有価証券 200株 (200株)
4914	高砂香料工業	9,100	2,394.00	21,785,400	貸付有価証券 2,800株
4917	マンダム	32,600	2,884.00	94,018,400	貸付有価証券 3,100株 (3,100株)
4919	ミルボン	19,400	6,180.00	119,892,000	貸付有価証券 7,800株 (7,800株)
4921	ファンケル	58,600	2,797.00	163,904,200	貸付有価証券 18,000株
4922	コーセー	27,300	15,060.00	411,138,000	貸付有価証券 10,900株 (2,600株)
4923	コタ	7,600	1,596.00	12,129,600	
4926	シーボン	1,900	2,483.00	4,717,700	貸付有価証券 500株
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	61,800	2,361.00	145,909,800	
4928	ノエビアホールディングス	13,800	5,460.00	75,348,000	

4929	アジュバンコスメジャパン	3,200	992.00	3,174,400	
4951	エステー	9,300	1,642.00	15,270,600	貸付有価証券 3,800株(900株)
4955	アグロ カネショウ	4,500	1,464.00	6,588,000	貸付有価証券 1,800株(400株)
4956	コニシ	23,800	1,580.00	37,604,000	貸付有価証券 9,600株(2,300株)
4958	長谷川香料	19,200	2,251.00	43,219,200	貸付有価証券 5,900株
4963	星光PMC	8,300	958.00	7,951,400	
4967	小林製薬	40,600	8,860.00	359,716,000	貸付有価証券 16,300株(16,300株)
4968	荒川化学工業	13,000	1,536.00	19,968,000	貸付有価証券 9,200株(5,200株)
4971	メック	9,900	1,496.00	14,810,400	貸付有価証券 3,000株
4973	日本高純度化学	4,000	2,628.00	10,512,000	
4974	タカラバイオ	37,900	2,095.00	79,400,500	貸付有価証券 15,300株(3,700株)
4975	JCU	17,500	3,290.00	57,575,000	貸付有価証券 5,400株
4977	新田ゼラチン	9,100	666.00	6,060,600	貸付有価証券 6,500株(3,700株)
4979	OATアグリオ	2,500	1,400.00	3,500,000	貸付有価証券 200株(200株)
4980	デクセリアルズ	37,400	995.00	37,213,000	
4985	アース製薬	10,900	5,760.00	62,784,000	
4992	北興化学工業	14,800	636.00	9,412,800	
4994	大成ラミック	4,800	2,848.00	13,670,400	
4996	クミアイ化学工業	59,900	898.00	53,790,200	貸付有価証券 42,400株(24,100株)
4997	日本農薬	25,800	579.00	14,938,200	貸付有価証券 10,400株(2,500株)
5142	アキレス	10,000	1,752.00	17,520,000	貸付有価証券 1,200株
5208	有沢製作所	22,900	1,025.00	23,472,500	貸付有価証券 9,200株(9,200株)
6988	日東電工	100,000	6,120.00	612,000,000	
7874	レック	15,400	1,212.00	18,664,800	貸付有価証券 10,900株(6,200株)
7888	三光合成	16,600	367.00	6,092,200	
7908	きもと	24,600	176.00	4,329,600	
7917	藤森工業	13,000	3,385.00	44,005,000	
7925	前澤化成工業	9,200	1,160.00	10,672,000	貸付有価証券 2,800株
7931	未来工業	7,800	2,195.00	17,121,000	貸付有価証券 2,500株(100株)
7940	ウェーブロックホールディングス	5,000	793.00	3,965,000	

7942	J S P	8,500	1,965.00	16,702,500 3,400株 (3,400株)	貸付有価証券
7947	エフピコ	15,900	6,360.00	101,124,000 1,500株 (1,500株)	貸付有価証券
7958	天馬	9,600	1,986.00	19,065,600	
7970	信越ポリマー	26,000	1,034.00	26,884,000 10,400株 (2,500株)	貸付有価証券
7971	東リ	36,100	292.00	10,541,200	
7988	ニフコ	53,200	2,858.00	152,045,600 5,100株 (5,100株)	貸付有価証券
7995	パルカー	11,800	2,552.00	30,113,600 100株	貸付有価証券
8113	ユニ・チャーム	279,200	3,710.00	1,035,832,000 85,300株	貸付有価証券
9385	ショーエイコーポレーション	1,600	820.00	1,312,000 600株 (100株)	貸付有価証券
4151	協和キリン	145,700	2,653.00	386,542,100	
4502	武田薬品工業	1,205,300	4,297.00	5,179,174,100	
4503	アステラス製薬	1,274,300	1,890.50	2,409,064,150	
4506	大日本住友製薬	107,400	2,023.00	217,270,200	
4507	塩野義製薬	185,200	6,691.00	1,239,173,200	
4512	わかもと製薬	17,200	277.00	4,764,400 5,200株	貸付有価証券
4514	あすか製薬	16,500	1,210.00	19,965,000	
4516	日本新薬	37,900	9,900.00	375,210,000 11,600株	貸付有価証券
4517	ビオフェルミン製薬	2,500	2,327.00	5,817,500	
4519	中外製薬	151,000	10,605.00	1,601,355,000	
4521	科研製薬	24,800	5,850.00	145,080,000	
4523	エーザイ	173,400	8,245.00	1,429,683,000	
4527	ポート製薬	74,400	3,175.00	236,220,000 14,700株	貸付有価証券
4528	小野薬品工業	332,700	2,575.50	856,868,850	
4530	久光製薬	38,300	5,830.00	223,289,000 29,800株 (16,700株)	貸付有価証券
4534	持田製薬	20,100	4,220.00	84,822,000 1,100株	貸付有価証券
4536	参天製薬	269,800	2,093.00	564,691,400 79,100株 (26,000株)	貸付有価証券
4538	扶桑薬品工業	5,100	1,921.00	9,797,100	
4539	日本ケミファ	1,900	2,999.00	5,698,100 1,000株 (800株)	貸付有価証券
4540	ツムラ	44,900	3,070.00	137,843,000 4,300株 (4,300株)	貸付有価証券
4541	日医工	41,000	1,343.00	55,063,000 3,900株 (3,900株)	貸付有価証券
4547	キッセイ薬品工業	25,600	3,050.00	78,080,000	
4548	生化学工業	28,100	1,182.00	33,214,200	

4549	栄研化学	25,500	2,327.00	59,338,500	貸付有価証券 10,300株(2,500株)
4550	日水製薬	6,100	1,339.00	8,167,900	
4551	鳥居薬品	9,100	3,775.00	34,352,500	貸付有価証券 100株(100株)
4552	JCRファーマ	10,200	9,550.00	97,410,000	
4553	東和薬品	18,500	2,592.00	47,952,000	
4554	富士製薬工業	9,800	1,570.00	15,386,000	貸付有価証券 3,000株
4555	沢井製薬	29,700	7,250.00	215,325,000	
4559	ゼリア新薬工業	26,300	1,997.00	52,521,100	
4568	第一三共	414,600	7,469.00	3,096,647,400	
4569	キヨーリン製薬ホールディングス	32,000	2,004.00	64,128,000	
4574	大幸薬品	5,800	4,420.00	25,636,000	貸付有価証券 600株(600株)
4577	ダイト	8,500	3,610.00	30,685,000	
4578	大塚ホールディングス	276,000	4,882.00	1,347,432,000	
4581	大正製薬ホールディングス	30,600	7,900.00	241,740,000	
4587	ペプチドリーム	73,300	5,390.00	395,087,000	貸付有価証券 51,800株(29,400株)
3315	日本コークス工業	122,400	77.00	9,424,800	貸付有価証券 37,400株
5011	ニチレキ	17,100	1,344.00	22,982,400	
5013	ユシロ化学工業	8,100	1,350.00	10,935,000	
5015	ビーピー・カストロール	5,200	1,440.00	7,488,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
5017	富士石油	38,700	231.00	8,939,700	貸付有価証券 15,500株(15,500株)
5018	MORESCO	5,200	1,416.00	7,363,200	
5019	出光興産	163,000	2,852.00	464,876,000	
5020	JXTGホールディングス	2,179,400	479.80	1,045,676,120	
5021	コスモエネルギーホールディングス	41,900	2,220.00	93,018,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
5101	横浜ゴム	83,900	1,914.00	160,584,600	貸付有価証券 33,300株(8,100株)
5105	TOYO TIRE	83,200	1,387.00	115,398,400	
5108	ブリヂストン	445,300	3,895.00	1,734,443,500	
5110	住友ゴム工業	130,100	1,202.00	156,380,200	貸付有価証券 52,400株(12,600株)
5121	藤倉コンポジット	12,700	445.00	5,651,500	
5122	オカモト	8,800	3,850.00	33,880,000	
5185	フコク	6,300	721.00	4,542,300	
5186	ニッタ	16,300	3,030.00	49,389,000	貸付有価証券 6,500株(6,500株)
5191	住友理工	28,100	875.00	24,587,500	貸付有価証券 19,500株(11,300株)
5192	三ツ星ベルト	19,100	1,921.00	36,691,100	貸付有価証券 4,200株

5195	パンドー化学	25,500	841.00	21,445,500	
3110	日東紡績	21,600	4,975.00	107,460,000	貸付有価証券 8,700株(2,100株)
5201	A G C	143,200	3,885.00	556,332,000	
5202	日本板硝子	69,300	647.00	44,837,100	貸付有価証券 21,200株
5204	石塚硝子	2,700	2,578.00	6,960,600	
5210	日本山村硝子	6,000	1,235.00	7,410,000	
5214	日本電気硝子	58,200	2,221.00	129,262,200	
5218	オハラ	5,700	1,303.00	7,427,100	貸付有価証券 2,300株(600株)
5232	住友大阪セメント	27,400	4,550.00	124,670,000	貸付有価証券 700株(700株)
5233	太平洋セメント	91,500	3,015.00	275,872,500	貸付有価証券 28,000株
5262	日本ヒューム	14,500	809.00	11,730,500	
5269	日本コンクリート工業	31,200	281.00	8,767,200	貸付有価証券 12,500株(3,000株)
5273	三谷セキサン	6,700	3,805.00	25,493,500	貸付有価証券 3,200株(1,100株)
5288	アジアパイルホールディングス	20,600	567.00	11,680,200	
5301	東海カーボン	151,800	994.00	150,889,200	貸付有価証券 107,400株(61,000株)
5302	日本カーボン	7,500	3,815.00	28,612,500	貸付有価証券 5,300株(3,000株)
5310	東洋炭素	8,500	2,096.00	17,816,000	貸付有価証券 2,600株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	8,000	4,420.00	35,360,000	
5332	TOTO	103,500	4,630.00	479,205,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
5333	日本碍子	176,800	1,902.00	336,273,600	
5334	日本特殊陶業	112,800	2,015.00	227,292,000	
5337	ダントーホールディングス	10,800	113.00	1,220,400	貸付有価証券 2,900株
5344	MARUWA	5,600	8,530.00	47,768,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
5351	品川リフラクトリーズ	3,800	3,130.00	11,894,000	貸付有価証券 1,200株
5352	黒崎播磨	2,900	6,520.00	18,908,000	貸付有価証券 2,000株(1,100株)
5357	ヨータイ	11,500	710.00	8,165,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
5358	イソライト工業	7,400	639.00	4,728,600	
5363	東京窯業	18,400	327.00	6,016,800	貸付有価証券 13,000株(7,400株)
5367	ニッカトー	6,600	711.00	4,692,600	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
5384	フジミインコーポレーテッド	12,900	3,080.00	39,732,000	貸付有価証券 9,200株(5,200株)

5388	クニミネ工業	5,800	1,315.00	7,627,000	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,400	1,592.00	3,820,800	貸付有価証券 800株
5393	ニチアス	39,700	2,713.00	107,706,100	貸付有価証券 15,900株 (3,800株)
7943	ニチハ	20,100	2,510.00	50,451,000	
5401	日本製鉄	641,200	1,584.50	1,015,981,400	
5406	神戸製鋼所	262,200	526.00	137,917,200	
5408	中山製鋼所	19,900	503.00	10,009,700	
5410	合同製鐵	7,700	2,627.00	20,227,900	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	386,900	1,380.00	533,922,000	
5423	東京製鐵	69,700	827.00	57,641,900	貸付有価証券 21,400株
5440	共英製鋼	16,200	2,060.00	33,372,000	貸付有価証券 6,500株 (1,600株)
5444	大和工業	30,400	2,610.00	79,344,000	
5445	東京鐵鋼	5,900	1,502.00	8,861,800	貸付有価証券 300株 (300株)
5449	大阪製鐵	7,600	1,555.00	11,818,000	貸付有価証券 2,400株
5451	淀川製鋼所	19,300	1,965.00	37,924,500	貸付有価証券 7,800株 (1,900株)
5463	丸一鋼管	46,500	3,045.00	141,592,500	貸付有価証券 33,000株 (18,700株)
5464	モリ工業	4,300	2,471.00	10,625,300	貸付有価証券 1,700株 (1,700株)
5471	大同特殊鋼	23,500	4,355.00	102,342,500	貸付有価証券 16,600株 (9,400株)
5476	日本高周波鋼業	5,300	435.00	2,305,500	
5480	日本冶金工業	11,800	2,170.00	25,606,000	
5481	山陽特殊製鋼	10,300	1,555.00	16,016,500	
5482	愛知製鋼	8,100	3,555.00	28,795,500	
5486	日立金属	154,300	1,741.00	268,636,300	貸付有価証券 47,200株
5491	日本金属	3,300	867.00	2,861,100	
5541	大平洋金属	9,700	2,098.00	20,350,600	貸付有価証券 3,800株 (3,800株)
5563	新日本電工	92,300	159.00	14,675,700	貸付有価証券 65,300株 (37,100株)
5602	栗本鐵工所	7,100	2,115.00	15,016,500	
5603	虹技	2,100	1,412.00	2,965,200	
5612	日本鑄鉄管	1,500	1,824.00	2,736,000	
5632	三菱製鋼	10,600	1,010.00	10,706,000	貸付有価証券 1,000株 (1,000株)
5658	日亜鋼業	21,000	368.00	7,728,000	貸付有価証券 14,800株 (8,400株)
5659	日本精線	2,300	3,720.00	8,556,000	

5698	エンビプロ・ホールディングス	5,400	784.00	4,233,600	貸付有価証券 1,600株
6319	シンニッタン	22,300	467.00	10,414,100	貸付有価証券 8,900株 (8,900株)
7305	新家工業	3,300	1,442.00	4,758,600	
5702	大紀アルミニウム工業所	23,500	730.00	17,155,000	貸付有価証券 2,300株 (2,300株)
5703	日本軽金属ホールディングス	362,500	209.00	75,762,500	
5706	三井金属鉱業	38,700	2,631.00	101,819,700	貸付有価証券 11,800株
5707	東邦亜鉛	7,300	1,855.00	13,541,500	
5711	三菱マテリアル	94,600	2,812.00	266,015,200	貸付有価証券 9,100株 (9,100株)
5713	住友金属鉱山	183,100	3,194.00	584,821,400	
5714	DOWAホールディングス	36,200	4,010.00	145,162,000	貸付有価証券 14,600株 (3,500株)
5715	古河機械金属	25,500	1,354.00	34,527,000	貸付有価証券 2,400株 (2,400株)
5721	エス・サイエンス	63,300	46.00	2,911,800	貸付有価証券 44,700株 (25,400株)
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	14,900	1,433.00	21,351,700	貸付有価証券 10,600株 (6,000株)
5727	東邦チタニウム	25,600	880.00	22,528,000	貸付有価証券 18,000株 (10,200株)
5741	UACJ	21,700	2,207.00	47,891,900	
5757	CKサンエツ	3,000	3,300.00	9,900,000	
5801	古河電気工業	44,500	2,667.00	118,681,500	
5802	住友電気工業	535,700	1,548.50	829,531,450	
5803	フジクラ	173,000	402.00	69,546,000	
5805	昭和電線ホールディングス	16,600	1,401.00	23,256,600	
5807	東京特殊電線	2,100	2,478.00	5,203,800	
5809	タツタ電線	28,400	601.00	17,068,400	
5819	カナレ電気	2,400	1,812.00	4,348,800	
5821	平河ヒューテック	5,400	1,502.00	8,110,800	貸付有価証券 1,600株
5851	リヨービ	17,600	1,813.00	31,908,800	貸付有価証券 200株 (200株)
5852	アーレスティ	18,800	527.00	9,907,600	
5857	アサヒホールディングス	25,100	2,863.00	71,861,300	
3421	稻葉製作所	8,100	1,388.00	11,242,800	
3431	宮地エンジニアリンググループ	4,400	1,985.00	8,734,000	
3433	トーカロ	39,800	1,181.00	47,003,800	貸付有価証券 12,100株
3434	アルファCO	5,000	1,317.00	6,585,000	
3436	SUMCO	171,500	1,828.00	313,502,000	貸付有価証券 68,900株 (16,500株)
3443	川田テクノロジーズ	2,900	6,360.00	18,444,000	

3445	R S Technologies	4,000	3,115.00	12,460,000	貸付有価証券 1,500株(200株)
3447	信和	6,100	1,105.00	6,740,500	
5901	東洋製罐グループホールディングス	91,200	1,886.00	172,003,200	貸付有価証券 27,900株
5902	ホッカントホールディングス	7,900	1,901.00	15,017,900	
5909	コロナ	7,900	1,029.00	8,129,100	
5911	横河ブリッジホールディングス	26,600	1,893.00	50,353,800	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
5915	駒井ハルテック	2,700	1,882.00	5,081,400	
5923	高田機工	1,300	2,703.00	3,513,900	
5929	三和ホールディングス	137,400	1,202.00	165,154,800	
5930	文化シヤッター	42,200	883.00	37,262,600	貸付有価証券 12,900株
5932	三協立山	19,900	1,399.00	27,840,100	
5933	アルインコ	10,400	1,216.00	12,646,400	貸付有価証券 3,200株
5936	東洋シヤッター	3,400	781.00	2,655,400	
5938	LIXILグループ	211,400	1,872.00	395,740,800	貸付有価証券 85,000株(20,400株)
5942	日本ファイルコン	11,000	551.00	6,061,000	貸付有価証券 3,300株
5943	ノーリツ	29,700	1,357.00	40,302,900	
5946	長府製作所	14,600	2,310.00	33,726,000	貸付有価証券 10,400株(5,900株)
5947	リンナイ	27,900	8,010.00	223,479,000	貸付有価証券 7,400株
5951	ダイニチ工業	7,700	679.00	5,228,300	
5957	日東精工	19,800	598.00	11,840,400	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
5958	三洋工業	1,900	1,965.00	3,733,500	
5959	岡部	29,000	859.00	24,911,000	
5970	ジーテクト	17,800	1,650.00	29,370,000	貸付有価証券 7,000株(1,700株)
5975	東プレ	26,700	1,685.00	44,989,500	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
5976	高周波熱鍊	27,600	860.00	23,736,000	貸付有価証券 5,300株
5981	東京製綱	10,200	1,113.00	11,352,600	
5985	サンコール	8,000	534.00	4,272,000	
5986	モリテック スチール	11,200	368.00	4,121,600	貸付有価証券 4,100株(700株)
5988	パイオラックス	21,200	1,991.00	42,209,200	貸付有価証券 15,000株(8,500株)
5989	エイチワン	14,000	752.00	10,528,000	
5991	日本発條	153,700	918.00	141,096,600	貸付有価証券 61,600株(14,800株)
5992	中央発條	1,700	2,981.00	5,067,700	

5998	アドバネクス	2,100	1,694.00	3,557,400	貸付有価証券 800株(200株)
7989	立川ブラインド工業	6,300	1,230.00	7,749,000	
8155	三益半導体工業	12,800	2,496.00	31,948,800	貸付有価証券 3,800株
1909	日本ドライケミカル	3,600	1,813.00	6,526,800	
5631	日本製鋼所	43,500	2,092.00	91,002,000	
6005	三浦工業	62,000	3,905.00	242,110,000	貸付有価証券 43,900株(24,900株)
6013	タクマ	48,500	1,217.00	59,024,500	貸付有価証券 13,200株
6101	ツガミ	29,700	1,066.00	31,660,200	貸付有価証券 21,000株(11,900株)
6103	オークマ	16,700	5,210.00	87,007,000	貸付有価証券 5,100株
6104	東芝機械	16,200	3,365.00	54,513,000	貸付有価証券 6,500株(1,600株)
6113	アマダホールディングス	182,100	1,199.00	218,337,900	
6118	アイダエンジニアリング	37,500	908.00	34,050,000	貸付有価証券 7,300株
6121	滝澤鉄工所	4,400	1,354.00	5,957,600	
6134	F U J I	61,600	1,809.00	111,434,400	貸付有価証券 18,800株
6135	牧野フライス製作所	16,800	4,450.00	74,760,000	貸付有価証券 5,200株
6136	オーエスジー	66,200	1,939.00	128,361,800	貸付有価証券 1,200株
6138	ダイジェット工業	1,600	1,451.00	2,321,600	
6140	旭ダイヤモンド工業	37,600	611.00	22,973,600	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
6141	D M G 森精機	90,600	1,600.00	144,960,000	貸付有価証券 36,400株(8,700株)
6143	ソディック	33,700	925.00	31,172,500	
6146	ディスコ	19,400	26,720.00	518,368,000	貸付有価証券 6,000株
6151	日東工器	7,800	2,317.00	18,072,600	
6157	日進工具	4,200	2,858.00	12,003,600	貸付有価証券 1,700株(400株)
6165	パンチ工業	12,900	484.00	6,243,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6167	富士ダイス	6,300	754.00	4,750,200	貸付有価証券 2,500株(600株)
6203	豊和工業	7,900	888.00	7,015,200	貸付有価証券 2,400株
6205	O K K	5,900	621.00	3,663,900	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
6208	石川製作所	3,400	1,690.00	5,746,000	貸付有価証券 2,300株(1,300株)
6210	東洋機械金属	10,200	541.00	5,518,200	

6217	津田駒工業	2,800	1,126.00	3,152,800 1,100株(300株)	貸付有価証券
6218	エンシュウ	3,400	1,265.00	4,301,000	
6222	島精機製作所	23,000	2,203.00	50,669,000 9,200株(9,200株)	貸付有価証券
6235	オプトラン	16,000	3,185.00	50,960,000	
6236	N C ホールディングス	4,300	643.00	2,764,900	
6237	イワキポンプ	6,800	1,199.00	8,153,200 2,100株	貸付有価証券
6238	フリュー	14,000	1,181.00	16,534,000	
6240	ヤマシンフィルタ	31,100	764.00	23,760,400 9,400株	貸付有価証券
6247	日阪製作所	17,700	918.00	16,248,600 4,600株(200株)	貸付有価証券
6250	やまびこ	27,800	1,106.00	30,746,800	
6258	平田機工	6,800	6,570.00	44,676,000 2,100株	貸付有価証券
6262	ペガサスミシン製造	14,500	498.00	7,221,000	
6264	マルマエ	5,900	985.00	5,811,500 1,800株	貸付有価証券
6266	タツモ	6,700	1,361.00	9,118,700 2,000株	貸付有価証券
6268	ナブテスコ	84,400	3,320.00	280,208,000 33,900株(8,100株)	貸付有価証券
6269	三井海洋開発	15,200	2,545.00	38,684,000 1,500株(1,500株)	貸付有価証券
6272	レオン自動機	14,000	1,532.00	21,448,000 8,600株(5,700株)	貸付有価証券
6273	S M C	45,500	49,590.00	2,256,345,000 4,400株(4,400株)	貸付有価証券
6274	ヤマハモーターロボティクスホールディングス	12,500	521.00	6,512,500 5,000株(5,000株)	貸付有価証券
6277	ホソカワミクロン	5,000	5,030.00	25,150,000	
6278	ユニオンツール	5,300	3,180.00	16,854,000	
6282	オイレス工業	18,500	1,562.00	28,897,000	
6284	日精工一・エス・ピー機械	4,800	4,010.00	19,248,000 2,700株(1,200株)	貸付有価証券
6287	サトーホールディングス	20,400	3,185.00	64,974,000 14,300株(8,100株)	貸付有価証券
6289	技研製作所	12,600	4,770.00	60,102,000 1,200株(1,200株)	貸付有価証券
6291	日本エアーテック	4,400	1,029.00	4,527,600 1,300株	貸付有価証券
6292	カワタ	4,200	977.00	4,103,400 400株(400株)	貸付有価証券
6293	日精樹脂工業	12,000	973.00	11,676,000 1,200株(1,200株)	貸付有価証券
6294	オカダアイヨン	4,500	1,235.00	5,557,500 400株(400株)	貸付有価証券
6298	ワイエイシイホールディングス	6,100	669.00	4,080,900	

6301	小松製作所	656,200	2,567.00	1,684,465,400	貸付有価証券 182,400株(63,300株)
6302	住友重機械工業	82,900	2,960.00	245,384,000	
6305	日立建機	58,100	3,170.00	184,177,000	貸付有価証券 23,400株(5,600株)
6306	日工	19,800	816.00	16,156,800	
6309	巴工業	6,200	2,216.00	13,739,200	貸付有価証券 1,900株
6310	井関農機	14,500	1,476.00	21,402,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
6315	TOWA	14,600	1,069.00	15,607,400	
6316	丸山製作所	3,200	1,226.00	3,923,200	
6317	北川鉄工所	6,500	2,283.00	14,839,500	
6323	ローツエ	6,300	4,515.00	28,444,500	貸付有価証券 2,500株(600株)
6325	タカキタ	5,000	608.00	3,040,000	貸付有価証券 2,100株(500株)
6326	クボタ	768,600	1,740.50	1,337,748,300	貸付有価証券 309,200株(74,200株)
6328	荏原実業	3,600	2,191.00	7,887,600	
6331	三菱化工機	5,000	1,811.00	9,055,000	
6332	月島機械	26,700	1,526.00	40,744,200	貸付有価証券 10,800株(2,600株)
6333	帝国電機製作所	11,900	1,375.00	16,362,500	
6335	東京機械製作所	5,900	365.00	2,153,500	貸付有価証券 500株
6339	新東工業	34,400	945.00	32,508,000	貸付有価証券 7,000株
6340	澁谷工業	12,700	3,110.00	39,497,000	貸付有価証券 4,700株(900株)
6345	アイチ コーポレーション	25,000	798.00	19,950,000	貸付有価証券 7,600株
6349	小森コーポレーション	36,700	1,067.00	39,158,900	貸付有価証券 11,200株
6351	鶴見製作所	11,300	1,790.00	20,227,000	貸付有価証券 3,400株
6355	住友精密工業	2,200	3,165.00	6,963,000	
6356	日本ギア工業	4,300	398.00	1,711,400	貸付有価証券 100株(100株)
6358	酒井重工業	2,700	2,687.00	7,254,900	
6361	荏原製作所	59,900	3,140.00	188,086,000	
6362	石井鐵工所	1,900	2,779.00	5,280,100	
6363	西島製作所	14,600	880.00	12,848,000	
6364	北越工業	14,900	1,305.00	19,444,500	貸付有価証券 1,800株
6367	ダイキン工業	184,600	15,780.00	2,912,988,000	
6368	オルガノ	5,200	7,400.00	38,480,000	

6369	トーヨーカネツ	6,300	2,235.00	14,080,500	
6370	栗田工業	78,400	3,235.00	253,624,000	貸付有価証券 23,900株
6371	椿本チエイン	20,700	3,555.00	73,588,500	
6373	大同工業	6,900	795.00	5,485,500	貸付有価証券 100株
6378	木村化工機	12,000	627.00	7,524,000	貸付有価証券 8,400株(4,800株)
6381	アネスト岩田	22,500	1,000.00	22,500,000	貸付有価証券 9,100株(2,200株)
6383	ダイフク	74,000	7,100.00	525,400,000	貸付有価証券 29,900株(7,200株)
6387	サムコ	4,000	2,121.00	8,484,000	貸付有価証券 400株(400株)
6390	加藤製作所	7,900	1,578.00	12,466,200	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
6393	油研工業	2,400	1,714.00	4,113,600	貸付有価証券 100株(100株)
6395	タダノ	69,900	961.00	67,173,900	貸付有価証券 49,300株(28,000株)
6406	フジテック	52,700	1,817.00	95,755,900	貸付有価証券 16,100株
6407	C K D	40,300	1,864.00	75,119,200	貸付有価証券 14,600株(14,600株)
6409	キトー	10,900	1,700.00	18,530,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
6412	平和	40,400	2,278.00	92,031,200	
6413	理想科学工業	12,800	1,881.00	24,076,800	貸付有価証券 5,100株(1,200株)
6417	S A N K Y O	32,200	3,690.00	118,818,000	
6418	日本金銭機械	16,000	849.00	13,584,000	貸付有価証券 11,400株(6,500株)
6419	マースグループホールディングス	9,200	1,989.00	18,298,800	
6420	フクシマガリレイ	8,900	4,025.00	35,822,500	貸付有価証券 6,200株(3,500株)
6428	オーアズミ	6,100	610.00	3,721,000	
6430	ダイコク電機	6,600	1,603.00	10,579,800	
6432	竹内製作所	24,200	1,926.00	46,609,200	貸付有価証券 7,400株
6436	アマノ	37,900	3,265.00	123,743,500	
6440	J U K I	20,200	794.00	16,038,800	
6444	サンデンホールディングス	18,900	688.00	13,003,200	
6445	蛇の目ミシン工業	13,200	406.00	5,359,200	
6454	マックス	22,100	2,074.00	45,835,400	貸付有価証券 6,800株
6457	グローリー	37,200	3,235.00	120,342,000	
6458	新晃工業	13,500	1,735.00	23,422,500	
6459	大和冷機工業	20,900	1,157.00	24,181,300	
6460	セガサミーホールディングス	143,700	1,544.00	221,872,800	

6461	日本ピストンリング	5,300	1,497.00	7,934,100 500株 (500株)	貸付有価証券
6462	リケン	6,700	3,725.00	24,957,500 2,600株 (600株)	貸付有価証券
6463	T P R	19,500	1,881.00	36,679,500 6,000株	貸付有価証券
6464	ツバキ・ナカシマ	29,500	1,319.00	38,910,500	
6465	ホシザキ	42,300	10,050.00	425,115,000	
6470	大豊工業	11,800	766.00	9,038,800	
6471	日本精工	272,700	932.00	254,156,400 21,700株	貸付有価証券
6472	N T N	335,300	315.00	105,619,500 32,200株 (32,200株)	貸付有価証券
6473	ジェイテクト	139,000	1,201.00	166,939,000	
6474	不二越	13,500	4,200.00	56,700,000 6,200株 (5,400株)	貸付有価証券
6480	日本トムソン	43,000	462.00	19,866,000 12,300株	貸付有価証券
6481	T H K	84,300	2,946.00	248,347,800 25,800株	貸付有価証券
6482	ユーシン精機	11,200	970.00	10,864,000 3,500株	貸付有価証券
6485	前澤給装工業	5,300	2,313.00	12,258,900	
6486	イーグル工業	17,900	1,000.00	17,900,000	
6489	前澤工業	9,600	395.00	3,792,000 3,000株	貸付有価証券
6490	日本ピラー工業	14,600	1,510.00	22,046,000	
6498	キッツ	58,700	696.00	40,855,200 18,000株	貸付有価証券
6586	マキタ	188,900	3,985.00	752,766,500 75,800株 (18,200株)	貸付有価証券
7004	日立造船	114,800	409.00	46,953,200	
7011	三菱重工業	242,800	4,108.00	997,422,400 162,200株 (97,600 株)	貸付有価証券
7013	I H I	104,400	2,734.00	285,429,600 32,000株	貸付有価証券
7718	スター精密	22,300	1,460.00	32,558,000	
3105	日清紡ホールディングス	96,600	988.00	95,440,800	
4062	イビデン	88,700	2,620.00	232,394,000 27,100株	貸付有価証券
4902	コニカミノルタ	316,500	705.00	223,132,500 96,700株	貸付有価証券
6448	プラザー工業	176,900	2,248.00	397,671,200	
6479	ミネベアミツミ	268,900	2,285.00	614,436,500 26,000株 (26,000株)	貸付有価証券
6501	日立製作所	696,100	4,443.00	3,092,772,300	
6503	三菱電機	1,448,700	1,561.50	2,262,145,050	

6504	富士電機	87,300	3,360.00	293,328,000	貸付有価証券 26,800株
6505	東洋電機製造	5,700	1,501.00	8,555,700	貸付有価証券 4,000株 (2,300株)
6506	安川電機	155,900	3,895.00	607,230,500	貸付有価証券 29,900株 (15,100株)
6507	シンフォニアテクノロジー	18,800	1,258.00	23,650,400	
6508	明電舎	26,600	2,323.00	61,791,800	貸付有価証券 8,200株
6513	オリジン	3,900	1,607.00	6,267,300	貸付有価証券 1,600株 (1,600株)
6516	山洋電気	7,000	5,240.00	36,680,000	貸付有価証券 100株 (100株)
6517	デンヨー	12,300	2,182.00	26,838,600	貸付有価証券 700株
6588	東芝テック	18,100	4,485.00	81,178,500	
6590	芝浦メカトロニクス	2,600	4,180.00	10,868,000	
6592	マブチモーター	40,100	4,145.00	166,214,500	
6594	日本電産	174,300	14,675.00	2,557,852,500	貸付有価証券 16,800株 (16,800株)
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,700	440.00	3,828,000	貸付有価証券 800株 (800株)
6616	トレックス・セミコンダクター	8,300	1,548.00	12,848,400	
6617	東光高岳	8,100	1,174.00	9,509,400	貸付有価証券 2,100株
6619	ダブル・スコープ	22,900	833.00	19,075,700	貸付有価証券 7,900株 (7,900株)
6620	宮越ホールディングス	5,400	939.00	5,070,600	貸付有価証券 2,100株 (2,100株)
6622	ダイヘン	15,800	3,490.00	55,142,000	
6630	ヤーマン	21,000	692.00	14,532,000	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	118,000	258.00	30,444,000	
6638	ミマキエンジニアリング	13,000	508.00	6,604,000	
6640	第一精工	5,900	2,389.00	14,095,100	貸付有価証券 1,600株
6641	日新電機	34,000	1,338.00	45,492,000	貸付有価証券 24,000株 (13,600株)
6644	大崎電気工業	28,800	656.00	18,892,800	貸付有価証券 2,800株 (2,800株)
6645	オムロン	129,900	6,250.00	811,875,000	貸付有価証券 41,500株
6651	日東工業	21,300	2,398.00	51,077,400	
6652	IDEC	20,900	2,064.00	43,137,600	貸付有価証券 13,700株 (7,400株)
6653	正興電機製作所	3,400	897.00	3,049,800	貸付有価証券 300株 (300株)
6654	不二電機工業	1,800	1,282.00	2,307,600	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,400	2,290.00	110,836,000	

6675	サクサホールディングス	3,400	2,156.00	7,330,400	
6676	メルコホールディングス	5,000	2,777.00	13,885,000	
6678	テクノメディカ	3,300	2,056.00	6,784,800	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	2,300	996.00	2,290,800	貸付有価証券 700株
6701	日本電気	175,700	5,070.00	890,799,000	貸付有価証券 53,900株
6702	富士通	139,700	10,790.00	1,507,363,000	
6703	沖電気工業	58,800	1,397.00	82,143,600	
6704	岩崎通信機	6,300	822.00	5,178,600	
6706	電気興業	7,000	3,695.00	25,865,000	
6707	サンケン電気	15,800	2,989.00	47,226,200	貸付有価証券 6,300株 (6,300株)
6715	ナカヨ	2,800	1,670.00	4,676,000	
6718	アイホン	8,200	1,710.00	14,022,000	
6723	ルネサスエレクトロニクス	691,700	753.00	520,850,100	貸付有価証券 239,400株 (28,500 株)
6724	セイコーホームズ	179,700	1,628.00	292,551,600	貸付有価証券 72,300株 (72,300株)
6727	ワコム	97,400	414.00	40,323,600	貸付有価証券 39,300株 (39,300株)
6728	アルパック	28,900	4,325.00	124,992,500	
6730	アクセル	6,000	891.00	5,346,000	貸付有価証券 1,800株
6737	EIZO	11,200	3,630.00	40,656,000	
6740	ジャパンディスプレイ	418,700	71.00	29,727,700	貸付有価証券 284,700株 (157,900 株)
6741	日本信号	36,900	1,420.00	52,398,000	貸付有価証券 14,800株 (14,800株)
6742	京三製作所	33,900	588.00	19,933,200	貸付有価証券 13,600株 (13,600株)
6744	能美防災	19,200	2,481.00	47,635,200	
6745	ホーチキ	10,500	1,565.00	16,432,500	
6748	星和電機	7,100	549.00	3,897,900	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	15,700	4,565.00	71,670,500	貸付有価証券 900株
6752	パナソニック	1,655,200	1,110.50	1,838,099,600	
6753	シャープ	167,600	1,595.00	267,322,000	貸付有価証券 67,000株 (16,100株)
6754	アンリツ	93,300	2,171.00	202,554,300	貸付有価証券 9,000株 (9,000株)
6755	富士通ゼネラル	39,300	2,527.00	99,311,100	貸付有価証券 12,100株
6758	ソニー	915,900	7,865.00	7,203,553,500	貸付有価証券 129,600株

6762	T D K	69,900	12,430.00	868,857,000	貸付有価証券 21,500株
6763	帝国通信工業	6,400	1,239.00	7,929,600	貸付有価証券 300株 (300株)
6768	タムラ製作所	48,400	690.00	33,396,000	貸付有価証券 19,600株 (4,700株)
6770	アルプスアルパイン	128,200	2,343.00	300,372,600	
6771	池上通信機	4,600	1,227.00	5,644,200	貸付有価証券 1,800株 (1,800株)
6779	日本電波工業	13,100	529.00	6,929,900	
6785	鈴木	7,800	764.00	5,959,200	貸付有価証券 700株 (700株)
6788	日本トリム	1,900	4,685.00	8,901,500	
6789	ローランド ディー・ジー・	8,000	2,028.00	16,224,000	
6794	フォスター電機	15,200	1,805.00	27,436,000	
6798	S M K	3,700	3,005.00	11,118,500	貸付有価証券 700株 (700株)
6800	ヨコオ	9,400	3,160.00	29,704,000	貸付有価証券 2,900株
6803	ティック	10,400	208.00	2,163,200	
6804	ホシデン	39,600	1,323.00	52,390,800	貸付有価証券 12,100株
6806	ヒロセ電機	22,400	14,140.00	316,736,000	貸付有価証券 5,000株 (2,200株)
6807	日本航空電子工業	33,200	2,163.00	71,811,600	
6809	T O A	15,500	1,142.00	17,701,000	
6810	マクセルホールディングス	31,200	1,530.00	47,736,000	貸付有価証券 3,000株 (3,000株)
6814	古野電気	18,600	1,133.00	21,073,800	
6815	ユニデンホールディングス	4,000	2,105.00	8,420,000	貸付有価証券 1,200株 (1,200株)
6817	スマダコーポレーション	11,100	1,139.00	12,642,900	
6820	アイコム	8,000	2,548.00	20,384,000	
6823	リオン	6,100	3,725.00	22,722,500	
6826	本多通信工業	12,400	555.00	6,882,000	
6839	船井電機	14,600	660.00	9,636,000	
6841	横河電機	132,900	2,000.00	265,800,000	貸付有価証券 40,800株
6844	新電元工業	5,100	3,520.00	17,952,000	
6845	アズビル	91,400	3,030.00	276,942,000	
6848	東亜ディーケーベー	7,200	996.00	7,171,200	貸付有価証券 2,900株 (700株)
6849	日本光電工業	59,900	3,135.00	187,786,500	
6850	チノー	5,000	1,431.00	7,155,000	貸付有価証券 1,900株 (1,900株)
6853	共和電業	15,100	433.00	6,538,300	
6855	日本電子材料	5,700	1,026.00	5,848,200	貸付有価証券 1,700株

6856	堀場製作所	28,700	7,120.00	204,344,000	貸付有価証券 4,800株(2,800株)
6857	アドバンテスト	107,700	6,060.00	652,662,000	貸付有価証券 32,800株
6858	小野測器	6,000	557.00	3,342,000	
6859	エスペック	12,800	2,240.00	28,672,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6861	キーエンス	131,300	39,120.00	5,136,456,000	貸付有価証券 12,800株(12,800株)
6866	日置電機	7,600	3,955.00	30,058,000	貸付有価証券 2,700株(700株)
6869	シスメックス	103,500	7,975.00	825,412,500	
6871	日本マイクロニクス	25,200	1,384.00	34,876,800	
6875	メガチップス	13,500	1,792.00	24,192,000	
6877	O B A R A G R O U P	7,500	3,520.00	26,400,000	
6901	澤藤電機	1,700	2,220.00	3,774,000	貸付有価証券 200株(200株)
6904	原田工業	6,900	990.00	6,831,000	貸付有価証券 2,800株(700株)
6905	コーセル	17,700	1,228.00	21,735,600	貸付有価証券 12,500株(7,100株)
6908	イリソ電子工業	12,200	4,350.00	53,070,000	貸付有価証券 900株(900株)
6914	オプテックスグループ	23,800	1,621.00	38,579,800	貸付有価証券 16,800株(9,500株)
6915	千代田インテグレ	6,700	2,067.00	13,848,900	
6916	アイ・オー・データ機器	5,300	1,041.00	5,517,300	
6920	レーザーテック	59,400	5,930.00	352,242,000	貸付有価証券 18,000株
6923	スタンレー電気	101,900	2,968.00	302,439,200	
6924	岩崎電気	5,600	1,434.00	8,030,400	
6925	ウシオ電機	84,100	1,678.00	141,119,800	
6926	岡谷電機産業	11,300	376.00	4,248,800	貸付有価証券 4,600株(1,100株)
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	443.00	5,891,900	貸付有価証券 9,400株(5,300株)
6928	エノモト	4,300	1,248.00	5,366,400	
6929	日本セラミック	14,700	2,544.00	37,396,800	
6932	遠藤照明	7,300	714.00	5,212,200	
6937	古河電池	10,300	771.00	7,941,300	
6938	双信電機	7,000	450.00	3,150,000	貸付有価証券 5,000株(2,800株)
6941	山一電機	10,500	1,770.00	18,585,000	
6947	図研	9,400	2,640.00	24,816,000	貸付有価証券 2,900株
6951	日本電子	28,600	3,745.00	107,107,000	貸付有価証券 11,500株(11,500株)
6952	カシオ計算機	128,200	2,256.00	289,219,200	貸付有価証券 12,400株(12,400株)

6954	ファナック	137,700	20,000.00	2,754,000,000	
6958	日本シイエムケイ	34,000	551.00	18,734,000	
6961	エンプラス	7,400	3,135.00	23,199,000	
6962	大真空	5,300	2,057.00	10,902,100	貸付有価証券 2,100株(500株)
6963	ローム	64,300	8,800.00	565,840,000	
6965	浜松ホトニクス	103,900	4,735.00	491,966,500	
6966	三井ハイテック	16,000	1,707.00	27,312,000	
6967	新光電気工業	48,600	1,325.00	64,395,000	
6971	京セラ	203,800	7,612.00	1,551,325,600	貸付有価証券 62,500株
6976	太陽誘電	64,400	3,450.00	222,180,000	
6981	村田製作所	425,600	6,591.00	2,805,129,600	貸付有価証券 130,500株
6986	双葉電子工業	22,900	1,308.00	29,953,200	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6989	北陸電気工業	5,800	1,268.00	7,354,400	貸付有価証券 3,200株(1,700株)
6996	ニチコン	49,100	1,041.00	51,113,100	
6997	日本ケミコン	11,000	1,796.00	19,756,000	貸付有価証券 3,300株
6999	KOA	21,800	1,345.00	29,321,000	
7244	市光工業	21,700	726.00	15,754,200	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
7276	小糸製作所	86,800	4,815.00	417,942,000	貸付有価証券 25,700株
7280	ミツバ	26,700	677.00	18,075,900	貸付有価証券 18,900株(10,700株)
7735	SCREENホールディングス	25,100	7,700.00	193,270,000	貸付有価証券 17,600株(10,000株)
7739	キヤノン電子	15,200	2,151.00	32,695,200	
7751	キヤノン	779,900	3,028.00	2,361,537,200	貸付有価証券 313,500株(313,500株)
7752	リコー	368,600	1,269.00	467,753,400	貸付有価証券 177,400株(63,800株)
7965	象印マホービン	42,500	2,201.00	93,542,500	貸付有価証券 17,100株(4,100株)
7999	MUTOHホールディングス	2,000	1,729.00	3,458,000	
8035	東京エレクトロン	96,600	24,490.00	2,365,734,000	貸付有価証券 29,500株
3116	トヨタ紡織	42,200	1,642.00	69,292,400	貸付有価証券 13,000株
3526	芦森工業	3,000	1,406.00	4,218,000	貸付有価証券 2,100株(1,200株)
5949	ユニプレス	28,100	1,421.00	39,930,100	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
6201	豊田自動織機	117,200	6,280.00	736,016,000	貸付有価証券 47,100株(11,300株)

6455	モリタホールディングス	25,300	1,738.00	43,971,400	貸付有価証券 17,800株(10,200株)
6584	三櫻工業	18,400	1,061.00	19,522,400	貸付有価証券 13,000株(7,400株)
6902	デンソー	319,000	4,651.00	1,483,669,000	貸付有価証券 29,000株
6995	東海理化電機製作所	38,100	1,980.00	75,438,000	貸付有価証券 11,700株
7003	三井E&Sホールディングス	52,300	992.00	51,881,600	
7012	川崎重工業	112,700	2,255.00	254,138,500	貸付有価証券 45,300株(10,900株)
7014	名村造船所	46,600	249.00	11,603,400	貸付有価証券 18,700株(18,700株)
7022	サノヤスホールディングス	17,600	181.00	3,185,600	
7102	日本車輌製造	5,300	3,115.00	16,509,500	貸付有価証券 3,700株(2,100株)
7105	三菱ロジスネクスト	19,200	1,703.00	32,697,600	貸付有価証券 7,800株(1,900株)
7122	近畿車輛	2,200	1,670.00	3,674,000	貸付有価証券 1,600株(900株)
7201	日産自動車	1,708,600	597.70	1,021,230,220	
7202	いすゞ自動車	419,800	1,130.50	474,583,900	
7203	トヨタ自動車	1,616,500	7,752.00	12,531,108,000	
7205	日野自動車	180,900	1,072.00	193,924,800	
7211	三菱自動車工業	536,200	419.00	224,667,800	貸付有価証券 379,500株(215,600株)
7212	エフテック	10,100	773.00	7,807,300	
7213	レシップホールディングス	5,700	664.00	3,784,800	貸付有価証券 1,600株
7214	G M B	2,600	817.00	2,124,200	
7215	ファルテック	2,500	1,071.00	2,677,500	
7220	武蔵精密工業	32,300	1,337.00	43,185,100	貸付有価証券 12,500株(3,100株)
7222	日産車体	28,300	1,024.00	28,979,200	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
7224	新明和工業	39,000	1,468.00	57,252,000	
7226	極東開発工業	26,900	1,516.00	40,780,400	貸付有価証券 19,000株(10,800株)
7230	日信工業	24,900	2,232.00	55,576,800	貸付有価証券 8,400株
7231	トピー工業	11,900	1,812.00	21,562,800	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
7236	ティラド	5,300	1,881.00	9,969,300	
7238	曙ブレーキ工業	79,500	230.00	18,285,000	貸付有価証券 56,200株(31,900株)
7239	タチエス	23,800	1,328.00	31,606,400	貸付有価証券 7,300株
7240	NOK	77,900	1,520.00	118,408,000	貸付有価証券 7,500株(7,500株)

7241	フタバ産業	40,300	691.00	27,847,300	
7242	K Y B	16,200	2,998.00	48,567,600	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
7245	大同メタル工業	27,800	687.00	19,098,600	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
7246	プレス工業	71,800	378.00	27,140,400	
7247	ミクニ	18,400	341.00	6,274,400	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
7250	太平洋工業	30,300	1,412.00	42,783,600	貸付有価証券 9,200株
7251	ケーピン	28,100	2,579.00	72,469,900	貸付有価証券 10,200株
7256	河西工業	19,500	830.00	16,185,000	
7259	アイシン精機	119,300	3,715.00	443,199,500	
7261	マツダ	426,300	930.00	396,459,000	貸付有価証券 112,000株(41,300株)
7266	今仙電機製作所	13,400	908.00	12,167,200	貸付有価証券 4,100株
7267	本田技研工業	1,140,700	2,910.50	3,320,007,350	
7269	スズキ	287,100	4,800.00	1,378,080,000	貸付有価証券 115,000株(27,600株)
7270	S U B A R U	449,800	2,765.00	1,243,697,000	
7271	安永	7,000	1,199.00	8,393,000	貸付有価証券 2,800株(700株)
7272	ヤマハ発動機	188,900	2,090.00	394,801,000	
7274	ショーワ	28,900	2,281.00	65,920,900	
7277	T B K	17,200	461.00	7,929,200	貸付有価証券 5,200株
7278	エクセディ	19,700	2,240.00	44,128,000	
7282	豊田合成	46,800	2,571.00	120,322,800	貸付有価証券 14,300株
7283	愛三工業	22,700	725.00	16,457,500	
7284	盟和産業	2,200	1,122.00	2,468,400	貸付有価証券 100株(100株)
7291	日本プラス	11,300	678.00	7,661,400	
7294	ヨロズ	13,500	1,437.00	19,399,500	貸付有価証券 500株(500株)
7296	エフ・シー・シー	23,700	2,275.00	53,917,500	
7309	シマノ	54,200	16,920.00	917,064,000	貸付有価証券 20,300株(20,300株)
7313	ティ・エス テック	33,600	3,115.00	104,664,000	
7408	ジャムコ	7,200	1,381.00	9,943,200	貸付有価証券 700株(700株)
4543	テルモ	409,900	3,939.00	1,614,596,100	
5187	クリエートメディック	4,800	1,071.00	5,140,800	
6376	日機装	43,400	1,333.00	57,852,200	貸付有価証券 17,400株(17,400株)

7600	日本エム・ディ・エム	8,300	2,522.00	20,932,600 2,500株	貸付有価証券
7701	島津製作所	173,100	3,200.00	553,920,000	
7702	J M S	12,200	755.00	9,211,000	
7709	クボテック	3,700	403.00	1,491,100 1,100株	貸付有価証券
7715	長野計器	10,500	1,011.00	10,615,500	
7717	ブイ・テクノロジー	6,800	5,040.00	34,272,000 4,800株 (2,700株)	貸付有価証券
7721	東京計器	9,200	1,071.00	9,853,200	
7723	愛知時計電機	1,900	4,340.00	8,246,000	
7725	インターラクション	7,800	2,579.00	20,116,200	
7727	オーバル	13,000	247.00	3,211,000 4,000株	貸付有価証券
7729	東京精密	26,200	4,260.00	111,612,000 8,200株 (200株)	貸付有価証券
7730	マニー	57,700	2,950.00	170,215,000 17,300株 (5,600株)	貸付有価証券
7731	ニコン	234,400	1,362.00	319,252,800 94,600株 (22,700株)	貸付有価証券
7732	トプコン	73,000	1,616.00	117,968,000 29,500株 (7,100株)	貸付有価証券
7733	オリンパス	801,600	1,785.00	1,430,856,000 245,800株	貸付有価証券
7734	理研計器	12,800	2,161.00	27,660,800 3,900株	貸付有価証券
7740	タムロン	11,700	2,421.00	28,325,700	
7741	H O Y A	289,300	11,010.00	3,185,193,000	
7743	シード	6,100	1,014.00	6,185,400	
7744	ノーリツ鋼機	9,800	1,498.00	14,680,400	
7745	エー・アンド・ディ	13,200	980.00	12,936,000	
7747	朝日インテック	123,000	3,085.00	379,455,000 11,900株 (11,900株)	貸付有価証券
7762	シチズン時計	169,700	547.00	92,825,900 67,900株 (16,300株)	貸付有価証券
7769	リズム時計工業	4,500	908.00	4,086,000	
7775	大研医器	10,000	703.00	7,030,000	
7780	メニコン	19,900	5,100.00	101,490,000 8,000株 (1,900株)	貸付有価証券
7782	シンシア	1,500	701.00	1,051,500 100株 (100株)	貸付有価証券
7979	松風	6,500	1,907.00	12,395,500	
8050	セイコーホールディングス	20,500	2,853.00	58,486,500 8,300株 (8,300株)	貸付有価証券
8086	ニプロ	100,300	1,260.00	126,378,000	
7811	中本パックス	3,700	1,612.00	5,964,400	
7816	スノーピーク	6,900	1,030.00	7,107,000	

7817	パラマウントベッドホールディングス	15,300	4,575.00	69,997,500 4,700株	貸付有価証券
7818	トランザクション	9,200	1,121.00	10,313,200	
7819	粧美堂	4,200	393.00	1,650,600	
7820	ニホンフラッシュ	6,800	2,643.00	17,972,400 600株 (600株)	貸付有価証券
7821	前田工織	16,000	2,160.00	34,560,000 6,400株 (1,500株)	貸付有価証券
7822	永大産業	18,900	346.00	6,539,400	
7823	アートネイチャー	15,500	802.00	12,431,000	
7832	パンダイナムコホールディングス	149,800	6,409.00	960,068,200 45,800株	貸付有価証券
7833	アイフィスジャパン	3,700	717.00	2,652,900 1,400株 (400株)	貸付有価証券
7838	共立印刷	24,200	168.00	4,065,600	
7839	S H O E I	7,000	4,850.00	33,950,000 2,800株 (700株)	貸付有価証券
7840	フランスベッドホールディングス	20,500	951.00	19,495,500	
7846	パイロットコーポレーション	23,600	4,275.00	100,890,000	
7856	萩原工業	8,000	1,634.00	13,072,000	
7862	トップパン・フォームズ	31,000	1,256.00	38,936,000 9,500株	貸付有価証券
7864	フジシールインターナショナル	32,500	2,330.00	75,725,000	
7867	タカラトミー	65,000	1,227.00	79,755,000	
7868	廣済堂	10,100	920.00	9,292,000 3,100株	貸付有価証券
7872	エステールホールディングス	3,900	698.00	2,722,200 100株 (100株)	貸付有価証券
7873	アーク	55,300	94.00	5,198,200 16,900株	貸付有価証券
7885	タカノ	5,700	795.00	4,531,500	
7893	プロネクサス	12,400	1,226.00	15,202,400 5,000株 (1,200株)	貸付有価証券
7897	ホクシン	8,900	166.00	1,477,400 2,200株	貸付有価証券
7898	ウッドワン	4,900	1,181.00	5,786,900	
7905	大建工業	9,700	1,863.00	18,071,100	
7911	凸版印刷	204,500	2,243.00	458,693,500	
7912	大日本印刷	189,600	3,020.00	572,592,000	
7914	共同印刷	4,500	2,997.00	13,486,500	
7915	N I S S H A	29,700	1,036.00	30,769,200 12,000株 (12,000株)	貸付有価証券
7916	光村印刷	1,300	1,671.00	2,172,300	
7921	T A K A R A & C O M P A N Y	7,000	1,685.00	11,795,000	
7936	アシックス	119,600	1,653.00	197,698,800 48,000株 (48,000株)	貸付有価証券
7937	ツツミ	4,500	2,197.00	9,886,500	
7949	小松ウォール工業	4,400	2,178.00	9,583,200	

7951	ヤマハ	86,200	6,020.00	518,924,000	
7952	河合楽器製作所	4,500	3,670.00	16,515,000	
7955	クリナップ	13,500	684.00	9,234,000	貸付有価証券 4,100株
7956	ビジョン	87,500	3,715.00	325,062,500	貸付有価証券 35,200株 (8,400株)
7959	オリバー	3,100	3,165.00	9,811,500	
7961	兼松サステック	900	1,899.00	1,709,100	
7962	キングジム	12,000	855.00	10,260,000	
7966	リンテック	34,500	2,409.00	83,110,500	貸付有価証券 3,300株 (3,300株)
7972	イトーキ	30,800	480.00	14,784,000	
7974	任天堂	88,800	42,400.00	3,765,120,000	貸付有価証券 35,600株 (8,500株)
7976	三菱鉛筆	23,900	1,602.00	38,287,800	貸付有価証券 2,300株 (2,300株)
7981	タカラスタンダード	29,900	1,908.00	57,049,200	貸付有価証券 18,000株 (8,900株)
7984	コクヨ	69,500	1,630.00	113,285,000	貸付有価証券 3,800株 (3,800株)
7987	ナカバヤシ	14,200	621.00	8,818,200	貸付有価証券 3,700株 (3,700株)
7990	グローブライド	6,500	2,441.00	15,866,500	
7994	オカムラ	50,600	1,079.00	54,597,400	貸付有価証券 20,300株 (4,900株)
8022	美津濃	13,100	2,630.00	34,453,000	
9501	東京電力ホールディングス	1,156,500	429.00	496,138,500	貸付有価証券 353,400株
9502	中部電力	443,200	1,459.00	646,628,800	貸付有価証券 42,800株 (42,800株)
9503	関西電力	548,900	1,214.50	666,639,050	貸付有価証券 77,800株 (53,200株)
9504	中国電力	200,300	1,404.00	281,221,200	
9505	北陸電力	132,400	813.00	107,641,200	貸付有価証券 94,000株 (53,400株)
9506	東北電力	361,900	1,000.00	361,900,000	貸付有価証券 110,300株
9507	四国電力	130,400	944.00	123,097,600	貸付有価証券 52,500株 (12,600株)
9508	九州電力	298,600	881.00	263,066,600	貸付有価証券 120,000株 (28,800株)
9509	北海道電力	135,600	498.00	67,528,800	貸付有価証券 41,400株
9511	沖縄電力	26,800	2,014.00	53,975,200	貸付有価証券 10,800株 (2,600株)
9513	電源開発	115,300	2,504.00	288,711,200	
9514	エフオン	6,800	752.00	5,113,600	
9517	イーレックス	20,600	1,658.00	34,154,800	

9519	レノバ	23,900	1,199.00	28,656,100	
9531	東京瓦斯	278,600	2,460.00	685,356,000	貸付有価証券 112,000株 (112,000株)
9532	大阪瓦斯	281,100	1,917.00	538,868,700	貸付有価証券 57,400株
9533	東邦瓦斯	71,300	4,265.00	304,094,500	貸付有価証券 28,800株 (6,900株)
9534	北海道瓦斯	7,800	1,616.00	12,604,800	
9535	広島ガス	29,800	350.00	10,430,000	貸付有価証券 1,000株
9536	西部瓦斯	16,300	2,365.00	38,549,500	貸付有価証券 6,600株 (1,600株)
9543	静岡ガス	41,100	893.00	36,702,300	貸付有価証券 4,000株 (4,000株)
9551	メタウォーター	7,000	4,300.00	30,100,000	
2384	SBSホールディングス	12,500	1,879.00	23,487,500	
9001	東武鉄道	152,800	3,875.00	592,100,000	
9003	相鉄ホールディングス	46,400	2,950.00	136,880,000	貸付有価証券 7,500株 (4,500株)
9005	東急	365,400	1,939.00	708,510,600	
9006	京浜急行電鉄	186,000	2,013.00	374,418,000	貸付有価証券 75,000株 (18,000株)
9007	小田急電鉄	215,500	2,402.00	517,631,000	貸付有価証券 20,900株 (20,900株)
9008	京王電鉄	75,200	6,290.00	473,008,000	貸付有価証券 7,300株 (7,300株)
9009	京成電鉄	100,800	4,070.00	410,256,000	
9010	富士急行	19,700	3,930.00	77,421,000	貸付有価証券 13,900株 (7,900株)
9014	新京成電鉄	3,700	2,480.00	9,176,000	
9020	東日本旅客鉄道	255,000	9,910.00	2,527,050,000	
9021	西日本旅客鉄道	129,100	9,316.00	1,202,695,600	貸付有価証券 39,400株
9022	東海旅客鉄道	120,500	21,895.00	2,638,347,500	貸付有価証券 36,900株
9024	西武ホールディングス	194,400	1,694.00	329,313,600	
9025	鴻池運輸	23,100	1,570.00	36,267,000	貸付有価証券 7,400株 (2,200株)
9031	西日本鉄道	40,200	2,519.00	101,263,800	貸付有価証券 26,600株 (16,100株)
9037	ハマキヨウレックス	11,100	3,380.00	37,518,000	
9039	サカイ引越センター	7,600	6,600.00	50,160,000	貸付有価証券 3,000株 (700株)
9041	近鉄グループホールディングス	137,200	5,850.00	802,620,000	貸付有価証券 97,000株 (55,100株)
9042	阪急阪神ホールディングス	183,000	4,500.00	823,500,000	
9044	南海電気鉄道	65,000	2,892.00	187,980,000	

9045	京阪ホールディングス	61,100	5,090.00	310,999,000 5,900株 (5,900株)	貸付有価証券
9046	神戸電鉄	3,300	3,970.00	13,101,000	
9048	名古屋鉄道	112,800	3,270.00	368,856,000 36,900株 (10,900株)	貸付有価証券
9052	山陽電気鉄道	9,800	2,106.00	20,638,800 3,000株	貸付有価証券
9062	日本通運	48,500	6,380.00	309,430,000	
9064	ヤマトホールディングス	240,500	1,753.00	421,596,500	
9065	山九	38,100	5,480.00	208,788,000	
9067	丸運	7,800	353.00	2,753,400 2,400株	貸付有価証券
9068	丸全昭和運輸	11,100	2,955.00	32,800,500	
9069	センコーグループホールディングス	75,600	904.00	68,342,400 7,300株 (7,300株)	貸付有価証券
9070	トナミホールディングス	3,300	5,000.00	16,500,000 1,000株	貸付有価証券
9072	ニッコンホールディングス	49,100	2,595.00	127,414,500 18,100株 (3,100株)	貸付有価証券
9074	日本石油輸送	1,500	2,898.00	4,347,000	
9075	福山通運	17,600	3,730.00	65,648,000 1,700株 (1,700株)	貸付有価証券
9076	セイノーホールディングス	102,800	1,446.00	148,648,800	
9078	エスライン	4,100	1,011.00	4,145,100 600株	貸付有価証券
9081	神奈川中央交通	3,400	4,005.00	13,617,000	
9086	日立物流	25,100	3,145.00	78,939,500	
9090	丸和運輸機関	14,500	2,338.00	33,901,000 5,800株 (1,400株)	貸付有価証券
9099	C & F ロジホールディングス	13,900	1,351.00	18,778,900 5,500株 (1,300株)	貸付有価証券
9142	九州旅客鉄道	122,300	3,595.00	439,668,500	
9143	S G ホールディングス	144,000	2,371.00	341,424,000 3,900株	貸付有価証券
9101	日本郵船	114,700	1,804.00	206,918,800 46,100株 (46,100株)	貸付有価証券
9104	商船三井	86,800	2,740.00	237,832,000 8,400株 (8,400株)	貸付有価証券
9107	川崎汽船	42,300	1,536.00	64,972,800 15,600株 (15,600株)	貸付有価証券
9110	N S ユナイテッド海運	7,500	2,056.00	15,420,000 5,300株 (3,000株)	貸付有価証券
9115	明治海運	14,600	358.00	5,226,800 2,400株	貸付有価証券
9119	飯野海運	64,900	347.00	22,520,300 26,000株 (26,000株)	貸付有価証券
9130	共栄タンカー	2,400	980.00	2,352,000	
9308	乾汽船	7,900	1,150.00	9,085,000 5,800株 (3,300株)	貸付有価証券

9201	日本航空	247,000	3,134.00	774,098,000	
9202	A N A ホールディングス	250,800	3,441.00	863,002,800	貸付有価証券 177,400株(100,800株)
9232	パスコ	2,700	2,121.00	5,726,700	貸付有価証券 800株
9058	トランコム	3,800	8,050.00	30,590,000	
9066	日新	11,900	1,750.00	20,825,000	
9301	三菱倉庫	43,500	2,780.00	120,930,000	貸付有価証券 30,800株(17,500株)
9302	三井倉庫ホールディングス	15,700	1,901.00	29,845,700	
9303	住友倉庫	50,500	1,462.00	73,831,000	貸付有価証券 20,400株(4,900株)
9304	濱澤倉庫	7,500	2,218.00	16,635,000	貸付有価証券 400株
9306	東陽倉庫	24,800	321.00	7,960,800	貸付有価証券 6,500株
9310	日本トランシティ	30,200	489.00	14,767,800	貸付有価証券 11,200株(2,900株)
9312	ケイヒン	2,600	1,302.00	3,385,200	
9319	中央倉庫	8,400	1,120.00	9,408,000	貸付有価証券 1,500株
9322	川西倉庫	2,500	1,042.00	2,605,000	
9324	安田倉庫	11,300	1,044.00	11,797,200	
9325	ファイズホールディングス	2,900	515.00	1,493,500	貸付有価証券 300株(300株)
9351	東洋埠頭	4,200	1,414.00	5,938,800	貸付有価証券 1,000株
9358	宇徳	11,700	589.00	6,891,300	貸付有価証券 4,500株(900株)
9364	上組	78,600	2,361.00	185,574,600	
9366	サンリツ	3,200	742.00	2,374,400	
9368	キムラユニティー	3,700	1,126.00	4,166,200	
9369	キューソー流通システム	3,400	1,925.00	6,545,000	
9375	近鉄エクスプレス	29,100	1,907.00	55,493,700	貸付有価証券 8,900株
9380	東海運	7,800	286.00	2,230,800	
9381	エーアイティー	9,700	1,001.00	9,709,700	貸付有価証券 3,000株
9384	内外トランスライン	4,800	1,268.00	6,086,400	
9386	日本コンセプト	4,400	1,535.00	6,754,000	
1973	N E C ネットエスアイ	13,400	4,295.00	57,553,000	貸付有価証券 4,100株
2307	クロスキャット	3,700	1,257.00	4,650,900	貸付有価証券 1,500株(400株)
2317	システナ	50,700	1,917.00	97,191,900	
2326	デジタルアーツ	7,000	5,470.00	38,290,000	貸付有価証券 2,900株(700株)
2327	日鉄ソリューションズ	21,300	3,345.00	71,248,500	

2335	キューブシステム	7,600	803.00	6,102,800 3,000株(700株)	貸付有価証券
2352	エイジア	2,600	1,335.00	3,471,000 300株(300株)	貸付有価証券
2359	コア	6,000	1,491.00	8,946,000	
3040	ソリトンシステムズ	6,200	1,225.00	7,595,000	
3371	ソフトクリエイトホールディングス	6,200	1,736.00	10,763,200	
3626	T I S	47,400	6,640.00	314,736,000	
3627	ネオス	5,700	772.00	4,400,400	
3630	電算システム	5,400	2,964.00	16,005,600 1,700株	貸付有価証券
3632	グリー	98,100	463.00	45,420,300 29,900株	貸付有価証券
3635	コーワーテクモホールディングス	29,100	2,780.00	80,898,000 20,600株(11,700株)	貸付有価証券
3636	三菱総合研究所	6,100	4,565.00	27,846,500	
3639	ボルテージ	2,600	529.00	1,375,400 800株	貸付有価証券
3640	電算	1,600	2,272.00	3,635,200 500株	貸付有価証券
3648	A G S	8,000	815.00	6,520,000 800株	貸付有価証券
3649	ファインデックス	12,000	1,197.00	14,364,000	
3655	ブレインパッド	2,900	6,350.00	18,415,000 800株	貸付有価証券
3656	K L a b	27,500	813.00	22,357,500 11,000株(2,600株)	貸付有価証券
3657	ポールトゥワイン・ピットクルー・ホールディ	17,100	926.00	15,834,600	
3658	イーブックイニシアティブジャパン	2,000	2,032.00	4,064,000	
3659	ネクソン	404,700	1,486.00	601,384,200 123,300株	貸付有価証券
3660	アイスタイル	36,700	487.00	17,872,900 3,500株(3,500株)	貸付有価証券
3661	エムアップ	4,100	2,800.00	11,480,000 2,100株(800株)	貸付有価証券
3662	エイチーム	9,800	1,011.00	9,907,800 3,900株(900株)	貸付有価証券
3665	エニグモ	10,100	871.00	8,797,100 4,000株(1,000株)	貸付有価証券
3666	テクノスジャパン	11,000	492.00	5,412,000 1,100株(1,100株)	貸付有価証券
3667	e n i s h	6,300	580.00	3,654,000 4,400株(2,500株)	貸付有価証券
3668	コロプラ	46,500	1,133.00	52,684,500 18,700株(4,500株)	貸付有価証券
3672	オルトプラス	10,500	891.00	9,355,500 6,600株(3,700株)	貸付有価証券
3673	プロードリーフ	70,500	630.00	44,415,000	

3675	クロス・マーケティンググループ	6,300	350.00	2,205,000	貸付有価証券 2,500株(600株)
3676	デジタルハーツホールディングス	7,500	965.00	7,237,500	貸付有価証券 700株(700株)
3677	システム情報	7,200	1,029.00	7,408,800	
3678	メディアドゥホールディングス	4,500	3,290.00	14,805,000	
3679	じげん	35,200	498.00	17,529,600	貸付有価証券 10,500株
3681	ブイキューブ	8,700	631.00	5,489,700	
3682	エンカレッジ・テクノロジ	2,300	885.00	2,035,500	
3683	サイバーリンクス	2,200	1,205.00	2,651,000	
3686	ディー・エル・イー	10,100	184.00	1,858,400	貸付有価証券 4,000株(1,000株)
3687	フィックスターズ	15,100	1,617.00	24,416,700	貸付有価証券 6,100株(1,500株)
3688	CARTA HOLDINGS	6,900	1,046.00	7,217,400	
3694	オプティム	3,700	3,965.00	14,670,500	貸付有価証券 1,100株
3696	セレス	4,600	1,221.00	5,616,600	貸付有価証券 900株(500株)
3697	S H I F T	3,700	8,010.00	29,637,000	
3738	ティーガイア	12,600	2,720.00	34,272,000	
3741	セック	2,100	3,865.00	8,116,500	
3751	日本アジアグループ	15,000	380.00	5,700,000	
3756	豆蔵ホールディングス	9,700	1,491.00	14,462,700	貸付有価証券 3,000株
3762	テクマトリックス	10,000	2,616.00	26,160,000	
3763	プロシップ	4,100	1,499.00	6,145,900	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	34,300	2,114.00	72,510,200	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	23,400	7,310.00	171,054,000	貸付有価証券 16,500株(9,400株)
3770	ザッパラス	7,400	404.00	2,989,600	貸付有価証券 5,100株(2,900株)
3771	システムリサーチ	3,800	1,826.00	6,938,800	貸付有価証券 400株(400株)
3774	インターネットイニシアティブ	21,000	3,080.00	64,680,000	貸付有価証券 8,500株(2,000株)
3778	さくらインターネット	15,200	702.00	10,670,400	
3784	ヴィンクス	4,000	1,108.00	4,432,000	貸付有価証券 1,200株
3788	GMOクラウド	2,600	2,450.00	6,370,000	貸付有価証券 1,800株(1,000株)
3817	SRAホールディングス	7,500	2,552.00	19,140,000	
3826	システムインテグレータ	4,500	922.00	4,149,000	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	10,100	704.00	7,110,400	

3835	e B A S E	8,500	1,526.00	12,971,000	2,600株 貸付有価証券
3836	アバント	10,100	1,171.00	11,827,100	
3837	アドソル日進	5,000	2,396.00	11,980,000	500株 (500株) 貸付有価証券
3843	フリービット	8,400	901.00	7,568,400	3,400株 (800株) 貸付有価証券
3844	コムチュア	16,000	2,480.00	39,680,000	
3852	サイバーコム	2,500	2,172.00	5,430,000	1,000株 (200株) 貸付有価証券
3853	アステリア	8,700	560.00	4,872,000	2,600株 貸付有価証券
3854	アイル	5,100	1,944.00	9,914,400	
3901	マークライズ	7,100	1,953.00	13,866,300	
3902	メディカル・データ・ビジョン	10,800	828.00	8,942,400	3,300株 貸付有価証券
3903	g u m i	18,200	818.00	14,887,600	7,300株 (7,300株) 貸付有価証券
3909	ショーケース	3,400	695.00	2,363,000	300株 (300株) 貸付有価証券
3912	モバイルファクトリー	3,200	1,361.00	4,355,200	300株 (300株) 貸付有価証券
3915	テラスカイ	5,100	3,200.00	16,320,000	
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジ	6,300	1,748.00	11,012,400	1,900株 貸付有価証券
3918	P C I ホールディングス	2,900	2,176.00	6,310,400	300株 (300株) 貸付有価証券
3919	パイプドHD	1,800	1,840.00	3,312,000	
3920	アイビーシー	2,600	1,542.00	4,009,200	300株 (300株) 貸付有価証券
3921	ネオジャパン	2,700	1,214.00	3,277,800	300株 (300株) 貸付有価証券
3922	P R T I M E S	1,200	2,466.00	2,959,200	100株 (100株) 貸付有価証券
3924	ランドコンピュータ	2,200	1,158.00	2,547,600	
3925	ダブルスタンダード	1,800	4,350.00	7,830,000	200株 (200株) 貸付有価証券
3926	オープンドア	7,000	1,348.00	9,436,000	2,200株 貸付有価証券
3928	マイネット	4,600	705.00	3,243,000	1,800株 (400株) 貸付有価証券
3932	アカツキ	5,000	5,270.00	26,350,000	2,000株 (500株) 貸付有価証券
3934	ペネフィットジャパン	1,100	1,878.00	2,065,800	100株 (100株) 貸付有価証券
3937	U b i c o m ホールディングス	3,100	1,332.00	4,129,200	300株 (300株) 貸付有価証券
3938	L I N E	31,800	5,360.00	170,448,000	
3939	カナミックネットワーク	8,700	808.00	7,029,600	

3940	ノムラシステムコーポレーション	3,100	515.00	1,596,500	貸付有価証券 1,300株(300株)
3962	チェンジ	2,800	3,200.00	8,960,000	貸付有価証券 1,200株(300株)
3963	シンクロ・フード	6,000	552.00	3,312,000	貸付有価証券 1,800株
3964	オークネット	8,700	1,168.00	10,161,600	貸付有価証券 2,800株(900株)
3968	セグエグループ	2,300	841.00	1,934,300	貸付有価証券 800株(200株)
3969	エイトレッド	1,800	1,459.00	2,626,200	
3975	A O I T Y O H o l d i n g s	14,400	704.00	10,137,600	
3978	マクロミル	25,400	1,065.00	27,051,000	
3981	ビーグリー	2,800	1,188.00	3,326,400	
3983	オロ	3,700	3,670.00	13,579,000	
3984	ユーチーローカル	800	3,150.00	2,520,000	
3985	テモナ	1,900	524.00	995,600	貸付有価証券 800株(200株)
3992	ニーズウェル	1,700	782.00	1,329,400	
3996	サインポスト	2,200	1,957.00	4,305,400	貸付有価証券 900株(200株)
4284	ソルクシーズ	6,000	1,008.00	6,048,000	
4295	フェイス	5,000	775.00	3,875,000	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	12,700	1,382.00	17,551,400	
4299	ハイマックス	1,700	1,974.00	3,355,800	
4307	野村総合研究所	237,600	2,380.00	565,488,000	貸付有価証券 28,900株(28,900株)
4312	サイバネットシステム	10,100	920.00	9,292,000	
4320	C E ホールディングス	8,200	499.00	4,091,800	
4323	日本システム技術	2,300	1,399.00	3,217,700	
4326	インテージホールディングス	17,700	875.00	15,487,500	
4333	東邦システムサイエンス	3,700	909.00	3,363,300	
4344	ソースネクスト	67,400	528.00	35,587,200	貸付有価証券 26,800株(6,400株)
4348	インフォコム	15,500	2,938.00	45,539,000	
4382	H E R O Z	300	12,100.00	3,630,000	
4384	ラクスル	7,500	3,600.00	27,000,000	貸付有価証券 2,300株
4392	F I G	15,400	300.00	4,620,000	貸付有価証券 6,200株(1,500株)
4396	システムサポート	1,200	2,419.00	2,902,800	
4420	イーソル	5,100	2,601.00	13,265,100	
4423	アルテリア・ネットワークス	15,700	1,958.00	30,740,600	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホール ディン	3,200	1,690.00	5,408,000	貸付有価証券 2,300株(1,300株)
4662	フォーカスシステムズ	8,800	998.00	8,782,400	

4674	クレスコ	4,300	3,920.00	16,856,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	136,900	1,538.00	210,552,200	
4684	オービック	49,300	15,500.00	764,150,000	19,800株(4,800株)
4686	ジャストシステム	23,100	6,240.00	144,144,000	
4687	TDCソフト	12,400	1,079.00	13,379,600	8,800株(5,000株)
4689	Zホールディングス	1,952,200	443.00	864,824,600	581,600株
4704	トレンドマイクロ	63,200	5,780.00	365,296,000	
4709	IDホールディングス	5,400	1,557.00	8,407,800	2,100株(500株)
4716	日本オラクル	28,800	9,690.00	279,072,000	
4719	アルファシステムズ	4,400	2,892.00	12,724,800	1,800株(400株)
4722	フューチャー	17,200	1,983.00	34,107,600	10,200株(6,900株)
4725	CAC Holdings	9,200	1,489.00	13,698,800	
4726	SBテクノロジー	5,100	2,190.00	11,169,000	
4728	トーセ	3,800	900.00	3,420,000	2,600株(1,500株)
4733	オービックビジネスコンサルタント	14,500	4,920.00	71,340,000	10,200株(5,800株)
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	64,800	3,310.00	214,488,000	6,300株(6,300株)
4743	アイティフォー	17,200	881.00	15,153,200	
4746	東計電算	2,100	3,555.00	7,465,500	
4762	エックスネット	2,200	1,030.00	2,266,000	
4768	大塚商会	76,900	4,545.00	349,510,500	
4776	サイボウズ	16,600	1,890.00	31,374,000	3,700株(3,700株)
4779	ソフトブレーン	8,400	646.00	5,426,400	800株(800株)
4812	電通国際情報サービス	8,800	4,720.00	41,536,000	2,700株
4819	デジタルガレージ	25,600	4,215.00	107,904,000	3,400株(2,500株)
4820	EMシステムズ	19,900	951.00	18,924,900	
4825	ウェザーニューズ	4,800	3,855.00	18,504,000	
4826	CIJ	10,600	904.00	9,582,400	
4828	ビジネスエンジニアリング	1,600	3,275.00	5,240,000	500株
4829	日本エンタープライズ	14,400	234.00	3,369,600	4,400株
4839	WOWOW	6,800	2,645.00	17,986,000	
4845	スカラ	10,100	762.00	7,696,200	
4847	インテリジェント ウェイブ	5,300	805.00	4,266,500	2,100株(500株)

6879	I M A G I C A G R O U P	12,100	543.00	6,570,300	貸付有価証券 3,500株
7518	ネットワンシステムズ	54,200	1,672.00	90,622,400	
7527	システムソフト	33,600	105.00	3,528,000	
7595	アルゴグラフィックス	12,100	3,400.00	41,140,000	
7844	マーベラス	21,700	701.00	15,211,700	
7860	エイベックス	24,400	1,221.00	29,792,400	
8056	日本ユニシス	44,400	3,355.00	148,962,000	
8096	兼松エレクトロニクス	7,700	3,555.00	27,373,500	貸付有価証券 2,400株
9401	東京放送ホールディングス	86,400	1,868.00	161,395,200	貸付有価証券 34,900株 (34,900株)
9404	日本テレビホールディングス	118,700	1,474.00	174,963,800	
9405	朝日放送グループホールディングス	14,100	745.00	10,504,500	
9409	テレビ朝日ホールディングス	39,100	2,096.00	81,953,600	貸付有価証券 15,700株 (3,800株)
9412	スカパーJSATホールディングス	93,500	476.00	44,506,000	
9413	テレビ東京ホールディングス	11,700	2,358.00	27,588,600	貸付有価証券 8,100株 (4,600株)
9414	日本BS放送	4,800	1,197.00	5,745,600	貸付有価証券 100株 (100株)
9416	ビジョン	13,200	1,527.00	20,156,400	貸付有価証券 1,300株 (1,300株)
9417	スマートバリュー	4,200	801.00	3,364,200	貸付有価証券 1,700株 (400株)
9418	USEN-NEXT HOLDING S	5,400	1,765.00	9,531,000	貸付有価証券 1,600株
9419	ワイヤレスゲート	6,700	736.00	4,931,200	貸付有価証券 2,000株
9422	コネクシオ	8,000	1,786.00	14,288,000	貸付有価証券 2,500株
9424	日本通信	109,800	235.00	25,803,000	貸付有価証券 33,800株
9428	クロップス	2,600	756.00	1,965,600	
9432	日本電信電話	1,900,300	2,796.50	5,314,188,950	
9433	KDDI	1,059,400	3,266.00	3,460,000,400	
9434	ソフトバンク	1,291,900	1,478.50	1,910,074,150	貸付有価証券 125,700株 (125,700株)
9435	光通信	14,700	27,140.00	398,958,000	
9437	NTTドコモ	1,050,100	3,116.00	3,272,111,600	貸付有価証券 419,300株 (100,600株)
9438	エムティーアイ	13,700	699.00	9,576,300	貸付有価証券 4,200株
9449	GMOインターネット	56,000	2,172.00	121,632,000	
9450	ファイバーゲート	2,700	1,317.00	3,555,900	貸付有価証券 100株

9466	アイドママーケティングコミュニケーション	4,300	645.00	2,773,500	
9468	KADOKAWA	38,300	1,941.00	74,340,300	
9470	学研ホールディングス	4,800	7,420.00	35,616,000	貸付有価証券 1,500株
9474	ゼンリン	28,400	1,657.00	47,058,800	貸付有価証券 8,600株
9475	昭文社	6,500	380.00	2,470,000	貸付有価証券 2,000株
9479	インプレスホールディングス	11,800	171.00	2,017,800	
9600	アイネット	7,300	1,553.00	11,336,900	貸付有価証券 2,800株 (600株)
9601	松竹	9,400	14,980.00	140,812,000	貸付有価証券 3,800株 (3,800株)
9602	東宝	85,000	4,145.00	352,325,000	貸付有価証券 60,400株 (34,300株)
9605	東映	5,300	15,230.00	80,719,000	貸付有価証券 2,100株 (2,100株)
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	378,500	1,547.00	585,539,500	貸付有価証券 115,700株
9629	ピー・シー・エー	1,800	5,240.00	9,432,000	貸付有価証券 600株
9658	ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,506.00	6,014,400	貸付有価証券 200株 (200株)
9682	DTS	31,800	2,588.00	82,298,400	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,600	5,520.00	334,512,000	貸付有価証券 23,300株 (4,700株)
9692	シーイーシー	15,200	2,127.00	32,330,400	
9697	カブコン	67,000	3,010.00	201,670,000	
9702	アイ・エス・ビー	2,800	1,961.00	5,490,800	
9717	ジャステック	9,000	1,103.00	9,927,000	貸付有価証券 2,400株
9719	SCK	32,800	5,970.00	195,816,000	
9739	日本システムウエア	4,700	2,651.00	12,459,700	
9742	アイネス	14,000	1,468.00	20,552,000	
9746	TKC	12,000	5,370.00	64,440,000	
9749	富士ソフト	18,200	4,350.00	79,170,000	
9759	NSD	46,700	1,791.00	83,639,700	貸付有価証券 14,200株
9766	コナミホールディングス	51,600	4,505.00	232,458,000	貸付有価証券 15,800株
9790	福井コンピュータホールディングス	5,600	3,415.00	19,124,000	
9889	JBCCホールディングス	9,600	2,095.00	20,112,000	
9928	ミロク情報サービス	12,500	3,200.00	40,000,000	貸付有価証券 3,800株
9984	ソフトバンクグループ	1,128,000	4,575.00	5,160,600,000	
1352	ホウスイ	1,100	882.00	970,200	貸付有価証券 100株

2676	高千穂交易	5,500	1,177.00	6,473,500	貸付有価証券 1,800株(500株)
2692	伊藤忠食品	3,500	5,110.00	17,885,000	貸付有価証券 1,100株
2715	エレマテック	13,300	1,175.00	15,627,500	貸付有価証券 4,100株
2729	JALUX	4,000	2,364.00	9,456,000	貸付有価証券 1,300株
2733	あらた	11,400	4,570.00	52,098,000	貸付有価証券 4,600株(1,100株)
2737	トーメンデバイス	2,100	3,650.00	7,665,000	貸付有価証券 1,300株(700株)
2760	東京エレクトロン デバイス	5,200	2,840.00	14,768,000	貸付有価証券 500株(500株)
2767	フィールズ	10,900	589.00	6,420,100	
2768	双日	788,100	350.00	275,835,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	158,600	2,230.00	353,678,000	
2874	横浜冷凍	40,000	959.00	38,360,000	貸付有価証券 28,200株(16,000株)
3004	神栄	2,000	830.00	1,660,000	貸付有価証券 700株(700株)
3023	ラサ商事	7,500	1,008.00	7,560,000	
3031	ラクーンホールディングス	6,900	787.00	5,430,300	
3036	アルコニックス	15,200	1,381.00	20,991,200	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
3038	神戸物産	49,200	4,295.00	211,314,000	
3076	あい ホールディングス	20,400	1,905.00	38,862,000	貸付有価証券 1,100株
3079	ディープイエックス	5,100	890.00	4,539,000	貸付有価証券 100株
3107	ダイワボウホールディングス	12,100	6,690.00	80,949,000	
3132	マクニカ・富士エレホールディングス	34,000	1,750.00	59,500,000	
3139	ラクト・ジャパン	5,300	3,895.00	20,643,500	貸付有価証券 2,100株(500株)
3151	パーソナルケータイ・ホールディングス	26,800	1,037.00	27,791,600	
3153	八洲電機	11,000	912.00	10,032,000	
3154	メディアスホールディングス	8,100	838.00	6,787,800	貸付有価証券 2,500株
3156	レスターホールディングス	14,900	1,892.00	28,190,800	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
3157	ジュー・テックホールディングス	3,300	1,262.00	4,164,600	
3160	大光	6,000	664.00	3,984,000	
3166	OCHIホールディングス	4,100	1,470.00	6,027,000	貸付有価証券 900株
3167	TOKAIホールディングス	75,400	1,065.00	80,301,000	貸付有価証券 23,000株
3168	黒谷	3,200	485.00	1,552,000	貸付有価証券 1,000株

3173	Cominix	2,500	820.00	2,050,000	100株(100株)
3176	三洋貿易	7,200	2,738.00	19,713,600	
3180	ビューティガレージ	2,300	2,371.00	5,453,300	
3183	ワイン・パートナーズ	10,300	1,227.00	12,638,100	3,200株
3321	ミタチ産業	4,300	734.00	3,156,200	1,700株(1,700株)
3360	シップヘルスケアホールディングス	22,900	5,030.00	115,187,000	
3388	明治電機工業	4,500	1,557.00	7,006,500	400株(400株)
3392	デリカフーズホールディングス	5,000	695.00	3,475,000	
3393	スターティアホールディングス	3,200	768.00	2,457,600	600株
3543	コメダホールディングス	31,100	2,201.00	68,451,100	
3559	ピーバンドットコム	800	1,264.00	1,011,200	
3565	アセンテック	1,100	2,410.00	2,651,000	
5009	富士興産	4,300	660.00	2,838,000	1,400株
6973	協栄産業	1,600	1,449.00	2,318,400	300株(300株)
7414	小野建	12,800	1,348.00	17,254,400	1,200株(1,200株)
7417	南陽	3,100	1,816.00	5,629,600	1,000株
7420	佐鳥電機	10,500	867.00	9,103,500	4,200株(1,000株)
7427	エコートレーディング	3,300	571.00	1,884,300	100株(100株)
7433	伯東	8,700	1,295.00	11,266,500	2,700株
7438	コンドーテック	11,000	1,123.00	12,353,000	
7442	中山福	8,200	547.00	4,485,400	
7447	ナガイレーベン	20,600	2,367.00	48,760,200	14,600株(8,300株)
7451	三菱食品	15,700	3,135.00	49,219,500	11,100株(6,300株)
7456	松田産業	10,400	1,578.00	16,411,200	2,000株
7458	第一興商	21,200	5,470.00	115,964,000	6,500株
7459	メディパルホールディングス	154,000	2,376.00	365,904,000	
7466	SPK	3,100	2,763.00	8,565,300	
7467	萩原電気ホールディングス	5,300	2,658.00	14,087,400	500株(500株)
7476	アズワン	9,300	10,160.00	94,488,000	900株(900株)
7480	スズデン	4,900	1,438.00	7,046,200	
7481	尾家産業	4,200	1,370.00	5,754,000	

7482	シモジマ	8,700	1,161.00	10,100,700	
7483	ドウシシャ	13,400	1,670.00	22,378,000	
7487	小津産業	3,100	1,900.00	5,890,000	
7504	高速	8,500	1,245.00	10,582,500	1,400株 貸付有価証券
7510	たけびし	5,000	1,473.00	7,365,000	1,500株 貸付有価証券
7525	リックス	3,200	1,713.00	5,481,600	300株(300株) 貸付有価証券
7537	丸文	12,600	606.00	7,635,600	
7552	ハピネット	11,900	1,340.00	15,946,000	
7570	橋本総業ホールディングス	2,900	1,808.00	5,243,200	500株 貸付有価証券
7575	日本ライフライン	42,300	1,355.00	57,316,500	12,900株 貸付有価証券
7590	タカショ一	6,900	474.00	3,270,600	
7591	エクセル	4,000	1,596.00	6,384,000	
7594	マルカ	5,000	2,083.00	10,415,000	2,100株(500株) 貸付有価証券
7599	I D O M	38,500	607.00	23,369,500	15,600株(15,600株) 貸付有価証券
7607	進和	8,400	2,236.00	18,782,400	2,600株 貸付有価証券
7608	エスケイジャパン	3,100	465.00	1,441,500	1,300株(300株) 貸付有価証券
7609	ダイトロン	6,000	1,838.00	11,028,000	300株(300株) 貸付有価証券
7613	シークス	18,100	1,362.00	24,652,200	5,500株 貸付有価証券
7619	田中商事	4,400	720.00	3,168,000	
7628	オーハシテクニカ	8,000	1,545.00	12,360,000	800株(800株) 貸付有価証券
7637	白銅	5,100	1,435.00	7,318,500	2,000株(2,000株) 貸付有価証券
8001	伊藤忠商事	998,000	2,610.00	2,604,780,000	
8002	丸紅	1,485,200	801.90	1,190,981,880	
8007	高島	2,300	1,962.00	4,512,600	
8012	長瀬産業	80,200	1,564.00	125,432,800	6,400株 貸付有価証券
8014	蝶理	9,100	2,101.00	19,119,100	2,800株 貸付有価証券
8015	豊田通商	159,200	3,845.00	612,124,000	48,700株 貸付有価証券
8018	三共生興	21,600	586.00	12,657,600	200株 貸付有価証券
8020	兼松	53,200	1,427.00	75,916,400	
8025	ツカモトコーポレーション	2,600	1,118.00	2,906,800	800株 貸付有価証券
8031	三井物産	1,254,100	1,957.00	2,454,273,700	

8032	日本紙パルプ商事	8,100	3,985.00	32,278,500 3,200株(800株)	貸付有価証券
8036	日立ハイテクノロジーズ	49,600	7,840.00	388,864,000 15,100株	貸付有価証券
8037	カメイ	18,600	1,157.00	21,520,200 8,900株(3,200株)	貸付有価証券
8038	東都水産	1,800	2,754.00	4,957,200	
8041	OUGホールディングス	2,300	2,635.00	6,060,500 100株(100株)	貸付有価証券
8043	スターゼン	5,300	4,415.00	23,399,500 2,100株(2,100株)	貸付有価証券
8051	山善	55,700	1,046.00	58,262,200 17,000株	貸付有価証券
8052	椿本興業	2,600	4,080.00	10,608,000	
8053	住友商事	900,300	1,646.00	1,481,893,800 250,700株	貸付有価証券
8057	内田洋行	6,100	7,180.00	43,798,000 1,900株	貸付有価証券
8058	三菱商事	1,001,300	2,847.50	2,851,201,750 79,800株(79,800株)	貸付有価証券
8059	第一実業	7,000	3,640.00	25,480,000 1,300株	貸付有価証券
8060	キヤノンマーケティングジャパン	40,800	2,566.00	104,692,800 4,500株(3,900株)	貸付有価証券
8061	西華産業	8,100	1,294.00	10,481,400 800株(800株)	貸付有価証券
8065	佐藤商事	11,800	971.00	11,457,800 4,700株(1,100株)	貸付有価証券
8068	菱洋エレクトロ	14,500	2,047.00	29,681,500 5,800株(5,800株)	貸付有価証券
8070	東京産業	12,900	643.00	8,294,700 1,300株(1,300株)	貸付有価証券
8074	ユアサ商事	13,500	3,540.00	47,790,000 9,700株(5,500株)	貸付有価証券
8075	神鋼商事	3,600	2,674.00	9,626,400	
8077	小林産業	8,500	282.00	2,397,000 3,000株(400株)	貸付有価証券
8078	阪和興業	26,700	2,700.00	72,090,000 2,600株(2,600株)	貸付有価証券
8079	正栄食品工業	9,200	3,775.00	34,730,000 3,800株(900株)	貸付有価証券
8081	カナデン	11,600	1,331.00	15,439,600 3,400株(1,100株)	貸付有価証券
8084	菱電商事	10,300	1,599.00	16,469,700 400株	貸付有価証券
8087	フルサト工業	7,900	1,709.00	13,501,100	
8088	岩谷産業	31,700	3,675.00	116,497,500 12,700株(3,000株)	貸付有価証券
8089	すてきナイスクループ	6,100	1,276.00	7,783,600	
8090	昭光通商	4,600	713.00	3,279,800 3,200株(1,800株)	貸付有価証券

8091	ニチモウ	2,200	1,977.00	4,349,400	
8093	極東貿易	4,100	2,166.00	8,880,600	貸付有価証券 300株
8095	イワキ	18,700	535.00	10,004,500	
8097	三愛石油	35,100	1,101.00	38,645,100	貸付有価証券 5,400株 (3,400株)
8098	稻畑産業	31,400	1,547.00	48,575,800	貸付有価証券 9,700株
8101	G S I クレオス	3,500	1,321.00	4,623,500	
8103	明和産業	13,200	609.00	8,038,800	貸付有価証券 5,100株 (1,300株)
8104	クワザワ	5,100	660.00	3,366,000	貸付有価証券 2,100株 (500株)
8125	ワキタ	30,400	1,041.00	31,646,400	貸付有価証券 9,300株
8129	東邦ホールディングス	45,800	2,314.00	105,981,200	貸付有価証券 4,400株 (4,400株)
8130	サンゲツ	39,200	1,977.00	77,498,400	
8131	ミツウロコグループホールディングス	21,000	1,117.00	23,457,000	貸付有価証券 8,400株 (2,000株)
8132	シナネンホールディングス	5,900	1,973.00	11,640,700	貸付有価証券 1,800株
8133	伊藤忠エヌクス	31,500	915.00	28,822,500	貸付有価証券 3,000株 (3,000株)
8136	サンリオ	40,100	2,152.00	86,295,200	貸付有価証券 3,900株 (3,900株)
8137	サンワテクノス	10,100	1,040.00	10,504,000	
8140	リョーサン	15,700	2,627.00	41,243,900	貸付有価証券 1,300株 (1,300株)
8141	新光商事	22,400	867.00	19,420,800	
8142	トーホー	6,400	1,841.00	11,782,400	
8150	三信電気	7,600	1,747.00	13,277,200	貸付有価証券 400株 (400株)
8151	東陽テクニカ	16,400	1,283.00	21,041,200	
8153	モスフードサービス	18,700	2,960.00	55,352,000	
8154	加賀電子	14,200	2,392.00	33,966,400	貸付有価証券 5,800株 (1,400株)
8158	ソーダニッカ	14,700	616.00	9,055,200	貸付有価証券 3,400株
8159	立花エレテック	10,500	1,804.00	18,942,000	貸付有価証券 1,100株
8275	フォーバル	6,200	1,091.00	6,764,200	
8283	P A L T A C	22,900	5,060.00	115,874,000	貸付有価証券 14,100株 (7,100株)
8285	三谷産業	18,800	342.00	6,429,600	貸付有価証券 4,800株
8835	太平洋興発	5,600	780.00	4,368,000	貸付有価証券 2,200株 (2,200株)
9260	西本Wismettacホールディングス	2,600	3,650.00	9,490,000	貸付有価証券 100株 (100株)

9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	2,284.00	2,512,400	300株 貸付有価証券
9274	国際紙パルプ商事	33,800	288.00	9,734,400	13,600株(3,300株) 貸付有価証券
9305	ヤマタネ	7,100	1,550.00	11,005,000	
9763	丸紅建材リース	1,400	1,874.00	2,623,600	
9810	日鉄物産	10,200	5,020.00	51,204,000	
9824	泉州電業	4,400	3,165.00	13,926,000	1,300株 貸付有価証券
9830	トラスコ中山	29,700	2,595.00	77,071,500	9,000株 貸付有価証券
9832	オートバックスセブン	52,900	1,612.00	85,274,800	
9837	モリト	10,400	783.00	8,143,200	3,200株 貸付有価証券
9869	加藤産業	22,300	3,380.00	75,374,000	8,900株(2,100株) 貸付有価証券
9872	北恵	2,700	887.00	2,394,900	800株 貸付有価証券
9880	イノテック	8,500	1,207.00	10,259,500	
9882	イエローハット	26,900	1,785.00	48,016,500	8,200株 貸付有価証券
9896	JKホールディングス	12,900	725.00	9,352,500	4,200株(4,200株) 貸付有価証券
9902	日伝	12,900	2,029.00	26,174,100	4,000株 貸付有価証券
9930	北沢産業	10,700	275.00	2,942,500	7,600株(4,300株) 貸付有価証券
9932	杉本商事	7,700	1,985.00	15,284,500	700株(700株) 貸付有価証券
9934	因幡電機産業	40,600	2,764.00	112,218,400	
9960	東テク	4,700	2,728.00	12,821,600	100株(100株) 貸付有価証券
9962	ミスミグループ本社	178,700	2,918.00	521,446,600	122,200株(71,900株) 貸付有価証券
9972	アルテック	11,300	251.00	2,836,300	
9982	タキヒヨー	4,300	1,888.00	8,118,400	
9986	蔵王産業	2,700	1,468.00	3,963,600	
9987	スズケン	60,400	4,275.00	258,210,000	
9991	ジェコス	9,800	1,084.00	10,623,200	3,000株 貸付有価証券
9995	グローセル	14,300	462.00	6,606,600	1,200株(100株) 貸付有価証券
2651	ローソン	36,100	6,470.00	233,567,000	
2659	サンエー	11,900	4,550.00	54,145,000	8,300株(4,700株) 貸付有価証券
2664	カワチ薬品	11,100	2,203.00	24,453,300	
2670	エービーシー・マート	22,300	6,950.00	154,985,000	
2674	ハードオフコーポレーション	5,600	827.00	4,631,200	

2678	アスクル	14,900	3,545.00	52,820,500	
2681	ゲオホールディングス	25,700	1,255.00	32,253,500	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
2685	アダストリア	19,800	2,193.00	43,421,400	
2686	ジーフット	8,600	620.00	5,332,000	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	691.00	1,382,000	貸付有価証券 500株
2695	くら寿司	7,400	5,670.00	41,958,000	貸付有価証券 2,300株
2698	キャンドゥ	6,800	1,607.00	10,927,600	貸付有価証券 2,100株
2726	パルグループホールディングス	7,300	3,330.00	24,309,000	
2730	エディオン	65,500	1,147.00	75,128,500	貸付有価証券 46,200株(26,200株)
2734	サーラコーポレーション	29,000	620.00	17,980,000	貸付有価証券 8,900株
2735	ワツツ	6,300	627.00	3,950,100	
2742	ハローズ	5,400	2,719.00	14,682,600	貸付有価証券 600株
2752	フジオフードシステム	12,000	1,779.00	21,348,000	貸付有価証券 5,000株(1,200株)
2753	あみやき亭	3,100	3,640.00	11,284,000	
2764	ひらまつ	26,200	270.00	7,074,000	貸付有価証券 8,100株
2791	大黒天物産	3,400	3,605.00	12,257,000	貸付有価証券 1,100株
2792	ハニーズホールディングス	12,500	1,381.00	17,262,500	
2796	ファーマライズホールディングス	3,300	669.00	2,207,700	貸付有価証券 1,000株
3028	アルペン	10,900	1,634.00	17,810,600	貸付有価証券 3,300株
3030	ハブ	4,100	1,022.00	4,190,200	貸付有価証券 1,700株(400株)
3034	クオールホールディングス	21,000	1,411.00	29,631,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
3046	ジンズホールディングス	7,600	7,630.00	57,988,000	
3048	ピックカメラ	84,600	1,206.00	102,027,600	貸付有価証券 25,900株
3050	D C Mホールディングス	77,000	1,031.00	79,387,000	貸付有価証券 7,400株(7,400株)
3053	ペッパー フードサービス	11,400	975.00	11,115,000	貸付有価証券 3,500株
3064	M o n o t a R O	101,500	2,650.00	268,975,000	貸付有価証券 71,800株(40,800株)
3067	東京一番フーズ	3,600	625.00	2,250,000	
3073	D Dホールディングス	5,600	1,713.00	9,592,800	
3082	きちりホールディングス	3,800	764.00	2,903,200	
3085	アークランドサービスホールディングス	10,400	2,014.00	20,945,600	

3086	J.フロント リテイリング	170,400	1,364.00	232,425,600	
3087	ドトール・日レスホールディングス	22,800	2,084.00	47,515,200	
3088	マツモトキヨシホールディングス	59,000	4,275.00	252,225,000	23,700株 (5,700株)
3091	プロンコビリー	7,500	2,627.00	19,702,500	700株 (700株)
3092	Z O Z O	98,100	1,798.00	176,383,800	13,600株 (13,600株)
3093	トレジャーファクトリー	4,200	891.00	3,742,200	
3097	物語コーポレーション	3,500	9,120.00	31,920,000	1,400株 (300株)
3098	ココカラファイン	14,900	6,510.00	96,999,000	2,300株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	249,300	912.00	227,361,600	24,100株 (24,100株)
3134	Hamee	4,300	1,521.00	6,540,300	
3141	ウエルシアホールディングス	42,400	6,340.00	268,816,000	17,000株 (4,100株)
3148	クリエイトSDホールディングス	21,000	2,837.00	59,577,000	6,400株
3159	丸善CHIホールディングス	16,700	364.00	6,078,800	
3169	ミサワ	2,900	699.00	2,027,100	
3172	ティーライフ	1,900	893.00	1,696,700	
3175	エー・ピーカンパニー	2,700	625.00	1,687,500	
3178	チムニー	4,300	2,310.00	9,933,000	
3179	シュッピン	9,700	1,148.00	11,135,600	
3186	ネクステージ	20,400	1,100.00	22,440,000	8,200株 (2,000株)
3191	ジョイフル本田	41,800	1,253.00	52,375,400	
3193	鳥貴族	4,700	2,560.00	12,032,000	
3194	キリン堂ホールディングス	5,600	1,810.00	10,136,000	1,700株
3196	ホットランド	9,500	1,282.00	12,179,000	900株 (900株)
3197	すかいらーくホールディングス	159,900	2,035.00	325,396,500	15,400株 (15,400株)
3198	SFPホールディングス	6,100	2,414.00	14,725,400	1,900株
3199	綿半ホールディングス	5,300	1,789.00	9,481,700	3,700株 (2,100株)
3221	ヨシックス	2,300	2,956.00	6,798,800	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	41,500	966.00	40,089,000	29,300株 (16,600株)
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	6,600	649.00	4,283,400	
3328	B E N O S	5,348	1,200.00	6,417,600	1,500株
3333	あさひ	10,600	1,320.00	13,992,000	
3341	日本調剤	4,300	3,785.00	16,275,500	

3349	コスモス薬品	6,300	23,890.00	150,507,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
3361	トーエル	6,900	789.00	5,444,100	貸付有価証券 2,100株
3376	オンリー	2,400	799.00	1,917,600	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	558,200	4,206.00	2,347,789,200	
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	38,300	2,352.00	90,081,600	
3391	ツルハホールディングス	31,000	13,350.00	413,850,000	貸付有価証券 5,100株(3,000株)
3395	サンマルクホールディングス	11,300	2,321.00	26,227,300	
3396	フェリシモ	3,200	1,000.00	3,200,000	
3397	トリドールホールディングス	17,600	2,633.00	46,340,800	
3415	TOKYO BASE	12,800	505.00	6,464,000	
3538	ワイルプラスホールディングス	2,200	863.00	1,898,600	
3539	ジャパンミート	7,200	2,205.00	15,876,000	
3544	サツドラホールディングス	2,100	1,856.00	3,897,600	
3546	アレンザホールディングス	7,100	978.00	6,943,800	貸付有価証券 2,800株(700株)
3547	串カツ田中ホールディングス	2,200	2,367.00	5,207,400	貸付有価証券 900株(200株)
3548	パロックジャパンリミテッド	9,900	1,068.00	10,573,200	
3549	クスリのアオキホールディングス	14,200	6,390.00	90,738,000	貸付有価証券 10,100株(5,700株)
3561	力の源ホールディングス	6,400	1,050.00	6,720,000	貸付有価証券 1,900株
3563	スシローグローバルホールディングス	15,700	9,810.00	154,017,000	
3564	LIXILビバ	14,100	2,040.00	28,764,000	
4350	メディカルシステムネットワーク	13,800	516.00	7,120,800	
7416	はるやまホールディングス	6,700	868.00	5,815,600	貸付有価証券 400株
7419	ノジマ	25,400	2,214.00	56,235,600	貸付有価証券 10,100株(2,400株)
7421	カッパ・クリエイト	20,000	1,497.00	29,940,000	
7445	ライトオン	10,700	590.00	6,313,000	
7448	ジーンズメイト	4,300	305.00	1,311,500	貸付有価証券 3,000株(1,700株)
7453	良品計画	189,400	1,893.00	358,534,200	貸付有価証券 18,300株(18,300株)
7455	三城ホールディングス	15,100	306.00	4,620,600	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァン	21,800	1,298.00	28,296,400	貸付有価証券 8,800株(2,100株)
7475	アルビス	5,400	2,227.00	12,025,800	
7494	コナカ	16,800	407.00	6,837,600	
7506	ハウス オブ ローゼ	1,700	1,685.00	2,864,500	貸付有価証券 500株
7508	G-7ホールディングス	8,400	2,694.00	22,629,600	

7512	イオン北海道	14,300	791.00	11,311,300	貸付有価証券 4,400株
7513	コジマ	24,500	532.00	13,034,000	貸付有価証券 7,500株
7514	ヒマラヤ	5,000	840.00	4,200,000	
7516	コーナン商事	20,300	2,387.00	48,456,100	貸付有価証券 1,900株 (1,900株)
7520	エコス	5,200	1,698.00	8,829,600	
7522	ワタミ	16,900	1,290.00	21,801,000	貸付有価証券 1,600株 (1,600株)
7524	マルシェ	3,700	781.00	2,889,700	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	342,000	1,735.00	593,370,000	
7545	西松屋チェーン	31,300	940.00	29,422,000	貸付有価証券 9,600株
7550	ゼンショーホールディングス	68,400	2,423.00	165,733,200	貸付有価証券 48,400株 (27,500株)
7554	幸楽苑ホールディングス	9,100	1,926.00	17,526,600	貸付有価証券 3,600株 (3,600株)
7561	ハーカスレイ	3,000	1,299.00	3,897,000	
7581	サイゼリヤ	23,500	2,454.00	57,669,000	貸付有価証券 7,200株
7593	V T ホールディングス	59,100	450.00	26,595,000	
7596	魚力	3,900	1,581.00	6,165,900	
7601	ポプラ	3,700	506.00	1,872,200	
7605	フジ・コーポレーション	3,800	2,180.00	8,284,000	
7606	ユナイテッドアローズ	14,900	2,925.00	43,582,500	
7611	ハイディ日高	20,600	2,004.00	41,282,400	貸付有価証券 11,400株 (8,300株)
7615	京都きもの友禅	9,100	341.00	3,103,100	
7616	コロワイド	47,400	2,315.00	109,731,000	貸付有価証券 19,100株 (19,100株)
7618	ビーシーデポコーポレーション	18,900	585.00	11,056,500	
7630	壱番屋	10,100	5,930.00	59,893,000	
7640	トップカルチャー	5,100	333.00	1,698,300	
7646	P L A N T	3,600	573.00	2,062,800	
7649	スキホールディングス	28,500	5,520.00	157,320,000	
7679	薬王堂ホールディングス	6,200	2,169.00	13,447,800	貸付有価証券 2,500株 (600株)
7918	ヴィア・ホールディングス	17,500	660.00	11,550,000	貸付有価証券 5,300株
8005	スクロール	21,900	358.00	7,840,200	貸付有価証券 6,000株
8008	ヨンドシーホールディングス	14,500	2,439.00	35,365,500	貸付有価証券 10,200株 (5,800株)
8028	ファミリーマート	114,000	2,438.00	277,932,000	貸付有価証券 11,200株 (11,200株)
8160	木曽路	18,600	3,015.00	56,079,000	

8163	SRSホールディングス	16,800	1,052.00	17,673,600	
8165	千趣会	25,800	448.00	11,558,400	
8166	タカキュー	11,000	186.00	2,046,000	
8168	ケーヨー	29,300	545.00	15,968,500	
8173	上新電機	16,800	2,390.00	40,152,000	貸付有価証券 6,700株(1,600株)
8174	日本瓦斯	22,500	3,410.00	76,725,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
8179	ロイヤルホールディングス	24,900	2,395.00	59,635,500	貸付有価証券 17,600株(10,000株)
8181	東天紅	1,000	1,272.00	1,272,000	
8182	いなげや	17,700	1,439.00	25,470,300	貸付有価証券 7,100株(1,700株)
8184	島忠	26,800	3,065.00	82,142,000	
8185	チヨダ	15,000	1,461.00	21,915,000	
8194	ライフコーポレーション	10,800	2,423.00	26,168,400	
8200	リンガーハット	17,600	2,491.00	43,841,600	貸付有価証券 7,100株(1,700株)
8203	M r M a x H D	19,600	471.00	9,231,600	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
8207	テンアライド	13,200	439.00	5,794,800	
8214	AOKIホールディングス	28,500	1,071.00	30,523,500	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
8217	オーケワ	22,400	1,488.00	33,331,200	貸付有価証券 8,900株(2,100株)
8218	コメリ	22,000	2,134.00	46,948,000	
8219	青山商事	29,500	1,410.00	41,595,000	
8227	しまむら	16,600	7,980.00	132,468,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
8230	はせがわ	7,500	400.00	3,000,000	
8233	高島屋	103,900	1,211.00	125,822,900	貸付有価証券 10,100株(10,100株)
8237	松屋	28,800	744.00	21,427,200	貸付有価証券 11,500株(11,500株)
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	67,600	1,105.00	74,698,000	貸付有価証券 20,700株
8244	近鉄百貨店	5,500	3,580.00	19,690,000	
8251	パルコ	13,400	1,848.00	24,763,200	貸付有価証券 4,200株
8252	丸井グループ	130,800	2,579.00	337,333,200	貸付有価証券 79,300株(52,400株)
8255	アクシアル リテイリング	11,800	3,650.00	43,070,000	貸付有価証券 3,600株
8260	井筒屋	7,700	240.00	1,848,000	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	549,100	2,252.00	1,236,573,200	貸付有価証券 53,000株(53,000株)
8273	イズミ	29,000	3,505.00	101,645,000	

8276	平和堂	29,000	1,952.00	56,608,000	貸付有価証券 8,900株
8278	フジ	17,200	1,821.00	31,321,200	貸付有価証券 6,900株 (1,700株)
8279	ヤオコー	16,200	5,620.00	91,044,000	貸付有価証券 1,600株 (1,600株)
8281	ゼビオホールディングス	17,200	1,180.00	20,296,000	
8282	ケーズホールディングス	137,700	1,337.00	184,104,900	貸付有価証券 42,200株
8289	Olympicグループ	7,400	611.00	4,521,400	貸付有価証券 5,100株 (2,900株)
8291	日産東京販売ホールディングス	21,000	278.00	5,838,000	
9262	シルバーライフ	1,100	2,669.00	2,935,900	
9267	Gentry Drug Stores	7,000	2,006.00	14,042,000	貸付有価証券 4,800株 (2,700株)
9275	ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,268.00	3,043,200	
9277	総合メディカルホールディングス	12,400	2,033.00	25,209,200	貸付有価証券 1,200株 (1,200株)
9278	ブックオフグループホールディングス	8,300	1,014.00	8,416,200	貸付有価証券 5,800株 (3,300株)
9627	AINホールディングス	19,100	6,290.00	120,139,000	貸付有価証券 1,800株 (1,800株)
9828	元気寿司	3,600	3,000.00	10,800,000	貸付有価証券 1,400株 (1,400株)
9831	ヤマダ電機	434,700	552.00	239,954,400	貸付有価証券 64,200株
9842	アークランドサカモト	22,300	1,193.00	26,603,900	
9843	二トリホールディングス	61,800	17,015.00	1,051,527,000	貸付有価証券 24,900株 (6,000株)
9850	グルメ杵屋	10,200	1,209.00	12,331,800	
9854	愛眼	11,400	246.00	2,804,400	貸付有価証券 3,500株
9856	ケーユーホールディングス	7,400	898.00	6,645,200	貸付有価証券 700株 (700株)
9861	吉野家ホールディングス	46,900	2,599.00	121,893,100	
9887	松屋フーズホールディングス	6,900	4,750.00	32,775,000	貸付有価証券 700株 (700株)
9900	サガミホールディングス	19,100	1,351.00	25,804,100	
9919	関西スーパーマーケット	11,900	1,015.00	12,078,500	貸付有価証券 3,600株
9936	王将フードサービス	10,500	6,530.00	68,565,000	
9945	プレナス	16,000	1,989.00	31,824,000	貸付有価証券 1,500株 (1,500株)
9946	ミニストップ	10,600	1,572.00	16,663,200	貸付有価証券 1,000株 (1,000株)
9948	アークス	29,200	1,969.00	57,494,800	貸付有価証券 2,800株 (2,800株)
9956	パローホールディングス	31,600	1,930.00	60,988,000	貸付有価証券 3,000株 (3,000株)
9966	藤久	1,100	727.00	799,700	

9974	ペルク	7,000	5,950.00	41,650,000 2,900株(700株)	貸付有価証券
9979	大庄	7,600	1,646.00	12,509,600	
9983	ファーストリテイリング	19,100	58,460.00	1,116,586,000 13,400株(7,600株)	貸付有価証券
9989	サンドラッグ	53,700	3,735.00	200,569,500	
9990	サックスバー ホールディングス	12,100	866.00	10,478,600	
9993	ヤマザワ	3,300	1,691.00	5,580,300	
9994	やまや	2,900	2,210.00	6,409,000	
9997	ペルーナ	30,600	652.00	19,951,200 12,300株(12,300株)	貸付有価証券
7150	島根銀行	2,800	639.00	1,789,200	
7161	じもとホールディングス	96,500	107.00	10,325,500	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	742,500	244.00	181,170,000	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,300	1,299.00	25,070,700 7,800株(1,900株)	貸付有価証券
7180	九州フィナンシャルグループ	234,500	456.00	106,932,000 71,700株	貸付有価証券
7182	ゆうちょ銀行	404,800	1,011.00	409,252,800 162,700株(162,700株)	貸付有価証券
7184	富山第一銀行	34,100	312.00	10,639,200	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	840,400	420.00	352,968,000 338,900株(338,900株)	貸付有価証券
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	97,400	735.00	71,589,000 29,600株	貸付有価証券
7321	関西みらいフィナンシャルグループ	83,900	641.00	53,779,900 58,800株(33,400株)	貸付有価証券
7322	三十三フィナンシャルグループ	13,200	1,606.00	21,199,200 3,400株	貸付有価証券
7327	第四北越フィナンシャルグループ	24,800	2,665.00	66,092,000 2,400株(2,400株)	貸付有価証券
8303	新生銀行	104,900	1,645.00	172,560,500 48,100株(42,100株)	貸付有価証券
8304	あおぞら銀行	85,100	2,864.00	243,726,400 6,700株(6,700株)	貸付有価証券
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,836,100	566.50	5,572,150,650	
8308	りそなホールディングス	1,568,000	459.70	720,809,600 325,100株	貸付有価証券
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	270,100	4,088.00	1,104,168,800	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	988,200	3,871.00	3,825,322,200	
8331	千葉銀行	491,500	606.00	297,849,000 347,800株(197,600株)	貸付有価証券
8334	群馬銀行	280,800	350.00	98,280,000	
8336	武蔵野銀行	21,300	1,717.00	36,572,100	
8337	千葉興業銀行	39,200	353.00	13,837,600	

8338	筑波銀行	59,400	213.00	12,652,200	貸付有価証券 10,600株 (10,600株)
8341	七十七銀行	48,300	1,645.00	79,453,500	貸付有価証券 19,400株 (4,700株)
8342	青森銀行	11,100	2,693.00	29,892,300	貸付有価証券 4,200株 (1,100株)
8343	秋田銀行	9,200	2,025.00	18,630,000	貸付有価証券 2,200株
8344	山形銀行	16,100	1,403.00	22,588,300	貸付有価証券 4,900株
8345	岩手銀行	9,400	2,592.00	24,364,800	貸付有価証券 3,200株 (900株)
8346	東邦銀行	127,800	251.00	32,077,800	貸付有価証券 36,900株
8349	東北銀行	6,800	1,013.00	6,888,400	
8350	みちのく銀行	9,200	1,418.00	13,045,600	貸付有価証券 2,800株
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	120,400	1,936.00	233,094,400	
8355	静岡銀行	353,800	766.00	271,010,800	貸付有価証券 142,300株 (142,300株)
8356	十六銀行	17,900	2,268.00	40,597,200	貸付有価証券 7,200株 (1,700株)
8358	スルガ銀行	146,200	427.00	62,427,400	貸付有価証券 44,700株
8359	八十二銀行	344,800	416.00	143,436,800	貸付有価証券 138,700株 (33,300株)
8360	山梨中央銀行	16,600	1,016.00	16,865,600	貸付有価証券 2,800株
8361	大垣共立銀行	28,200	2,249.00	63,421,800	貸付有価証券 11,400株 (2,700株)
8362	福井銀行	12,200	1,649.00	20,117,800	貸付有価証券 3,900株 (100株)
8363	北國銀行	14,700	3,165.00	46,525,500	貸付有価証券 10,400株 (5,900株)
8364	清水銀行	5,900	2,062.00	12,165,800	貸付有価証券 400株 (400株)
8365	富山銀行	2,800	2,206.00	6,176,800	貸付有価証券 600株
8366	滋賀銀行	28,700	2,594.00	74,447,800	貸付有価証券 11,500株 (2,800株)
8367	南都銀行	23,800	2,653.00	63,141,400	貸付有価証券 7,200株
8368	百五銀行	128,600	329.00	42,309,400	貸付有価証券 34,400株
8369	京都銀行	51,200	4,515.00	231,168,000	貸付有価証券 20,600株 (4,900株)
8370	紀陽銀行	50,600	1,568.00	79,340,800	貸付有価証券 35,700株 (20,300株)
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	95,100	1,056.00	100,425,600	貸付有価証券 38,200株 (9,200株)

8379	広島銀行	210,900	489.00	103,130,100 80,300株 (20,300株)	貸付有価証券
8381	山陰合同銀行	84,700	609.00	51,582,300 25,900株	貸付有価証券
8382	中国銀行	123,000	1,020.00	125,460,000 49,500株 (11,900株)	貸付有価証券
8383	鳥取銀行	4,900	1,336.00	6,546,400	
8385	伊予銀行	203,900	562.00	114,591,800 81,700株 (19,600株)	貸付有価証券
8386	百十四銀行	15,200	1,964.00	29,852,800 4,600株	貸付有価証券
8387	四国銀行	21,700	947.00	20,549,900 6,600株	貸付有価証券
8388	阿波銀行	23,300	2,282.00	53,170,600 9,300株 (2,200株)	貸付有価証券
8392	大分銀行	8,200	2,557.00	20,967,400 3,300株 (800株)	貸付有価証券
8393	宮崎銀行	9,500	2,423.00	23,018,500 2,900株	貸付有価証券
8395	佐賀銀行	8,700	1,562.00	13,589,400 2,400株	貸付有価証券
8397	沖縄銀行	13,100	3,470.00	45,457,000 5,300株 (1,300株)	貸付有価証券
8399	琉球銀行	33,000	1,067.00	35,211,000	
8410	セブン銀行	477,300	328.00	156,554,400	
8411	みずほフィナンシャルグループ	19,416,000	162.10	3,147,333,600 1,873,600株 (1,873,600株)	貸付有価証券
8416	高知銀行	5,200	827.00	4,300,400	
8418	山口フィナンシャルグループ	178,400	658.00	117,387,200 52,900株	貸付有価証券
8521	長野銀行	4,700	1,592.00	7,482,400 1,400株	貸付有価証券
8522	名古屋銀行	11,600	3,295.00	38,222,000 3,500株	貸付有価証券
8524	北洋銀行	215,400	220.00	47,388,000 65,900株	貸付有価証券
8527	愛知銀行	5,200	3,430.00	17,836,000 900株	貸付有価証券
8530	中京銀行	5,900	2,210.00	13,039,000	
8537	大光銀行	4,900	1,644.00	8,055,600 1,700株 (200株)	貸付有価証券
8541	愛媛銀行	19,900	1,117.00	22,228,300 6,100株	貸付有価証券
8542	トマト銀行	5,500	1,038.00	5,709,000	
8544	京葉銀行	60,900	583.00	35,504,700 10,000株	貸付有価証券
8550	栃木銀行	69,000	207.00	14,283,000	
8551	北日本銀行	4,400	2,138.00	9,407,200 200株	貸付有価証券

8558	東和銀行	25,100	804.00	20,180,400	貸付有価証券 2,200株
8562	福島銀行	13,400	237.00	3,175,800	貸付有価証券 4,700株 (600株)
8563	大東銀行	7,400	632.00	4,676,800	貸付有価証券 100株 (100株)
8600	トモニホールディングス	110,500	372.00	41,106,000	貸付有価証券 78,200株 (44,400株)
8713	フィデアホールディングス	138,700	127.00	17,614,900	
8714	池田泉州ホールディングス	164,300	199.00	32,695,700	貸付有価証券 41,700株
7148	F P G	44,100	1,026.00	45,246,600	
7190	マーキュリアインベストメント	6,300	713.00	4,491,900	貸付有価証券 2,500株 (600株)
8473	S B I ホールディングス	159,600	2,395.00	382,242,000	貸付有価証券 48,900株
8518	日本アジア投資	12,100	271.00	3,279,100	貸付有価証券 4,900株 (1,200株)
8595	ジャフコ	22,000	4,555.00	100,210,000	貸付有価証券 2,100株 (2,100株)
8601	大和証券グループ本社	1,146,500	556.00	637,454,000	貸付有価証券 461,000株 (461,000株)
8604	野村ホールディングス	2,514,200	560.00	1,407,952,000	貸付有価証券 1,010,800株 (242,600株)
8609	岡三証券グループ	121,700	380.00	46,246,000	貸付有価証券 48,900株 (11,700株)
8613	丸三証券	42,400	503.00	21,327,200	貸付有価証券 30,000株 (17,000株)
8614	東洋証券	51,100	145.00	7,409,500	貸付有価証券 36,100株 (20,500株)
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	164,100	339.00	55,629,900	貸付有価証券 16,800株
8617	光世証券	3,400	610.00	2,074,000	貸付有価証券 2,500株 (1,400株)
8622	水戸証券	41,300	223.00	9,209,900	貸付有価証券 29,200株 (16,600株)
8624	いちよし証券	26,700	615.00	16,420,500	貸付有価証券 8,200株
8628	松井証券	81,600	877.00	71,563,200	貸付有価証券 57,400株 (32,600株)
8692	だいこう証券ビジネス	6,900	698.00	4,816,200	
8698	マネックスグループ	107,800	270.00	29,106,000	貸付有価証券 77,100株 (43,800株)
8706	極東証券	19,200	738.00	14,169,600	
8707	岩井コスモホールディングス	13,500	1,284.00	17,334,000	
8708	藍澤證券	25,700	733.00	18,838,100	貸付有価証券 7,800株
8732	マネーパートナーズグループ	15,200	240.00	3,648,000	貸付有価証券 5,400株 (1,500株)

8739	スパークス・グループ	49,500	264.00	13,068,000 20,000株 (4,800株)	貸付有価証券
8742	小林洋行	4,100	271.00	1,111,100 100株	貸付有価証券
7181	かんぽ生命保険	50,600	1,902.00	96,241,200	
8630	SOMPホールディングス	268,700	4,197.00	1,127,733,900 81,900株	貸付有価証券
8715	アニコム ホールディングス	11,800	3,975.00	46,905,000 1,100株 (1,100株)	貸付有価証券
8725	M S & A D インシュアランスグループ ホール	373,600	3,639.00	1,359,530,400	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	117,400	2,569.00	301,600,600 47,200株 (11,300株)	貸付有価証券
8750	第一生命ホールディングス	808,600	1,654.00	1,337,424,400	
8766	東京海上ホールディングス	511,000	5,999.00	3,065,489,000	
8795	T & D ホールディングス	427,100	1,200.00	512,520,000	
8798	アドバンスクリエイト	3,300	1,855.00	6,121,500 300株	貸付有価証券
7164	全国保証	40,300	4,700.00	189,410,000 16,200株 (16,200株)	貸付有価証券
7187	ジェイリース	4,000	391.00	1,564,000 1,600株 (400株)	貸付有価証券
7191	イントラスト	5,000	841.00	4,205,000 500株 (500株)	貸付有価証券
7192	日本モーゲージサービス	2,900	2,073.00	6,011,700	
7196	C a s a	5,000	1,578.00	7,890,000	
7198	アルヒ	22,700	2,020.00	45,854,000 2,100株 (2,100株)	貸付有価証券
7199	プレミアグループ	7,700	2,083.00	16,039,100	
8253	クレディセゾン	100,100	1,851.00	185,285,100 30,600株	貸付有価証券
8424	芙蓉総合リース	15,000	6,980.00	104,700,000 3,000株 (1,500株)	貸付有価証券
8425	みずほリース	22,000	3,295.00	72,490,000 15,700株 (8,900株)	貸付有価証券
8439	東京センチュリー	28,800	5,630.00	162,144,000 11,600株 (2,800株)	貸付有価証券
8511	日本証券金融	63,000	510.00	32,130,000	
8515	アイフル	218,000	306.00	66,708,000 87,600株 (87,600株)	貸付有価証券
8566	リコーリース	11,200	4,380.00	49,056,000 1,800株	貸付有価証券
8570	イオンフィナンシャルサービス	87,400	1,680.00	146,832,000 8,500株 (8,500株)	貸付有価証券
8572	アコム	287,200	527.00	151,354,400 87,700株	貸付有価証券
8584	ジャックス	15,800	2,624.00	41,459,200	
8585	オリエントコーポレーション	386,500	171.00	66,091,500 155,400株 (155,400株)	貸付有価証券

8586	日立キャピタル	33,700	2,990.00	100,763,000	10,300株 貸付有価証券
8589	アプラスフィナンシャル	68,600	99.00	6,791,400	21,000株 貸付有価証券
8591	オリックス	893,700	1,868.00	1,669,431,600	273,900株 貸付有価証券
8593	三菱UFJリース	362,600	698.00	253,094,800	110,200株 貸付有価証券
8596	九州リースサービス	7,000	597.00	4,179,000	2,200株 貸付有価証券
8697	日本取引所グループ	410,100	2,002.00	821,020,200	232,600株 (164,400 株) 貸付有価証券
8771	イー・ギャランティ	15,300	1,327.00	20,303,100	10,700株 (6,100株) 貸付有価証券
8772	アサックス	7,400	711.00	5,261,400	
8793	NECキャピタルソリューション	5,800	2,789.00	16,176,200	
2337	いちご	181,800	427.00	77,628,600	
2353	日本駐車場開発	156,700	145.00	22,721,500	
2975	スター・マイカ・ホールディングス	7,400	1,653.00	12,232,200	2,300株 貸付有価証券
3003	ヒューリック	305,100	1,332.00	406,393,200	93,200株 貸付有価証券
3228	三栄建築設計	5,700	1,484.00	8,458,800	
3231	野村不動産ホールディングス	86,700	2,793.00	242,153,100	
3232	三重交通グループホールディングス	29,000	606.00	17,574,000	8,900株 貸付有価証券
3244	サムティ	20,300	1,891.00	38,387,300	8,200株 (2,000株) 貸付有価証券
3245	ディア・ライフ	18,400	582.00	10,708,800	
3246	コーチーアールレー	4,200	703.00	2,952,600	400株 (400株) 貸付有価証券
3250	エー・ディー・ワークス	265,100	29.00	7,687,900	
3252	日本商業開発	9,000	1,698.00	15,282,000	
3254	プレサンスコーポレーション	23,300	1,263.00	29,427,900	2,200株 (2,200株) 貸付有価証券
3258	ユニゾホールディングス	21,000	5,160.00	108,360,000	2,100株 (2,100株) 貸付有価証券
3271	THEグローバル社	7,300	449.00	3,277,700	700株 (700株) 貸付有価証券
3275	ハウスコム	1,800	1,540.00	2,772,000	600株 貸付有価証券
3276	日本管理センター	9,400	1,347.00	12,661,800	
3277	サンセイランディック	4,200	883.00	3,708,600	
3280	エストラスト	1,900	864.00	1,641,600	300株 貸付有価証券
3284	フージャースホールディングス	28,500	708.00	20,178,000	8,700株 貸付有価証券
3288	オープンハウス	41,500	2,919.00	121,138,500	4,000株 (4,000株) 貸付有価証券

3289	東急不動産ホールディングス	388,500	769.00	298,756,500	貸付有価証券 118,700株
3291	飯田グループホールディングス	119,200	1,934.00	230,532,800	貸付有価証券 47,900株 (11,500株)
3294	イーグランド	2,300	839.00	1,929,700	
3299	ムゲンエステート	9,900	711.00	7,038,900	
3452	ピーロット	3,300	1,718.00	5,669,400	貸付有価証券 300株 (300株)
3454	ファーストプラザーズ	3,200	1,248.00	3,993,600	貸付有価証券 1,300株 (1,300株)
3457	ハウスドゥ	7,900	1,349.00	10,657,100	貸付有価証券 3,200株 (800株)
3458	シーアールイー	3,500	1,180.00	4,130,000	
3464	プロパティエージェント	2,300	1,167.00	2,684,100	貸付有価証券 800株 (200株)
3465	ケイアイスター不動産	4,500	1,933.00	8,698,500	
3467	アグレ都市デザイン	2,300	572.00	1,315,600	貸付有価証券 500株
3475	グッドコムアセット	3,300	2,456.00	8,104,800	
3480	ジェイ・エス・ビー	1,500	5,290.00	7,935,000	貸付有価証券 500株
3484	テンポイノベーション	3,200	880.00	2,816,000	
3486	グローバル・リンク・マネジメント	2,400	625.00	1,500,000	貸付有価証券 900株 (200株)
4666	パーク24	76,700	2,718.00	208,470,600	貸付有価証券 7,400株 (7,400株)
4809	パラカ	3,700	1,994.00	7,377,800	貸付有価証券 2,400株 (1,500株)
8801	三井不動産	704,700	2,858.50	2,014,384,950	貸付有価証券 162,500株
8802	三菱地所	1,001,200	2,262.50	2,265,215,000	貸付有価証券 305,900株
8803	平和不動産	26,200	3,200.00	83,840,000	貸付有価証券 8,000株
8804	東京建物	156,100	1,754.00	273,799,400	
8806	ダイビル	36,800	1,372.00	50,489,600	
8818	京阪神ビルディング	23,200	1,488.00	34,521,600	
8830	住友不動産	321,200	3,963.00	1,272,915,600	
8841	テーオーシー	28,000	913.00	25,564,000	貸付有価証券 2,700株 (2,700株)
8842	東京楽天地	2,300	5,960.00	13,708,000	
8848	レオパレス21	187,200	374.00	70,012,800	貸付有価証券 75,100株 (18,000株)
8850	スタートコーポレーション	19,400	2,746.00	53,272,400	貸付有価証券 7,800株 (1,900株)
8860	フジ住宅	16,600	677.00	11,238,200	貸付有価証券 3,300株 (800株)
8864	空港施設	14,300	545.00	7,793,500	
8869	明和地所	7,800	616.00	4,804,800	

8871	ゴールドクレスト	11,300	2,020.00	22,826,000 4,500株(1,100株)	貸付有価証券
8877	エスリード	5,600	2,049.00	11,474,400	
8881	日神グループホールディングス	21,100	542.00	11,436,200	
8892	日本エスコン	25,800	967.00	24,948,600 9,200株(2,500株)	貸付有価証券
8897	タカラレーベン	65,300	478.00	31,213,400 20,000株	貸付有価証券
8904	A V A N T I A	8,000	998.00	7,984,000	
8905	イオンモール	71,600	1,865.00	133,534,000 7,300株	貸付有価証券
8908	毎日コムネット	3,000	934.00	2,802,000	
8917	ファースト住建	6,100	1,225.00	7,472,500 1,900株	貸付有価証券
8918	ランド	777,800	12.00	9,333,600	
8919	カチタス	17,700	4,555.00	80,623,500 6,900株(1,500株)	貸付有価証券
8923	トーセイ	19,700	1,465.00	28,860,500	
8928	穴吹興産	3,100	1,706.00	5,288,600	
8934	サンフロンティア不動産	19,700	1,260.00	24,822,000 6,000株	貸付有価証券
8935	エフ・ジェー・ネクスト	12,500	1,232.00	15,400,000 1,200株(1,200株)	貸付有価証券
8940	インテリックス	4,000	734.00	2,936,000	
8944	ランドビジネス	6,000	723.00	4,338,000 600株(600株)	貸付有価証券
8945	日本社宅サービス	3,600	1,078.00	3,880,800	
8999	グランディハウス	11,100	494.00	5,483,400	
9706	日本空港ビルディング	45,600	4,970.00	226,632,000 32,200株(18,300株)	貸付有価証券
1954	日本工営	9,300	3,545.00	32,968,500 3,700株(900株)	貸付有価証券
2120	L I F U L L	48,300	550.00	26,565,000 19,500株(4,700株)	貸付有価証券
2124	ジェイエイシリクルートメント	9,300	1,755.00	16,321,500	
2127	日本M&Aセンター	104,600	3,955.00	413,693,000	
2130	メンバーズ	4,100	1,923.00	7,884,300	
2139	中広	1,400	545.00	763,000 400株	貸付有価証券
2146	UTグループ	16,300	2,895.00	47,188,500	
2148	アイティメディア	4,200	904.00	3,796,800	
2151	タケエイ	13,300	1,200.00	15,960,000	
2153	E・Jホールディングス	1,700	1,819.00	3,092,300	
2154	ビーネックスグループ	15,300	1,247.00	19,079,100	
2157	コシダカホールディングス	33,300	1,784.00	59,407,200 3,200株(3,200株)	貸付有価証券
2163	アルトナー	3,300	861.00	2,841,300	

2168	パソナグループ	16,900	1,543.00	26,076,700	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
2169	CDS	3,400	1,532.00	5,208,800	
2170	リンクアンドモチベーション	30,500	551.00	16,805,500	
2174	GCA	16,700	936.00	15,631,200	
2175	エス・エム・エス	43,100	2,819.00	121,498,900	貸付有価証券 17,500株(17,500株)
2180	サニーサイドアップグループ	3,100	1,181.00	3,661,100	
2181	パーソルホールディングス	138,400	1,999.00	276,661,600	貸付有価証券 13,400株(13,400株)
2183	リニカル	6,700	1,036.00	6,941,200	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
2193	クックパッド	48,300	339.00	16,373,700	
2196	エスクリ	4,300	788.00	3,388,400	
2198	アイ・ケイ・ケイ	6,700	732.00	4,904,400	
2301	学情	4,900	2,246.00	11,005,400	貸付有価証券 1,400株
2305	スタジオアリス	7,000	1,916.00	13,412,000	
2309	シミックホールディングス	7,700	1,742.00	13,413,400	貸付有価証券 2,400株
2311	エプロ	2,200	1,318.00	2,899,600	貸付有価証券 200株(200株)
2325	NJS	3,100	1,797.00	5,570,700	
2331	綜合警備保障	55,100	5,920.00	326,192,000	貸付有価証券 22,100株(5,300株)
2371	力カクコム	103,700	2,920.00	302,804,000	貸付有価証券 31,700株
2372	アイロムグループ	4,900	1,353.00	6,629,700	貸付有価証券 2,000株(500株)
2374	セントケア・ホールディング	8,900	479.00	4,263,100	
2376	サイネックス	2,300	694.00	1,596,200	
2378	ルネサンス	7,700	1,718.00	13,228,600	
2379	ディップ	19,500	3,550.00	69,225,000	貸付有価証券 7,900株(1,900株)
2389	オプトホールディング	7,500	1,512.00	11,340,000	
2395	新日本科学	15,000	647.00	9,705,000	貸付有価証券 4,600株
2398	ツクイ	32,600	587.00	19,136,200	
2410	キャリアデザインセンター	3,500	1,311.00	4,588,500	
2412	ペネフィット・ワン	37,800	2,180.00	82,404,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
2413	エムスリー	305,200	3,170.00	967,484,000	貸付有価証券 122,500株(29,400株)
2418	ツカダ・グローバルホールディング	8,800	579.00	5,095,200	
2424	プラス	1,500	777.00	1,165,500	
2427	アウトソーシング	79,200	1,037.00	82,130,400	貸付有価証券 31,800株(7,600株)

2428	ウェルネット	13,100	689.00	9,025,900	
2429	ワールドホールディングス	4,600	1,690.00	7,774,000	
2432	ディー・エヌ・エー	67,800	1,805.00	122,379,000	27,500株 (6,600株)
2433	博報堂DYホールディングス	192,500	1,608.00	309,540,000	77,400株 (77,400株)
2440	ぐるなび	24,100	938.00	22,605,800	9,500株 (9,500株)
2445	タカミヤ	14,700	654.00	9,613,800	1,400株 (1,400株)
2453	ジャパンベストレスキューシステム	9,400	1,058.00	9,945,200	3,800株 (900株)
2461	ファンコミュニケーションズ	38,100	448.00	17,068,800	
2462	ライク	5,500	1,618.00	8,899,000	2,200株 (500株)
2464	ビジネス・ブレークスルー	5,800	403.00	2,337,400	500株
2471	エスプール	26,700	825.00	22,027,500	8,200株
2475	WDBホールディングス	6,300	2,716.00	17,110,800	2,500株 (600株)
2485	ティア	8,100	591.00	4,787,100	400株
2487	C D G	1,500	1,432.00	2,148,000	500株 (100株)
2491	バリューコマース	7,800	2,380.00	18,564,000	3,100株 (3,100株)
2492	インフォマート	151,700	908.00	137,743,600	14,600株 (14,600株)
2749	J P ホールディングス	43,500	319.00	13,876,500	
3521	エコナックホールディングス	25,000	140.00	3,500,000	7,600株
4282	EPSホールディングス	20,800	1,388.00	28,870,400	
4286	レッグス	3,400	1,617.00	5,497,800	300株 (300株)
4290	プレステージ・インターナショナル	51,800	955.00	49,469,000	5,000株 (5,000株)
4301	アミューズ	7,500	2,932.00	21,990,000	3,000株 (3,000株)
4310	ドリームインキュベータ	4,200	1,545.00	6,489,000	
4318	クイック	8,600	1,592.00	13,691,200	
4319	TAC	8,300	222.00	1,842,600	2,500株
4321	ケネディクス	131,700	554.00	72,961,800	
4324	電通グループ	142,700	3,660.00	522,282,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	5,300	1,072.00	5,681,600	1,600株
4337	ぴあ	4,000	4,505.00	18,020,000	2,800株 (1,600株)
4343	イオンファンタジー	5,300	2,361.00	12,513,300	

4345	シーティーエス	15,600	712.00	11,107,200 6,300株 (1,500株)	貸付有価証券
4346	ネクシーズグループ	4,800	1,735.00	8,328,000 1,500株	貸付有価証券
4544	みらかホールディングス	38,700	2,883.00	111,572,100 3,700株 (3,700株)	貸付有価証券
4641	アルプラス技研	12,200	1,892.00	23,082,400	
4651	サンックス	24,200	339.00	8,203,800 17,100株 (9,700株)	貸付有価証券
4653	ダイオーズ	2,700	1,346.00	3,634,200 600株	貸付有価証券
4658	日本空調サービス	14,500	790.00	11,455,000	
4661	オリエンタルランド	147,200	14,500.00	2,134,400,000 23,700株 (14,300株)	貸付有価証券
4665	ダスキン	35,600	3,060.00	108,936,000 25,200株 (14,300株)	貸付有価証券
4668	明光ネットワークジャパン	16,300	981.00	15,990,300	
4671	ファルコホールディングス	7,600	2,047.00	15,557,200	
4678	秀英予備校	3,000	446.00	1,338,000	
4679	田谷	2,500	625.00	1,562,500	
4680	ラウンドワン	38,600	1,044.00	40,298,400 11,900株	貸付有価証券
4681	リゾートトラスト	63,500	1,730.00	109,855,000 6,100株 (6,100株)	貸付有価証券
4694	ビー・エム・エル	17,800	3,055.00	54,379,000	
4696	ワタベウェディング	2,200	541.00	1,190,200 300株	貸付有価証券
4708	りらいあコミュニケーションズ	25,000	1,478.00	36,950,000	
4714	リソー教育	63,200	348.00	21,993,600 19,400株	貸付有価証券
4718	早稲田アカデミー	4,500	1,159.00	5,215,500	
4732	ユー・エス・エス	155,000	1,960.00	303,800,000	
4745	東京個別指導学院	4,900	718.00	3,518,200	
4751	サイバーエージェント	79,600	3,820.00	304,072,000 32,000株 (7,700株)	貸付有価証券
4755	楽天	645,300	875.00	564,637,500 259,500株 (62,300株)	貸付有価証券
4763	クリーク・アンド・リバー社	7,100	1,041.00	7,391,100	
4767	マー・オー・ダブリュー	12,100	997.00	12,063,700	
4792	山田コンサルティンググループ	6,700	1,539.00	10,311,300 2,000株	貸付有価証券
4801	セントラルスポーツ	5,200	3,090.00	16,068,000	
4848	フルキャストホールディングス	13,800	2,498.00	34,472,400	
4849	エン・ジャパン	24,600	4,375.00	107,625,000 2,400株 (2,400株)	貸付有価証券
5261	リソルホールディングス	1,500	4,145.00	6,217,500	
6028	テクノプロ・ホールディングス	27,800	7,450.00	207,110,000 2,700株 (2,700株)	貸付有価証券

6029	アトラ	3,200	329.00	1,052,800	貸付有価証券 300株(300株)
6032	インターワークス	2,600	542.00	1,409,200	
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	5,600	5,750.00	32,200,000	
6036	K e e P e r 技研	5,100	1,274.00	6,497,400	貸付有価証券 500株(500株)
6037	ファーストロジック	3,200	591.00	1,891,200	貸付有価証券 1,300株(300株)
6044	三機サービス	2,900	1,047.00	3,036,300	貸付有価証券 1,200株(300株)
6047	G u n o s y	9,600	1,195.00	11,472,000	貸付有価証券 3,900株(900株)
6048	デザインワン・ジャパン	2,700	323.00	872,100	
6050	イー・ガーディアン	7,000	1,901.00	13,307,000	
6054	リブセンス	8,900	285.00	2,536,500	貸付有価証券 6,300株(3,600株)
6055	ジャパンマテリアル	42,600	1,703.00	72,547,800	
6058	ベクトル	17,200	1,139.00	19,590,800	
6059	ウチヤマホールディングス	6,800	539.00	3,665,200	
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	10,100	915.00	9,241,500	貸付有価証券 3,600株(800株)
6065	ライクキッズ	3,300	798.00	2,633,400	
6070	キャリアリンク	4,500	618.00	2,781,000	
6071	I B J	9,400	1,308.00	12,295,200	
6073	アサンテ	5,600	2,005.00	11,228,000	
6077	N・フィールド	9,500	610.00	5,795,000	
6078	バリューH R	2,700	3,130.00	8,451,000	
6080	M & A キャピタルパートナーズ	9,800	4,290.00	42,042,000	
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	2,026.00	10,737,800	貸付有価証券 1,400株
6083	E R I ホールディングス	3,900	771.00	3,006,900	貸付有価証券 2,700株(1,500株)
6087	アピスト	2,100	2,659.00	5,583,900	
6088	シグマクシス	9,500	2,171.00	20,624,500	
6089	ウィルグループ	9,000	1,169.00	10,521,000	
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	19,100	215.00	4,106,500	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
6098	リクルートホールディングス	991,700	4,394.00	4,357,529,800	
6099	エラン	8,200	1,694.00	13,890,800	貸付有価証券 3,300株(800株)
6171	土木管理総合試験所	6,000	440.00	2,640,000	
6175	ネットマーケティング	5,000	1,017.00	5,085,000	貸付有価証券 1,500株
6178	日本郵政	1,134,600	1,006.00	1,141,407,600	
6183	ペルシステム24ホールディングス	23,200	1,545.00	35,844,000	
6184	鎌倉新書	10,300	1,668.00	17,180,400	貸付有価証券 3,200株

6185	S M N	2,200	804.00	1,768,800	200株 (200株)	貸付有価証券
6186	一蔵	1,500	780.00	1,170,000		
6187	L I T A L I C O	4,700	2,669.00	12,544,300		
6189	グローバルキッズ C O M P A N Y	2,100	755.00	1,585,500	200株 (200株)	貸付有価証券
6191	エアトリ	6,200	1,729.00	10,719,800	2,500株 (600株)	貸付有価証券
6194	アトラエ	3,600	3,765.00	13,554,000		
6196	ストライク	5,200	5,380.00	27,976,000	1,600株	貸付有価証券
6197	ソラスト	38,100	1,173.00	44,691,300		
6199	セラク	4,300	1,320.00	5,676,000		
6200	インソース	6,700	3,545.00	23,751,500	2,000株	貸付有価証券
6532	ベイカレント・コンサルティング	8,400	8,100.00	68,040,000		
6533	O r c h e s t r a H o l d i n g s	2,700	1,277.00	3,447,900	800株	貸付有価証券
6535	アイモバイル	4,400	699.00	3,075,600	1,300株	貸付有価証券
6538	キャリアインデックス	5,700	388.00	2,211,600	2,200株 (500株)	貸付有価証券
6539	M S - J a p a n	4,500	1,450.00	6,525,000		
6540	船場	2,300	1,069.00	2,458,700		
6541	グレイステクノロジー	6,300	2,912.00	18,345,600	600株 (600株)	貸付有価証券
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,600	2,563.00	37,419,800	5,800株 (1,400株)	貸付有価証券
6546	フルテック	1,900	1,320.00	2,508,000		
6547	グリーンズ	5,200	979.00	5,090,800		
6551	ツナググループ・ホールディングス	1,700	748.00	1,271,600		
6552	G a m e W i t h	3,100	757.00	2,346,700	300株 (300株)	貸付有価証券
6553	ソウルドアウト	2,100	2,027.00	4,256,700	600株	貸付有価証券
6555	M S & C o n s u l t i n g	1,900	1,058.00	2,010,200		
6564	ミダック	800	2,008.00	1,606,400		
6569	日総工産	9,200	1,047.00	9,632,400		
6571	キュービーネットホールディングス	8,400	2,396.00	20,126,400		
6572	R P A ホールディングス	7,800	989.00	7,714,200	2,400株	貸付有価証券
7030	スプリックス	4,700	1,069.00	5,024,300	1,400株	貸付有価証券
7033	マネジメントソリューションズ	1,500	3,265.00	4,897,500		
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	7,000	927.00	6,489,000	2,100株	貸付有価証券
8876	リログループ	75,700	3,055.00	231,263,500	30,400株 (30,400株)	貸付有価証券

8920	東祥	8,600	2,202.00	18,937,200	800株(800株)	貸付有価証券
9603	エイチ・アイ・エス	21,600	2,548.00	55,036,800	15,300株(8,700株)	貸付有価証券
9612	ラックランド	3,200	2,184.00	6,988,800	1,100株(300株)	貸付有価証券
9616	共立メンテナンス	22,900	4,345.00	99,500,500	16,200株(9,200株)	貸付有価証券
9619	イチネンホールディングス	15,500	1,559.00	24,164,500	6,200株(6,200株)	貸付有価証券
9621	建設技術研究所	9,600	2,459.00	23,606,400		
9622	スペース	9,000	1,233.00	11,097,000	1,700株	貸付有価証券
9624	長大	5,100	1,272.00	6,487,200		
9628	燐ホールディングス	6,000	1,430.00	8,580,000		
9632	スバル興業	800	10,110.00	8,088,000		
9633	東京テアトル	5,400	1,371.00	7,403,400		
9644	タナベ経営	2,700	1,297.00	3,501,900		
9663	ナガワ	4,400	7,390.00	32,516,000	1,700株(400株)	貸付有価証券
9671	よみうりランド	3,000	4,360.00	13,080,000		
9672	東京都競馬	9,100	3,185.00	28,983,500		
9675	常磐興産	5,500	1,649.00	9,069,500		
9678	カナモト	22,700	2,736.00	62,107,200		
9681	東京ドーム	56,000	1,053.00	58,968,000		
9699	西尾レントオール	14,000	2,997.00	41,958,000		
9704	アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	88,700	31.00	2,749,700	800株(100株)	貸付有価証券
9715	トランス・コスモス	13,200	2,814.00	37,144,800		
9716	乃村工藝社	59,300	1,285.00	76,200,500	42,100株(23,900株)	貸付有価証券
9722	藤田観光	6,000	2,678.00	16,068,000		
9726	KNT-CJTホールディングス	8,600	1,378.00	11,850,800	3,400株(3,400株)	貸付有価証券
9728	日本管財	14,800	1,949.00	28,845,200		
9729	トーカイ	13,400	2,550.00	34,170,000	4,100株	貸付有価証券
9731	白洋舎	1,600	2,816.00	4,505,600	300株	貸付有価証券
9735	セコム	146,900	9,755.00	1,433,009,500		
9740	セントラル警備保障	6,700	6,000.00	40,200,000		
9743	丹青社	26,100	1,289.00	33,642,900		
9744	メイテック	17,100	6,360.00	108,756,000	5,200株	貸付有価証券
9755	応用地質	14,900	1,411.00	21,023,900		
9757	船井総研ホールディングス	28,600	2,728.00	78,020,800	2,800株(2,800株)	貸付有価証券
9760	進学会ホールディングス	5,400	518.00	2,797,200		

9765	オオバ	10,800	832.00	8,985,600	
9768	いであ	2,500	2,836.00	7,090,000	貸付有価証券 200株 (200株)
9769	学究社	4,000	1,425.00	5,700,000	
9783	ペネッセホールディングス	46,100	3,045.00	140,374,500	
9787	イオンディライト	17,100	3,720.00	63,612,000	貸付有価証券 6,900株 (1,700株)
9788	ナック	7,700	1,032.00	7,946,400	貸付有価証券 2,400株
9792	ニチイ学館	19,700	1,521.00	29,963,700	貸付有価証券 7,900株 (1,900株)
9793	ダイセキ	23,200	2,975.00	69,020,000	貸付有価証券 7,100株
9795	ステップ	5,100	1,573.00	8,022,300	
合 計		171,530,748		347,652,977,550	

(注1)貸付株式の()内は、委託者の利害関係人であるモルガン・スタンレーMUF G証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

[令和2年1月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	17,392,745,258
コール・ローン	14,116,320,066
株式	580,880,722,594
投資証券	15,622,840,290
派生商品評価勘定	249,608,842
未収入金	8,178,191
未収配当金	433,996,037
差入委託証拠金	3,324,235,212
流動資産合計	632,028,646,490
資産合計	632,028,646,490
負債の部	
流動負債	

[令和2年1月27日現在]

派生商品評価勘定	93,954,763
未払金	14,744,852,523
未払解約金	1,685,128,445
未払利息	6,099
流動負債合計	16,523,941,830
負債合計	16,523,941,830
純資産の部	
元本等	
元本	195,487,623,740
剰余金	
剰余金又は欠損金()	420,017,080,920
元本等合計	615,504,704,660
純資産合計	615,504,704,660
負債純資産合計	632,028,646,490

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本となる重要な事項	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)

	[令和2年1月27日現在]
1. 期首	平成31年1月29日
期首先元本額	126,097,074,687円
期中追加設定元本額	170,792,303,976円
期中一部解約元本額	101,401,754,923円
元本の内訳	
MAXIS 海外株式(MSCイコクサイ)上場投信	3,046,944,712円
MAXIS全世界株式(オール・カントリー)上場投信	114,875,743円
ファンド・マネジャー(海外株式)	20,931,684,655円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,756,767,008円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,302,837,475円
eMAXIS バランス(波乗り型)	87,619,529円
コアバランス	219,032円

	[令和2年1月27日現在]
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	19,993,967円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	32,863,474円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	24,152,595円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	25,600,143,906円
海外株式セレクション(ラップ向け)	1,009,429,466円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	1,769,438,563円
つみたて先進国株式	2,989,420,682円
つみたて8資産均等バランス	683,036,141円
つみたて4資産均等バランス	181,421,950円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,180,995円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,840,837円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,993,655円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	11,119,893円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	8,319,246円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	6,195,759円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	3,642,655,133円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	157,796,211円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	3,778,361,547円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	5,646,102円
先進国株式インデックスファンド(ラップ向け)	328,157円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	15,074,234,046円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,537,237,414円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	1,583,124,697円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,054,134,808円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	980,929,429円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	450,354,704円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	610,379,152円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	171,857,499円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	48,717,008円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	66,754,776円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	228,389,542円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	166,730,532円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	344,466,405円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	29,664,870円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,626,775,884円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	132,399,656円

	[令和2年1月27日現在]
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,476,818,487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)	50,940,774,933円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	2,764,616円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,209,541,003円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	8,677,884,380円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	20,148,727円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	134,136,152円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	2,910,545,213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)	1,120,861,810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)	483,559,102円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	43,956,785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)	3,114,797,206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)	102,486,565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)	2,177,562,770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)	582,240,620円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,112,677,487円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	1,348,213円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	4,998,659円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	4,856,003円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	5,129,383円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	48,395,584円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	8,469,273円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	70,202,316円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	13,105,550円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	87,388,527円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,967,698,026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)	155,682,934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)	595,318,268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)	600,357,703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)	541,480,590円
合計	195,487,623,740円

	[令和2年1月27日現在]
2. 受益権の総数	195,487,623,740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 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に 係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用してあります。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してあります。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。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

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

区分	[令和2年1月27日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和2年1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	53,187,889,953
投資証券	1,105,414,496
合計	54,293,304,449

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	18,915,408,754		
			19,139,522,943	224,114,189
	合計	18,915,408,754	19,139,522,943	224,114,189

(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

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
	為替予約取引			

市場取引以外の取引	買建			40,898,000
		8,895,732,000	8,854,834,000	
	アメリカドル	471,465,160	468,554,500	2,910,660
	オーストラリアドル	340,614,670	337,276,600	3,338,070
	イギリスポンド	740,215,720	733,875,000	6,340,720
	イスイスフラン	423,787,500	421,462,500	2,325,000
	香港ドル	159,025,420	158,145,600	879,820
	シンガポールドル	68,986,500	68,501,500	485,000
	ニュージーランドドル	14,501,840	14,362,000	139,840
	スウェーデンクローネ	122,479,260	121,410,000	1,069,260
	デンマーククローネ	81,058,000	80,500,000	558,000
	イスラエルシェケル	22,079,890	22,078,000	1,890
	ユーロ	1,435,068,850	1,425,555,000	9,513,850
合計		12,775,014,810	12,706,554,700	68,460,110

(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。

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はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額	3.1486円
(1万口当たり純資産額)	(31,486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	APACHE CORP	48,604	29.98	1,457,147.92	
	BAKER HUGHES CO	84,077	22.86	1,922,000.22	
	CABOT OIL & GAS CORP	56,028	14.64	820,249.92	
	CHENIERE ENERGY INC	30,435	61.15	1,861,100.25	
	CHEVRON CORP	249,085	111.85	27,860,157.25	
	CONCHO RESOURCES INC	26,316	82.55	2,172,385.80	
	CONOCOPHILLIPS	145,614	62.62	9,118,348.68	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,015	29.46	383,421.90	
	DEVON ENERGY CORP	52,923	23.95	1,267,505.85	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	20,216	82.84	1,674,693.44	
	EOG RESOURCES INC	75,895	79.85	6,060,215.75	
	EXXON MOBIL CORP	554,983	66.32	36,806,472.56	
	HALLIBURTON CO	112,571	23.10	2,600,390.10	
	HESS CORP	36,050	64.41	2,321,980.50	
	HOLLYFRONTIER CORP	20,803	46.53	967,963.59	
	KINDER MORGAN INC	267,096	21.56	5,758,589.76	
	MARATHON OIL CORP	102,543	11.93	1,223,337.99	
	MARATHON PETROLEUM CORP	86,753	54.49	4,727,170.97	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	49,104	21.88	1,074,395.52	
	NOBLE ENERGY INC	63,856	21.67	1,383,759.52	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	117,648	42.22	4,967,098.56	
	ONEOK INC	53,572	74.84	4,009,328.48	
	PHILLIPS 66	58,684	100.32	5,887,178.88	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	21,910	142.03	3,111,877.30	
	SCHLUMBERGER LTD	181,359	35.77	6,487,211.43	
	TARGA RESOURCES CORP	30,983	38.68	1,198,422.44	
	TECHNIPFMC PLC	56,086	17.97	1,007,865.42	
	VALERO ENERGY CORP	54,611	89.26	4,874,577.86	
	WILLIAMS COS INC	157,247	22.19	3,489,310.93	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28,930	243.95	7,057,473.50	
	ALBEMARLE CORP	14,579	81.18	1,183,523.22	
	AMCOR PLC	215,543	10.49	2,261,046.07	
	AVERY DENNISON CORP	11,378	129.68	1,475,499.04	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	26,024	28.85	750,792.40	
	BALL CORP	40,789	71.93	2,933,952.77	
	CELANESE CORP	16,322	114.51	1,869,032.22	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28,182	40.93	1,153,489.26
CORTEVA INC	96,751	27.95	2,704,190.45
CROWN HOLDINGS INC	17,513	75.00	1,313,475.00
DOW INC	97,725	48.49	4,738,685.25
DUPONT DE NEMOURS INC	97,682	59.39	5,801,333.98
EASTMAN CHEMICAL CO	18,192	73.17	1,331,108.64
ECOLAB INC	33,995	198.01	6,731,349.95
FMC CORP	17,169	95.68	1,642,729.92
FREEPORT-MCMORAN INC	189,252	11.84	2,240,743.68
INTERNATIONAL PAPER CO	48,584	43.53	2,114,861.52
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,962	135.79	1,760,109.98
LINDE PLC	70,968	209.99	14,902,570.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	35,085	84.95	2,980,470.75
MARTIN MARIETTA MATERIALS	8,246	263.89	2,176,036.94
MOSAIC CO/THE	49,067	19.14	939,142.38
NEWMONT CORP	106,744	44.29	4,727,691.76
NUCOR CORP	40,215	50.33	2,024,020.95
PACKAGING CORP OF AMERICA	12,522	105.65	1,322,949.30
PPG INDUSTRIES INC	30,686	125.81	3,860,605.66
RPM INTERNATIONAL INC	16,904	73.03	1,234,499.12
SEALED AIR CORP	19,362	37.03	716,974.86
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,895	594.84	6,480,781.80
STEEL DYNAMICS INC	29,442	30.75	905,341.50
VULCAN MATERIALS CO	17,270	140.52	2,426,780.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,444	65.97	359,140.68
WESTROCK CO	35,004	40.94	1,433,063.76
3M CO	75,470	178.15	13,444,980.50
ACUTITY BRANDS INC	5,109	121.49	620,692.41
AERCAP HOLDINGS NV	16,279	60.09	978,205.11
ALLEGION PLC	12,212	128.00	1,563,136.00
AMETEK INC	30,103	99.57	2,997,355.71
ARCONIC INC	52,465	29.11	1,527,256.15
BOEING CO/THE	70,125	323.05	22,653,881.25
CATERPILLAR INC	73,770	140.38	10,355,832.60
CUMMINS INC	19,527	169.15	3,302,992.05
DEERE & CO	39,217	170.12	6,671,596.04
DOVER CORP	19,035	117.11	2,229,188.85
EATON CORP PLC	55,137	96.84	5,339,467.08
EMERSON ELECTRIC CO	80,573	76.70	6,179,949.10
FASTENAL CO	73,401	35.52	2,607,203.52
FLOWSERVE CORP	17,914	48.26	864,529.64
FORTIVE CORP	39,740	76.91	3,056,403.40

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	18,157	69.51	1,262,093.07
GENERAL DYNAMICS CORP	32,130	185.07	5,946,299.10
GENERAL ELECTRIC CO	1,144,678	11.71	13,404,179.38
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,895	40.11	918,318.45
HEICO CORP	5,313	122.39	650,258.07
HEICO CORP-CLASS A	10,225	96.42	985,894.50
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	94,471	177.13	16,733,648.23
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,472	276.47	1,512,843.84
IDEX CORP	9,962	172.14	1,714,858.68
ILLINOIS TOOL WORKS	42,471	176.30	7,487,637.30
INGERSOLL-RAND PLC	32,092	130.60	4,191,215.20
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,715	97.00	1,718,355.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	29,100	56.66	1,648,806.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	30,800	32.00	985,600.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	105,384	41.35	4,357,628.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	29,277	222.98	6,528,185.46
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,573	240.97	1,101,955.81
LOCKHEED MARTIN CORP	33,360	432.50	14,428,200.00
MASCO CORP	37,587	48.55	1,824,848.85
MIDDLEBY CORP	7,441	114.17	849,538.97
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,065	381.64	8,039,246.60
OWENS CORNING	14,579	65.33	952,446.07
PACCAR INC	45,042	76.79	3,458,775.18
PARKER HANNIFIN CORP	16,776	198.28	3,326,345.28
PENTAIR PLC	19,534	46.20	902,470.80
RAYTHEON COMPANY	36,529	231.24	8,446,965.96
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,303	199.72	3,056,315.16
ROPER TECHNOLOGIES INC	13,664	376.84	5,149,141.76
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	21,291	50.30	1,070,937.30
SMITH (A.O.) CORP	18,552	45.43	842,817.36
SNAP-ON INC	7,126	165.97	1,182,702.22
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	13,761	70.45	969,462.45
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,833	166.48	3,301,797.84
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,848	361.87	1,754,345.76
TEXTRON INC	29,594	44.70	1,322,851.80
TRANSDIGM GROUP INC	6,242	656.73	4,099,308.66
UNITED RENTALS INC	10,351	151.65	1,569,729.15
UNITED TECHNOLOGIES CORP	107,601	153.19	16,483,397.19
WABCO HOLDINGS INC	7,061	135.87	959,378.07
WABTEC CORP	24,478	79.04	1,934,741.12
MW GRAINGER INC	6,204	329.00	2,041,116.00
XYLEM INC	22,883	81.48	1,864,506.84

CINTAS CORP	11,445	283.44	3,243,970.80
COPART INC	26,843	100.29	2,692,084.47
COSTAR GROUP INC	4,786	650.65	3,114,010.90
EQUIFAX INC	15,994	154.01	2,463,235.94
IHS MARKIT LTD	50,492	79.89	4,033,805.88
MANPOWERGROUP INC	8,016	95.25	763,524.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	49,164	21.16	1,040,310.24
REPUBLIC SERVICES INC	28,961	94.64	2,740,869.04
ROBERT HALF INTL INC	16,076	61.95	995,908.20
ROLLINS INC	18,841	36.61	689,769.01
TRANSUNION	24,547	92.88	2,279,925.36
VERISK ANALYTICS INC	20,360	165.30	3,365,508.00
WASTE CONNECTIONS INC	34,462	98.42	3,391,750.04
WASTE MANAGEMENT INC	55,691	121.00	6,738,611.00
AMERCO	1,316	371.27	488,591.32
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	16,650	27.64	460,206.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,331	79.62	1,379,894.22
CSX CORP	99,326	76.70	7,618,304.20
DELTA AIR LINES INC	21,107	58.81	1,241,302.67
EXPEDITORS INTL WASH INC	22,408	74.34	1,665,810.72
FEDEX CORP	32,584	154.07	5,020,216.88
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	11,001	115.71	1,272,925.71
KANSAS CITY SOUTHERN	13,184	166.58	2,196,190.72
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	17,608	37.06	652,552.48
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,503	207.86	7,171,793.58
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,598	204.47	1,758,033.06
SOUTHWEST AIRLINES CO	17,655	56.55	998,390.25
UBER TECHNOLOGIES INC	25,065	36.80	922,392.00
UNION PACIFIC CORP	92,401	185.68	17,157,017.68
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	7,729	81.90	633,005.10
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	91,565	116.66	10,681,972.90
XPO LOGISTICS INC	12,632	91.84	1,160,122.88
APTIV PLC	33,692	91.54	3,084,165.68
AUTOLIV INC	11,086	77.35	857,502.10
BORGWARNER INC	26,328	39.24	1,033,110.72
FORD MOTOR CO	517,402	9.00	4,656,618.00
GENERAL MOTORS CO	168,800	34.31	5,791,528.00
HARLEY-DAVIDSON INC	21,175	35.23	745,995.25
LEAR CORP	7,966	133.75	1,065,452.50
TESLA INC	17,628	564.82	9,956,646.96
CAPRI HOLDINGS LTD	18,926	35.38	669,601.88
DR HORTON INC	45,585	58.51	2,667,178.35

GARMIN LTD	17,164	99.59	1,709,362.76
HANESBRANDS INC	45,996	14.25	655,443.00
HASBRO INC	17,070	104.68	1,786,887.60
LEGGETT & PLATT INC	18,001	50.88	915,890.88
LENNAR CORP-A	37,175	66.64	2,477,342.00
LULULEMON ATHLETICA INC	14,445	240.35	3,471,855.75
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,927	141.86	1,124,524.22
NEWELL BRANDS INC	54,450	19.89	1,083,010.50
NIKE INC -CL B	164,362	102.03	16,769,854.86
NVR INC	441	3,983.60	1,756,767.60
POLARIS INC	7,269	91.83	667,512.27
PULTEGROUP INC	33,084	43.71	1,446,101.64
PVH CORP	10,157	94.95	964,407.15
RALPH LAUREN CORP	7,043	116.23	818,607.89
TAPESTRY INC	38,590	27.29	1,053,121.10
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	23,552	20.99	494,356.48
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	27,640	18.61	514,380.40
VF CORP	44,978	84.53	3,801,990.34
WHIRLPOOL CORP	8,208	149.42	1,226,439.36
ARAMARK	32,487	46.09	1,497,325.83
CARNIVAL CORP	54,475	47.52	2,588,652.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,490	869.71	3,035,287.90
DARDEN RESTAURANTS INC	16,461	117.09	1,927,418.49
DOMINO'S PIZZA INC	5,254	285.10	1,497,915.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	35,408	108.49	3,841,413.92
LAS VEGAS SANDS CORP	45,504	67.85	3,087,446.40
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	36,669	141.02	5,171,062.38
MCDONALD'S CORP	99,648	211.24	21,049,643.52
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	27,216	21.24	578,067.84
MGM RESORTS INTERNATIONAL	64,986	31.57	2,051,608.02
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	28,655	55.84	1,600,095.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	23,538	126.51	2,977,792.38
STARBUCKS CORP	157,055	92.03	14,453,771.65
VAIL RESORTS INC	5,169	243.88	1,260,615.72
WYNN RESORTS LTD	12,743	134.75	1,717,119.25
YUM! BRANDS INC	39,620	104.98	4,159,307.60
ACTIVISION BLIZZARD INC	100,577	59.40	5,974,273.80
ALPHABET INC-CL A	40,275	1,466.17	59,049,996.75
ALPHABET INC-CL C	40,037	1,466.71	58,722,668.27
ALTICE USA INC- A	20,557	28.03	576,212.71
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	20,349	504.67	10,269,529.83
COMCAST CORP-CLASS A	595,193	44.59	26,539,655.87

DISCOVERY INC - A	20,907	30.32	633,900.24
DISCOVERY INC-C	48,533	28.64	1,390,227.78
DISH NETWORK CORP-A	34,341	36.74	1,261,688.34
ELECTRONIC ARTS INC	38,185	112.33	4,289,321.05
FACEBOOK INC-CLASS A	315,668	217.94	68,796,683.92
FOX CORP - CLASS A	46,107	36.61	1,687,977.27
FOX CORP - CLASS B	22,299	36.04	803,655.96
IAC/INTERACTIVECORP	10,186	263.36	2,682,584.96
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	49,804	23.41	1,165,911.64
LIBERTY BROADBAND-C	13,841	130.17	1,801,682.97
LIBERTY GLOBAL PLC- C	53,721	19.41	1,042,724.61
LIBERTY GLOBAL PLC-A	21,978	20.51	450,768.78
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	11,683	48.89	571,181.87
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	19,923	49.49	986,088.88
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	26,389	47.23	1,246,352.47
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	19,709	72.02	1,419,442.18
MATCH GROUP INC	7,942	85.57	679,596.94
NETFLIX INC	57,436	353.16	20,284,097.76
NEWS CORP - CLASS A	49,804	13.94	694,267.76
OMNICOM GROUP	28,834	77.70	2,240,401.80
PINTEREST INC- CLASS A	20,017	22.44	449,181.48
ROKU INC	10,871	130.09	1,414,208.39
SIRIUS XM HOLDINGS INC	199,216	7.11	1,416,425.76
SNAP INC - A	93,216	19.05	1,775,764.80
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	15,209	125.28	1,905,383.52
TRIPADVISOR INC	15,981	29.74	475,274.94
TWITTER INC	96,257	33.19	3,194,769.83
VIACOMCBS INC - CLASS B	73,475	35.79	2,629,670.25
WALT DISNEY CO/THE	236,353	140.08	33,108,328.24
ZILLOW GROUP INC - C	16,207	48.44	785,067.08
ADVANCE AUTO PARTS INC	9,424	141.68	1,335,192.32
AMAZON.COM INC	55,166	1,861.64	102,699,232.24
AUTOZONE INC	3,195	1,140.23	3,643,034.85
BEST BUY CO INC	30,828	89.44	2,757,256.32
BOOKING HOLDINGS INC	5,577	1,962.96	10,947,427.92
BURLINGTON STORES INC	8,783	220.74	1,938,759.42
CARMAX INC	21,742	96.73	2,103,103.66
DOLLAR GENERAL CORP	33,741	154.34	5,207,585.94
DOLLAR TREE INC	31,361	87.71	2,750,673.31
EBAY INC	103,716	35.36	3,667,397.76
EXPEDIA GROUP INC	18,359	112.14	2,058,778.26
GAP INC/THE	31,895	17.66	563,265.70

GENUINE PARTS CO	19,239	98.07	1,886,768.73
GRUBHUB INC	12,513	58.57	732,886.41
HOME DEPOT INC	143,679	232.00	33,333,528.00
KOHLS CORP	21,909	45.49	996,640.41
LKQ CORP	39,066	33.61	1,313,008.26
LOWE'S COS INC	101,793	120.23	12,238,572.39
MERCADOLIBRE INC	5,820	660.58	3,844,575.60
NORDSTROM INC	13,993	38.67	541,109.31
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	10,149	430.77	4,371,884.73
ROSS STORES INC	47,781	115.76	5,531,128.56
TARGET CORP	67,003	114.32	7,659,782.96
TIFFANY & CO	14,502	134.29	1,947,473.58
TJX COMPANIES INC	158,515	61.19	9,699,532.85
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15,044	93.57	1,407,667.08
ULTA BEAUTY INC	7,100	272.98	1,938,158.00
WAYFAIR INC- CLASS A	7,701	106.74	822,004.74
COSTCO WHOLESALE CORP	57,731	310.51	17,926,052.81
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	32,500	5.40	175,500.00
KROGER CO	105,505	28.19	2,974,185.95
SYSKO CORP	64,054	82.63	5,292,782.02
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	100,557	52.04	5,232,986.28
WALMART INC	187,378	114.37	21,430,421.86
ALTRIA GROUP INC	245,053	50.25	12,313,913.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	72,979	44.30	3,232,969.70
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	39,861	71.79	2,861,621.19
BUNGE LTD	19,126	54.32	1,038,924.32
CAMPBELL SOUP CO	22,206	48.79	1,083,430.74
COCA-COLA CO/THE	533,338	57.68	30,762,935.84
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	29,274	53.12	1,555,034.88
CONAGRA BRANDS INC	64,948	32.28	2,096,521.44
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21,661	191.56	4,149,381.16
GENERAL MILLS INC	80,153	53.71	4,305,017.63
HERSHEY CO/THE	19,691	154.68	3,045,803.88
HORMEL FOODS CORP	37,926	47.23	1,791,244.98
INGREDION INC	8,346	92.26	770,001.96
JM SMUCKER CO/THE	15,106	107.67	1,626,463.02
KELLOGG CO	33,442	69.34	2,318,868.28
KRAFT HEINZ CO/THE	86,075	30.41	2,617,540.75
LAMB WESTON HOLDINGS INC	19,143	90.69	1,736,078.67
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,833	172.67	2,733,884.11
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	24,279	56.12	1,362,537.48
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	189,436	55.09	10,436,029.24

MONSTER BEVERAGE CORP	53,355	67.10	3,580,120.50
PEPSICO INC	183,571	142.91	26,235,049.46
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	204,144	86.15	17,587,005.60
TYSON FOODS INC-CL A	38,448	85.93	3,303,836.64
CHURCH & DWIGHT CO INC	32,589	71.31	2,323,921.59
CLOROX COMPANY	16,354	158.28	2,588,511.12
COLGATE-PALMOLIVE CO	106,821	70.30	7,509,516.30
COTY INC-CL A	44,160	10.54	465,446.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	29,020	205.34	5,958,966.80
KIMBERLY-CLARK CORP	45,130	143.42	6,472,544.60
PROCTER & GAMBLE CO/THE	328,442	125.14	41,101,231.88
ABBOTT LABORATORIES	232,036	90.40	20,976,054.40
ABIOMED INC	5,812	182.98	1,063,479.76
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,765	269.98	2,636,354.70
AMERISOURCEBERGEN CORP	20,182	88.92	1,794,583.44
ANTHEM INC	33,563	297.28	9,977,608.64
BAXTER INTERNATIONAL INC	63,651	90.78	5,778,237.78
BECTON DICKINSON AND CO	35,437	278.25	9,860,345.25
BOSTON SCIENTIFIC CORP	182,836	43.21	7,900,343.56
CARDINAL HEALTH INC	38,982	53.82	2,098,011.24
CENTENE CORP	75,120	66.61	5,003,743.20
CERNER CORP	41,824	74.46	3,114,215.04
CIGNA CORP	49,526	206.01	10,202,851.26
COOPER COS INC/THE	6,486	352.36	2,285,406.96
CVS HEALTH CORP	170,619	71.43	12,187,315.17
DANAHER CORP	82,041	162.25	13,311,152.25
DAVITA INC	13,978	83.19	1,162,829.82
DENTSPLY SIRONA INC	29,852	59.66	1,780,970.32
DEXCOM INC	12,087	233.94	2,827,632.78
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	27,299	230.45	6,291,054.55
HCA HEALTHCARE INC	35,803	143.45	5,135,940.35
HENRY SCHEIN INC	18,977	71.20	1,351,162.40
HOLOGIC INC	34,148	53.72	1,834,430.56
HUMANA INC	17,721	356.90	6,324,624.90
IDEXX LABORATORIES INC	11,376	280.77	3,194,039.52
INSULET CORP	7,686	192.56	1,480,016.16
INTUITIVE SURGICAL INC	15,128	589.20	8,913,417.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,747	177.18	2,258,513.46
MCKESSON CORP	24,135	152.62	3,683,483.70
MEDTRONIC PLC	176,250	119.26	21,019,575.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	18,038	107.79	1,944,316.02
RESMED INC	18,869	162.39	3,064,136.91

STERIS PLC	11,077	151.29	1,675,839.33
STRYKER CORP	44,195	214.23	9,467,894.85
TELEFLEX INC	6,064	380.02	2,304,441.28
UNITEDHEALTH GROUP INC	124,354	292.81	36,412,094.74
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	10,995	147.26	1,619,123.70
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	11,861	148.29	1,758,867.69
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	16,956	145.19	2,461,841.64
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	9,377	155.75	1,460,467.75
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26,609	147.80	3,932,810.20
ABBVIE INC	194,013	83.54	16,207,846.02
AGILENT TECHNOLOGIES INC	40,510	88.26	3,575,412.60
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	29,423	105.27	3,097,359.21
ALLERGAN PLC	42,976	188.19	8,087,653.44
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,461	120.00	1,735,320.00
AMGEN INC	78,726	225.59	17,759,798.34
BEIGENE LTD-ADR	5,282	163.56	863,923.92
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,928	369.97	1,083,272.16
BIOGEN INC	24,176	278.14	6,724,312.64
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	23,768	86.15	2,047,613.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	307,531	64.16	19,731,188.96
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	45,038	31.57	1,421,849.66
ELI LILLY & CO	113,938	139.07	15,845,357.66
EXACT SCIENCES CORP	19,501	89.57	1,746,704.57
GILEAD SCIENCES INC	166,129	63.15	10,491,046.35
ILLUMINA INC	19,257	319.58	6,154,152.06
INCYTE CORP	23,903	76.74	1,834,316.22
IONIS PHARMACEUTICALS INC	17,277	59.42	1,026,599.34
IQVIA HOLDINGS INC	21,857	158.10	3,455,591.70
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,481	145.74	1,090,280.94
JOHNSON & JOHNSON	346,290	148.32	51,361,732.80
MERCK & CO. INC.	335,845	85.98	28,875,953.10
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	3,215	819.95	2,636,139.25
MYLAN NV	68,854	21.85	1,504,459.90
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,310	99.17	1,121,612.70
PERKINELMER INC	14,659	99.78	1,462,675.02
PERRIGO CO PLC	18,133	58.76	1,065,495.08
PFIZER INC	725,369	39.82	28,884,193.58
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,446	345.28	3,606,794.88
SAREPTA THERAPEUTICS INC	9,594	112.39	1,078,269.66
SEATTLE GENETICS INC	15,744	113.57	1,788,046.08
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	148,269	10.10	1,497,516.90
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52,519	333.68	17,524,539.92

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	33,721	229.06	7,724,132.26
WATERS CORP	8,759	237.53	2,080,525.27
ZOETIS INC	62,595	136.31	8,532,324.45
BANK OF AMERICA CORP	1,160,667	33.54	38,928,771.18
CITIGROUP INC	296,557	78.42	23,255,999.94
CITIZENS FINANCIAL GROUP	58,469	39.13	2,287,891.97
COMERICA INC	19,032	64.73	1,231,941.36
EAST WEST BANCORP INC	19,390	49.23	954,569.70
FIFTH THIRD BANCORP	94,955	28.84	2,738,502.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	21,408	113.75	2,435,160.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	137,123	13.72	1,881,327.56
JPMORGAN CHASE & CO	419,729	133.15	55,886,916.35
KEYCORP	129,538	19.29	2,498,788.02
M & T BANK CORP	16,719	171.49	2,867,141.31
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	58,521	15.85	927,557.85
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	58,428	150.38	8,786,402.64
REGIONS FINANCIAL CORP	131,970	15.72	2,074,568.40
SIGNATURE BANK	7,276	145.80	1,060,840.80
SVB FINANCIAL GROUP	6,850	252.66	1,730,721.00
TRUIST FINANCIAL CORP	175,955	55.48	9,761,983.40
US BANCORP	196,487	53.84	10,578,860.08
WELLS FARGO & CO	549,223	47.57	26,126,538.11
ZIONS BANCORP NA	23,581	46.63	1,099,582.03
AGNC INVESTMENT CORP	73,656	18.35	1,351,587.60
ALLY FINANCIAL INC	49,401	32.14	1,587,748.14
AMERICAN EXPRESS CO	92,567	135.11	12,506,727.37
AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,369	167.57	2,910,523.33
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	186,167	9.66	1,798,373.22
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	111,240	45.95	5,111,478.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	172,838	226.86	39,210,028.68
BLACKROCK INC	15,220	536.84	8,170,704.80
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	86,885	62.21	5,405,115.85
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	61,624	104.30	6,427,383.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	14,828	119.81	1,776,542.68
CME GROUP INC	47,004	209.24	9,835,116.96
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41,570	76.29	3,171,375.30
E*TRADE FINANCIAL CORP	31,643	45.63	1,443,870.09
EATON VANCE CORP	14,568	46.71	680,471.28
EQUITABLE HOLDINGS INC	54,366	24.98	1,358,062.68
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,816	276.56	1,331,912.96
FRANKLIN RESOURCES INC	40,165	25.26	1,014,567.90
GOLDMAN SACHS GROUP INC	42,472	241.92	10,274,826.24

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	73,568	97.11	7,144,188.48
INVESCO LTD	53,186	18.17	966,389.62
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	34,366	21.89	752,271.74
KKR & CO INC -A	65,434	30.69	2,008,169.46
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5,024	359.27	1,804,972.48
MOODY'S CORP	22,354	255.62	5,714,129.48
MORGAN STANLEY	162,753	54.55	8,878,176.15
MSCI INC	11,204	276.11	3,093,536.44
NASDAQ INC	15,430	110.21	1,700,540.30
NORTHERN TRUST CORP	27,018	101.62	2,745,569.16
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,769	90.42	1,425,832.98
S&P GLOBAL INC	32,340	294.83	9,534,802.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	154,267	47.15	7,273,689.05
SEI INVESTMENTS COMPANY	16,788	63.71	1,069,563.48
STATE STREET CORP	48,301	78.34	3,783,900.34
SYNCHRONY FINANCIAL	78,182	32.63	2,551,078.66
T ROWE PRICE GROUP INC	31,271	131.18	4,102,129.78
TD AMERITRADE HOLDING CORP	34,792	49.32	1,715,941.44
VOYA FINANCIAL INC	19,080	61.47	1,172,847.60
AFLAC INC	97,304	52.39	5,097,756.56
ALLEGHANY CORP	1,943	804.85	1,563,823.55
ALLSTATE CORP	43,355	118.28	5,128,029.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10,041	110.49	1,109,430.09
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	113,926	51.06	5,817,061.56
AON PLC	30,952	213.42	6,605,775.84
ARCH CAPITAL GROUP LTD	53,345	44.99	2,399,991.55
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,390	96.86	2,362,415.40
ASSURANT INC	8,075	129.18	1,043,128.50
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	20,699	44.63	923,796.37
BROWN & BROWN INC	32,199	41.83	1,346,884.17
CHUBB LTD	59,747	152.01	9,082,141.47
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,242	106.01	2,145,955.63
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,568	167.32	596,997.76
EVEREST RE GROUP LTD	5,336	277.35	1,479,939.60
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	35,586	48.30	1,718,803.80
GLOBE LIFE INC	13,119	104.79	1,374,740.01
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	47,317	58.98	2,790,756.66
LINCOLN NATIONAL CORP	26,881	56.55	1,520,120.55
LOEWS CORP	35,297	51.35	1,812,500.95
MARKEL CORP	1,811	1,188.38	2,152,156.18
MARSH & MCLENNAN COS	66,460	113.87	7,567,800.20
METLIFE INC	104,298	51.27	5,347,358.46

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	36,717	54.36	1,995,936.12
PROGRESSIVE CORP	76,595	76.75	5,878,666.25
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	52,817	93.52	4,939,445.84
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8,391	155.21	1,302,367.11
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,858	190.09	1,113,547.22
TRAVELERS COS INC/THE	34,413	134.78	4,638,184.14
UNUM GROUP	24,472	28.10	687,663.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,804	209.01	3,512,204.04
WR BERKLEY CORP	18,719	72.07	1,349,078.33
CBRE GROUP INC - A	41,644	60.77	2,530,705.88
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,800	5.57	873,376.00
JONES LANG LASALLE INC	6,735	169.46	1,141,313.10
SBA COMMUNICATIONS CORP	14,773	253.15	3,739,784.95
ACCENTURE PLC-CL A	83,657	208.57	17,448,340.49
ADOBE INC	63,723	351.37	22,390,350.51
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	21,981	95.52	2,099,625.12
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,426	107.40	582,752.40
ANSYS INC	11,152	277.34	3,092,895.68
AUTODESK INC	28,794	199.19	5,735,476.86
AUTOMATIC DATA PROCESSING	56,965	177.21	10,094,767.65
BLACK KNIGHT INC	20,018	65.91	1,319,386.38
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	18,444	77.96	1,437,894.24
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	15,138	131.03	1,983,532.14
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	36,304	74.58	2,707,552.32
CDK GLOBAL INC	16,214	54.51	883,825.14
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES INC	15,437	115.48	1,782,664.76
CITRIX SYSTEMS INC	17,544	128.26	2,250,193.44
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	71,463	62.42	4,460,720.46
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,934	140.41	692,782.94
DOCUSIGN INC	13,792	74.18	1,023,090.56
DROPBOX INC-CLASS A	34,323	17.34	595,160.82
DXC TECHNOLOGY CO	33,876	34.48	1,168,044.48
EPAM SYSTEMS INC	7,218	227.57	1,642,600.26
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	80,548	147.92	11,914,660.16
FISERV INC	75,863	120.84	9,167,284.92
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	11,316	320.63	3,628,249.08
FORTINET INC	19,046	117.99	2,247,237.54
GARTNER INC	11,955	160.57	1,919,614.35
GLOBAL PAYMENTS INC	39,387	198.77	7,828,953.99
GODADDY INC - CLASS A	23,065	71.29	1,644,303.85
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	10,949	111.81	1,224,207.69
INTL BUSINESS MACHINES CORP	116,227	140.56	16,336,867.12

INTUIT INC	34,117	288.08	9,828,425.36
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10,024	151.25	1,516,130.00
LEIDOS HOLDINGS INC	17,896	101.62	1,818,591.52
MASTERCARD INC - A	118,513	323.67	38,359,102.71
MICROSOFT CORP	951,878	165.04	157,097,945.12
MONGODB INC	5,682	152.11	864,289.02
NORTONLIFELOCK INC	80,915	28.07	2,271,284.05
OKTA INC	13,686	129.66	1,774,526.76
ORACLE CORP	306,408	54.07	16,567,480.56
PALO ALTO NETWORKS INC	12,567	242.90	3,052,524.30
PAYCHEX INC	42,134	88.91	3,746,133.94
PAYCOM SOFTWARE INC	6,396	314.81	2,013,524.76
PAYPAL HOLDINGS INC	146,661	116.98	17,156,403.78
PTC INC	14,480	86.05	1,246,004.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,549	197.34	1,884,399.66
SABRE CORP	36,894	22.67	836,571.45
SALESFORCE.COM INC	109,303	182.11	19,905,169.33
SERVICENOW INC	24,582	309.39	7,605,424.98
SPLUNK INC	19,888	157.00	3,122,416.00
SQUARE INC - A	44,845	71.14	3,190,273.30
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	29,407	65.45	1,924,688.15
SYNOPSYS INC	19,975	154.05	3,077,148.75
TWILIO INC - A	14,941	121.38	1,813,538.58
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,919	309.90	1,524,398.10
VERISIGN INC	14,185	212.75	3,017,858.75
VISA INC-CLASS A SHARES	226,693	205.00	46,472,065.00
VMWARE INC-CLASS A	10,825	150.63	1,630,569.75
WESTERN UNION CO	57,511	27.10	1,558,548.10
WIX.COM LTD	5,788	141.03	816,281.64
WORKDAY INC-CLASS A	21,330	186.07	3,968,873.10
AMPHENOL CORP-CL A	39,471	105.36	4,158,664.56
APPLE INC	592,978	318.31	188,750,827.18
ARISTA NETWORKS INC	7,052	238.05	1,678,728.60
ARROW ELECTRONICS INC	10,301	81.52	839,737.52
CDW CORP/DE	18,645	137.92	2,571,518.40
CISCO SYSTEMS INC	562,213	48.85	27,464,105.05
COGNEX CORP	22,082	57.73	1,274,793.86
CORNING INC	103,206	29.36	3,030,128.16
DELL TECHNOLOGIES -C	20,562	49.98	1,027,688.76
F5 NETWORKS INC	7,657	135.82	1,039,973.74
FLEX LTD	71,479	13.46	962,464.73
FLIR SYSTEMS INC	18,035	54.29	979,120.15

HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	167,513	14.76	2,472,491.88
HP INC	192,287	21.98	4,226,468.26
IPG PHOTONICS CORP	4,712	144.33	680,082.96
JUNIPER NETWORKS INC	45,898	24.58	1,128,172.84
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	24,361	102.98	2,508,695.78
MOTOROLA SOLUTIONS INC	21,804	179.66	3,917,306.64
NETAPP INC	31,311	59.81	1,872,710.91
SEAGATE TECHNOLOGY	31,929	63.23	2,018,870.67
TE CONNECTIVITY LTD	44,564	98.40	4,385,097.60
TRIMBLE INC	33,454	44.08	1,474,652.32
WESTERN DIGITAL CORP	38,755	69.52	2,694,247.60
XEROX HOLDINGS CORP	27,401	35.52	973,283.52
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6,899	252.70	1,743,377.30
AT&T INC	958,702	38.50	36,910,027.00
CENTURYLINK INC	131,798	14.71	1,938,748.58
SPRINT CORP	107,222	4.83	517,882.26
T-MOBILE US INC	44,696	81.58	3,646,299.68
VERIZON COMMUNICATIONS INC	542,698	60.28	32,713,835.44
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	31,433	34.78	1,093,239.74
AES CORP	86,493	20.38	1,762,727.34
ALLIANT ENERGY CORP	30,845	58.93	1,817,695.85
AMEREN CORPORATION	32,432	80.39	2,607,208.48
AMERICAN ELECTRIC POWER	65,338	102.16	6,674,930.08
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,090	135.78	3,270,940.20
AQUA AMERICA INC	28,529	51.86	1,479,513.94
ATMOS ENERGY CORP	15,255	117.38	1,790,631.90
CENTERPOINT ENERGY INC	65,952	26.46	1,745,089.92
CMS ENERGY CORP	37,762	67.49	2,548,557.38
CONSOLIDATED EDISON INC	43,230	93.61	4,046,760.30
DOMINION ENERGY INC	107,929	84.00	9,066,036.00
DTE ENERGY COMPANY	24,298	132.76	3,225,802.48
DUKE ENERGY CORP	96,025	96.28	9,245,287.00
EDISON INTERNATIONAL	46,723	76.92	3,593,933.16
ENTERGY CORP	26,470	130.73	3,460,423.10
EVERGY INC	31,053	71.37	2,216,252.61
EVERSOURCE ENERGY	42,238	91.81	3,877,870.78
EXELON CORP	127,811	47.73	6,100,419.03
FIRSTENERGY CORP	70,501	50.47	3,558,185.47
NEXTERA ENERGY INC	63,104	263.72	16,641,786.88
NISOURCE INC	50,305	29.08	1,462,869.40
NRG ENERGY INC	33,371	37.96	1,266,763.16
OGE ENERGY CORP	26,636	45.52	1,212,470.72

PINNACLE WEST CAPITAL	14,385	97.12	1,397,071.20	
PPL CORP	94,648	36.53	3,457,491.44	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	65,736	61.66	4,053,281.76	
SEMPRA ENERGY	36,158	159.76	5,776,602.08	
SOUTHERN CO/THE	137,704	69.44	9,562,165.76	
UGI CORP	27,122	43.58	1,181,976.76	
VISTRA ENERGY CORP	50,453	22.17	1,118,543.01	
WEC ENERGY GROUP INC	42,083	98.96	4,164,533.68	
XCEL ENERGY INC	68,327	67.17	4,589,524.59	
ADVANCED MICRO DEVICES	135,339	50.35	6,814,318.65	
ANALOG DEVICES INC	48,523	117.57	5,704,849.11	
APPLIED MATERIALS INC	121,099	62.00	7,508,138.00	
BROADCOM INC	52,255	324.00	16,930,620.00	
INTEL CORP	581,384	68.47	39,807,362.48	
KLA CORP	20,691	179.40	3,711,965.40	
LAM RESEARCH CORP	18,950	306.54	5,808,933.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	82,249	27.31	2,246,220.19	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	35,779	62.56	2,238,334.24	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	31,233	107.22	3,348,802.26	
MICRON TECHNOLOGY INC	144,841	57.76	8,366,016.16	
NVIDIA CORP	75,927	250.48	19,018,194.96	
NXP SEMICONDUCTORS NV	36,800	135.28	4,978,304.00	
ON SEMICONDUCTOR CORP	53,099	24.99	1,326,944.01	
QORVO INC	15,555	113.39	1,763,781.45	
QUALCOMM INC	159,525	89.65	14,301,416.25	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,297	122.31	2,727,146.07	
TERADYNE INC	23,005	72.10	1,658,660.50	
TEXAS INSTRUMENTS INC	122,620	130.52	16,004,362.40	
XILINX INC	33,112	100.80	3,337,689.60	
アメリカドル 小計		39,688,308	3,691,672,697.37 (402,613,824,375)	
カナダドル	CAMECO CORP	58,200	11.05	643,110.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	156,600	39.78	6,229,548.00
	CENOVUS ENERGY INC	131,200	11.53	1,512,736.00
	ENBRIDGE INC	265,200	53.96	14,310,192.00
	ENCANA CORP	164,100	4.96	813,936.00
	HUSKY ENERGY INC	55,278	9.15	505,793.70
	IMPERIAL OIL LTD	35,700	33.58	1,198,806.00
	INTER PIPELINE LTD	55,200	22.30	1,230,960.00
	KEYERA CORP	28,800	35.00	1,008,000.00
	PARKLAND FUEL CORP	18,900	46.32	875,448.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	71,632	50.84	3,641,770.88

PRARIESKY ROYALTY LTD	30,288	14.88	450,685.44
SUNCOR ENERGY INC	203,300	42.48	8,636,184.00
TC ENERGY CORP	121,500	72.32	8,786,880.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	31,600	81.45	2,573,820.00
BARRICK GOLD CORP	231,600	24.60	5,697,360.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	20,200	57.14	1,154,228.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	84,200	12.04	1,013,768.00
FRANCO-NEVADA CORP	24,500	145.01	3,552,745.00
KINROSS GOLD CORP	172,200	6.46	1,112,412.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,300	56.64	1,489,632.00
LUNDIN MINING CORP	92,400	7.32	676,368.00
METHANEX CORP	6,600	49.63	327,558.00
NUTRIEN LTD	74,959	58.17	4,360,365.03
TECK RESOURCES LTD-CLS B	66,000	19.00	1,254,000.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	57.67	449,826.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	58,500	39.06	2,285,010.00
BOMBARDIER INC-B	325,500	1.22	397,110.00
CAE INC	36,300	39.03	1,416,789.00
WSP GLOBAL INC	14,100	94.11	1,326,951.00
THOMSON REUTERS CORP	26,732	104.06	2,781,731.92
AIR CANADA	15,900	47.18	750,162.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	93,900	124.31	11,672,709.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18,300	343.48	6,285,684.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	39,000	69.53	2,711,670.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	24,700	39.24	969,228.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	35,110	84.41	2,963,635.10
STARS GROUP INC/THE	31,900	32.34	1,031,646.00
QUEBECOR INC -CL B	23,700	33.31	789,447.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	60,900	26.06	1,587,054.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	8,200	144.92	1,188,344.00
DOLLARAMA INC	39,700	46.57	1,848,829.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	113,900	44.00	5,011,600.00
EMPIRE CO LTD 'A'	23,800	31.13	740,894.00
LOBLAW COMPANIES LTD	23,400	68.93	1,612,962.00
METRO INC/CN	33,300	54.45	1,813,185.00
WESTON (GEORGE) LTD	9,311	107.08	997,021.88
SAPUTO INC	31,800	40.04	1,273,272.00
AURORA CANNABIS INC	70,900	2.60	184,340.00
BAUSCH HEALTH COS INC	42,900	37.30	1,600,170.00
CANOPY GROWTH CORP	29,000	29.76	863,040.00
CRONOS GROUP INC	18,500	9.99	184,815.00
BANK OF MONTREAL	83,500	104.02	8,685,670.00

BANK OF NOVA SCOTIA	159,900	73.34	11,727,066.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	57,600	108.95	6,275,520.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	43,900	73.79	3,239,381.00	
ROYAL BANK OF CANADA	188,100	105.77	19,895,337.00	
TORONTO-DOMINION BANK	238,500	74.20	17,696,700.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	116,800	81.98	9,575,264.00	
CI FINANCIAL CORP	32,400	23.17	750,708.00	
IGM FINANCIAL INC	8,400	39.12	328,608.00	
ONEX CORPORATION	10,700	86.92	930,044.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,400	598.47	2,034,798.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	37,700	34.40	1,296,880.00	
IA FINANCIAL CORP INC	12,900	73.25	944,925.00	
INTACT FINANCIAL CORP	18,500	142.29	2,632,365.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	257,200	27.14	6,980,408.00	
POWER CORP OF CANADA	40,100	34.09	1,367,009.00	
POWER FINANCIAL CORP	36,600	35.36	1,294,176.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	76,900	63.50	4,883,150.00	
BLACKBERRY LTD	76,300	8.68	662,284.00	
CGI INC	31,000	113.29	3,511,990.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,600	1,394.90	3,626,740.00	
OPEN TEXT CORP	35,600	60.96	2,170,176.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	13,200	611.84	8,076,288.00	
BCE INC	20,400	62.44	1,273,776.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	47,300	66.12	3,127,476.00	
TELUS CORP	11,600	52.32	606,912.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	64,200	19.84	1,273,728.00	
ALTAGAS LTD	37,200	20.37	757,764.00	
ATCO LTD -CLASS I	10,600	51.86	549,716.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	18,400	40.25	740,600.00	
EMERA INC	32,100	60.44	1,940,124.00	
FORTIS INC	57,300	58.19	3,334,287.00	
HYDRO ONE LTD	40,300	26.55	1,069,965.00	
カナダドル 小計		5,404,710	261,053,266.95	
			(21,651,757,960)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	34,797	35.12	1,222,070.64
	OIL SEARCH LTD	186,060	7.71	1,434,522.60
	ORIGIN ENERGY LTD	234,926	8.55	2,008,617.30
	SANTOS LTD	229,115	8.84	2,025,376.60
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,309	21.92	291,733.28
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	121,215	35.39	4,289,798.85
	WORLEY LTD	46,227	15.92	735,933.84
	ALUMINA LTD	344,478	2.25	775,075.50

BHP GROUP LTD	387,617	40.45	15,679,107.65
BLUESCOPE STEEL LTD	62,283	15.29	952,307.07
BORAL LTD	161,332	5.08	819,566.56
FORTESCUE METALS GROUP LTD	178,051	12.48	2,222,076.48
INCITEC PIVOT LTD	242,190	3.40	823,446.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	56,922	31.57	1,797,027.54
NEWCREST MINING LTD	101,290	31.98	3,239,254.20
ORICA LTD	47,480	23.00	1,092,040.00
RIO TINTO LTD	49,042	103.18	5,060,153.56
SOUTH32 LTD	640,598	2.73	1,748,832.54
CIMIC GROUP LTD	14,688	28.88	424,189.44
BRAMBLES LTD	205,503	12.32	2,531,796.96
SEEK LTD	42,875	24.01	1,029,428.75
AURIZON HOLDINGS LTD	276,804	5.47	1,514,117.88
QANTAS AIRWAYS LTD	111,760	6.71	749,909.60
SYDNEY AIRPORT	151,737	8.43	1,279,142.91
TRANSURBAN GROUP	354,613	15.89	5,634,800.57
ARISTOCRAT LEISURE LTD	73,768	36.64	2,702,859.52
CROWN RESORTS LTD	57,791	12.04	695,803.64
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,710	41.47	236,793.70
TABCORP HOLDINGS LTD	280,895	4.75	1,334,251.25
REA GROUP LTD	7,714	113.30	873,996.20
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	54,999	4.32	237,595.68
WESFARMERS LTD	150,804	44.91	6,772,607.64
COLES GROUP LTD	148,998	16.30	2,428,667.40
WOOLWORTHS GROUP LTD	167,407	40.84	6,836,901.88
COCA-COLA AMATIL LTD	71,010	11.94	847,859.40
TREASURY WINE ESTATES LTD	95,465	17.70	1,689,730.50
COCHLEAR LTD	7,598	236.05	1,793,507.90
RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,252	79.36	1,686,558.72
SONIC HEALTHCARE LTD	59,911	31.22	1,870,421.42
CSL LTD	59,604	310.70	18,518,962.80
AUST AND NZ BANKING GROUP	372,600	25.90	9,650,340.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	70,751	10.29	728,027.79
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	232,858	84.94	19,778,958.52
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	379,156	25.80	9,782,224.80
WESTPAC BANKING CORP	458,590	25.21	11,561,053.90
AMP LTD	429,255	1.86	798,414.30
ASX LTD	26,007	85.45	2,222,298.15
CHALLENGER LTD	84,517	8.72	736,988.24
MACQUARIE GROUP LTD	43,126	145.86	6,290,358.36
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,586	66.52	1,036,780.72

INSURANCE AUSTRALIA GROUP	303,259	7.30	2,213,790.70	
MEDIBANK PRIVATE LTD	383,070	3.16	1,210,501.20	
QBE INSURANCE GROUP LTD	167,335	13.77	2,304,202.95	
SUNCORP GROUP LTD	163,905	12.99	2,129,125.95	
LENDLEASE GROUP	75,880	18.69	1,418,197.20	
COMPUTERSHARE LTD	61,533	17.89	1,100,825.37	
WISETECH GLOBAL LTD	21,384	24.74	529,040.16	
TELSTRA CORP LTD	553,786	3.88	2,148,689.68	
TPG TELECOM LTD	38,310	7.08	271,234.80	
AGL ENERGY LTD	90,391	19.96	1,804,204.36	
AUSNET SERVICES	291,574	1.76	513,170.24	
オーストラリアドル 小計	9,820,711		186,135,271.36	
			(13,829,850,662)	
イギリスポンド	BP PLC	2,673,117	4.86	12,994,021.73
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	563,985	21.87	12,334,351.95
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	487,876	22.00	10,733,272.00
	ANGLO AMERICAN PLC	137,285	21.32	2,926,916.20
	ANTOFAGASTA PLC	51,351	8.75	449,629.35
	BHP GROUP PLC	277,375	17.79	4,934,501.25
	CRODA INTERNATIONAL PLC	16,627	52.10	866,266.70
	EVRAZ PLC	72,392	3.79	274,510.46
	GLENCORE PLC	1,400,102	2.30	3,227,935.16
	JOHNSON MATTHEY PLC	26,611	27.92	742,979.12
	MONDI PLC	62,069	16.27	1,009,862.63
	RIO TINTO PLC	148,582	44.38	6,594,812.07
	ASHTEAD GROUP PLC	59,077	25.58	1,511,189.66
	BAE SYSTEMS PLC	420,163	6.43	2,705,009.39
	BUNZL PLC	42,961	20.39	875,974.79
	DCC PLC	12,893	63.60	819,994.80
	FERGUSON PLC	29,480	70.50	2,078,340.00
	MEGGITT PLC	95,201	6.93	660,123.73
	MELROSE INDUSTRIES PLC	643,838	2.46	1,583,841.48
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	228,189	6.58	1,501,483.62
	SMITHS GROUP PLC	51,864	17.42	903,730.20
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	9,366	91.55	857,457.30
	WEIR GROUP PLC/THE	34,482	13.87	478,265.34
	EXPERIAN PLC	118,357	26.93	3,187,354.01
	G4S PLC	215,078	2.06	444,781.30
	INTERTEK GROUP PLC	21,544	61.70	1,329,264.80
	RELX PLC	255,305	20.50	5,233,752.50
	RENTOKIL INITIAL PLC	244,280	4.81	1,175,963.92
	EASYJET PLC	21,458	14.82	318,114.85

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	128,786	8.09	1,042,651.45
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	16,279	54.06	880,042.74
BURBERRY GROUP PLC	55,298	20.99	1,160,705.02
PERSIMMON PLC	41,799	30.49	1,274,451.51
TAYLOR WIMPEY PLC	422,957	2.23	943,194.11
CARNIVAL PLC	21,352	34.28	731,946.56
COMPASS GROUP PLC	208,620	19.27	4,020,107.40
GVC HOLDINGS PLC	71,141	8.87	631,020.67
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	23,178	48.06	1,113,934.68
TUI AG-DI	54,723	8.38	458,578.74
WHITBREAD PLC	17,181	43.02	739,126.62
AUTO TRADER GROUP PLC	123,180	5.95	733,660.08
INFORMA PLC	161,537	8.20	1,324,603.40
ITV PLC	497,411	1.41	701,349.51
PEARSON PLC	106,703	5.83	622,932.11
WPP PLC	166,848	10.03	1,673,485.44
JD SPORTS FASHION PLC	61,200	8.49	519,710.40
KINGFISHER PLC	262,672	2.06	543,468.36
MARKS & SPENCER GROUP PLC	242,457	1.84	447,454.39
NEXT PLC	17,816	71.94	1,281,683.04
OCADO GROUP PLC	60,020	13.18	791,063.60
SAINSBURY (J) PLC	226,693	2.09	475,375.22
TESCO PLC	1,266,507	2.48	3,152,335.92
WM MORRISON SUPERMARKETS	291,067	1.87	546,187.22
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	47,071	26.70	1,256,795.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	300,999	34.12	10,271,590.87
COCA-COLA HBC AG-DI	26,550	27.88	740,214.00
DIAGEO PLC	310,815	32.40	10,070,406.00
IMPERIAL BRANDS PLC	125,656	19.59	2,461,601.04
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	93,040	61.50	5,721,960.00
UNILEVER PLC	145,660	44.74	6,516,828.40
NMC HEALTH PLC	16,135	13.47	217,419.12
SMITH & NEPHEW PLC	112,583	19.30	2,172,851.90
ASTRAZENECA PLC	172,110	76.59	13,181,904.90
GLAXOSMITHKLINE PLC	654,646	18.22	11,932,887.28
BARCLAYS PLC	2,268,192	1.73	3,933,952.20
HSBC HOLDINGS PLC	2,651,908	5.79	15,365,154.95
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,203,645	0.58	5,346,397.38
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	644,196	2.23	1,439,133.86
STANDARD CHARTERED PLC	357,748	6.88	2,464,168.22
3I GROUP PLC	124,324	11.17	1,388,699.08
HARGREAVES LANSDOWN PLC	39,736	18.31	727,764.84

LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	40,787	79.50	3,242,566.50	
M&G PLC	342,951	2.45	841,601.75	
SCHRODERS PLC	15,858	32.65	517,763.70	
ST JAMES'S PLACE PLC	68,500	11.28	773,022.50	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	306,681	3.13	962,671.65	
ADMIRAL GROUP PLC	23,975	23.02	551,904.50	
AVIVA PLC	519,481	4.11	2,138,183.79	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	172,900	3.39	586,995.50	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	781,633	3.11	2,437,131.69	
PRUDENTIAL PLC	340,688	14.17	4,829,252.40	
RSA INSURANCE GROUP PLC	138,397	5.52	764,505.02	
AVEVA GROUP PLC	8,815	51.25	451,768.75	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	45,774	11.15	510,563.19	
SAGE GROUP PLC/THE	144,210	7.66	1,104,648.60	
HALMA PLC	50,170	21.62	1,084,675.40	
BT GROUP PLC	1,118,218	1.71	1,912,152.78	
VODAFONE GROUP PLC	3,509,128	1.56	5,491,785.32	
CENTRICA PLC	805,334	0.91	734,947.80	
NATIONAL GRID PLC	459,026	10.14	4,656,359.74	
SEVERN TRENT PLC	31,279	26.18	818,884.22	
SSE PLC	134,030	15.29	2,049,988.85	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	91,032	10.10	919,423.20	
イギリスポンド 小計		39,410,214	241,153,295.09 (34,366,756,083)	
イスラエル	CLARIANT AG-REG	26,644	22.22	592,029.68
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,041	654.00	680,814.00
	GIVAUDAN-REG	1,196	3,154.00	3,772,184.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	64,357	51.94	3,342,702.58
	SIKA AG-REG	16,786	181.65	3,049,176.90
	ABB LTD-REG	241,435	23.41	5,651,993.35
	GEBERIT AG-REG	4,792	523.20	2,507,174.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,642	245.80	649,403.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,353	255.70	1,368,762.10
	ADECCO GROUP AG-REG	20,138	60.32	1,214,724.16
	SGS SA-REG	677	2,766.00	1,872,582.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	7,109	163.70	1,163,743.30
	CIE FINANCIERE RICHMONT-REG	68,335	75.72	5,174,326.20
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	3,864	260.00	1,004,640.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,706	49.90	284,729.40
	DUFRY AG-REG	5,962	89.50	533,599.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	380	2,184.00	829,920.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	140	8,205.00	1,148,700.00

CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	13	92,100.00	1,197,300.00	
NESTLE SA-REG	390,612	108.90	42,537,646.80	
ALCON INC	54,490	59.99	3,268,855.10	
SONOVA HOLDING AG-REG	7,244	242.40	1,755,945.60	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,371	1,007.00	1,380,597.00	
LONZA GROUP AG-REG	9,728	395.10	3,843,532.80	
NOVARTIS AG-REG	281,819	91.55	25,800,529.45	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	92,205	323.50	29,828,317.50	
VIFOR PHARMA AG	6,048	181.50	1,097,712.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	336,070	13.20	4,436,124.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	29,937	50.16	1,501,639.92	
PARGESA HOLDING SA-BR	5,795	81.40	471,713.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,445	900.40	2,201,478.00	
UBS GROUP AG-REG	505,733	12.39	6,268,560.53	
BALOISE HOLDING AG - REG	6,298	177.70	1,119,154.60	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,437	499.70	2,217,168.90	
SWISS RE AG	39,041	111.05	4,335,503.05	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	19,646	413.00	8,113,798.00	
SWISS PRIME SITE-REG	9,822	118.80	1,166,853.60	
TEMENOS AG - REG	8,652	157.55	1,363,122.60	
SWISSCOM AG-REG	3,334	534.40	1,781,689.60	
スイスフラン 小計		2,291,297	180,528,446.72	
			(20,289,592,126)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	354,368	74.35	26,347,260.80
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	10.90	1,738,550.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	182,000	66.80	12,157,600.00
	MTR CORP	197,000	46.15	9,091,550.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	110,500	23.30	2,574,650.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	285,000	56.05	15,974,250.00
	SANDS CHINA LTD	318,400	41.30	13,149,920.00
	SJM HOLDINGS LTD	202,000	9.18	1,854,360.00
	WYNN MACAU LTD	222,000	18.00	3,996,000.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	185,300	24.70	4,576,910.00
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	106,000	28.50	3,021,000.00
	WH GROUP LTD	1,202,000	7.96	9,567,920.00
	BANK OF EAST ASIA LTD	198,020	17.66	3,497,033.20
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	480,000	27.35	13,128,000.00
	HANG SENG BANK LTD	100,200	165.50	16,583,100.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	157,000	271.40	42,609,800.00
	AIA GROUP LTD	1,587,000	83.00	131,721,000.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	341,368	53.40	18,229,051.20
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	272,000	17.98	4,890,560.00

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	203,641	37.05	7,544,899.05	
KERRY PROPERTIES LTD	66,000	23.25	1,534,500.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	786,000	10.56	8,300,160.00	
SINO LAND CO	401,400	11.22	4,503,708.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	210,000	115.70	24,297,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	66,000	73.00	4,818,000.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	162,400	26.40	4,287,360.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	169,000	44.65	7,545,850.00	
WHEELOCK & CO LTD	105,000	50.35	5,286,750.00	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	526,000	11.74	6,175,240.00	
PCCW LTD	624,000	4.72	2,945,280.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	88,500	56.00	4,956,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	216,500	82.60	17,882,900.00	
HONG KONG & CHINA GAS	1,323,532	15.50	20,514,746.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	179,000	57.55	10,301,450.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	42,800	115.50	4,943,400.00	
香港ドル 小計	11,829,429		470,545,758.25	
			(6,601,756,988)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	196,300	6.75	1,325,025.00
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	97,900	2.19	214,401.00
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	196,600	4.12	809,992.00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	240,600	1.04	250,224.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	298,500	2.22	662,670.00
	SATS LTD	67,600	4.83	326,508.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	76,840	8.82	677,728.80
	GENTING SINGAPORE LTD	812,000	0.91	738,920.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	227,450	2.09	475,370.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,000	30.14	301,400.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	239,200	4.10	980,720.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	237,000	26.20	6,209,400.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	423,000	11.10	4,695,300.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	166,100	26.35	4,376,735.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	101,500	8.81	894,215.00
	CAPITALAND LTD	334,400	3.89	1,300,816.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	64,100	10.92	699,972.00
	UOL GROUP LTD	63,500	8.36	530,860.00
	VENTURE CORP LTD	40,400	16.46	664,984.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,071,860	3.39	3,633,605.40
シンガポールドル 小計		4,964,850		29,768,846.70
			(2,399,369,044)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	116,941	5.64	659,547.24
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	129,268	8.88	1,148,546.18

A2 MILK CO LTD	98,430	16.01	1,575,864.30	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	78,403	22.77	1,785,236.31	
RYMAN HEALTHCARE LTD	55,157	16.62	916,709.34	
SPARK NEW ZEALAND LTD	232,532	4.58	1,064,996.56	
MERCURY NZ LTD	67,670	5.20	351,884.00	
MERIDIAN ENERGY LTD	174,163	5.22	909,130.86	
ニュージーランドドル 小計	952,564		8,411,914.79 (604,143,720)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN PETROLEUM AB	23,420	319.00	7,470,980.00
	BOLIDEN AB	35,187	243.00	8,550,441.00
	ALFA LAVAL AB	42,367	248.70	10,536,672.90
	ASSA ABLOY AB-B	131,469	240.20	31,578,853.80
	ATLAS COPCO AB-A SHS	88,457	386.50	34,188,630.50
	ATLAS COPCO AB-B SHS	50,258	340.60	17,117,874.80
	EPIROC AB-A	89,978	122.70	11,040,300.60
	EPIROC AB-B	47,516	120.25	5,713,799.00
	SANDVIK AB	148,908	187.60	27,935,140.80
	SKANSKA AB-B SHS	44,418	226.70	10,069,560.60
	SKF AB-B SHARES	50,843	184.60	9,385,617.80
	VOLVO AB-B SHS	194,183	156.60	30,409,057.80
	SECURITAS AB-B SHS	40,147	157.25	6,313,115.75
	ELECTROLUX AB-SER B	28,100	238.50	6,701,850.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	60,917	75.94	4,626,036.98
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	105,565	188.94	19,945,451.10
	ICA GRUPPEN AB	12,942	426.30	5,517,174.60
	SWEDISH MATCH AB	22,380	545.00	12,197,100.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	78,773	313.00	24,655,949.00
	NORDEA BANK ABP	422,423	76.51	32,319,583.73
	SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A	216,683	92.48	20,038,843.84
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	201,999	94.46	19,080,825.54
	SWEDBANK AB - A SHARES	119,174	134.75	16,058,696.50
	INDSTRIVARDEN AB-C SHS	22,733	232.00	5,274,056.00
	INVESTOR AB-B SHS	59,496	539.60	32,104,041.60
	KINNEVIK AB - B	29,318	234.60	6,878,002.80
	LUNDBERGS AB-B SHS	11,144	433.80	4,834,267.20
	ERICSSON LM-B SHS	400,880	79.70	31,950,136.00
	HEXAGON AB-B SHS	34,530	560.40	19,350,612.00
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	13,572	451.40	6,126,400.80
	TELE2 AB-B SHS	66,187	148.50	9,828,769.50
	TELIA CO AB	366,386	41.29	15,128,077.94
スウェーデンクローネ 小計		3,260,353		502,925,920.48 (5,733,355,493)

ノルウェークローネ	AKER BP ASA	15,871	280.00	4,443,880.00	
	EQUINOR ASA	129,597	179.80	23,301,540.60	
	NORSK HYDRO ASA	174,818	30.46	5,324,956.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	23,592	338.70	7,990,610.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	15,376	269.80	4,148,444.80	
	MOWI ASA	57,582	224.30	12,915,642.60	
	ORKLA ASA	99,346	88.74	8,815,964.04	
	DNB ASA	124,765	161.30	20,124,594.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	28,569	200.20	5,719,513.80	
	TELENOR ASA	90,741	167.00	15,153,747.00	
ノルウェークローネ 小計		760,257		107,938,894.02	
				(1,300,663,672)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	13,946	508.60	7,092,935.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	28,411	354.90	10,083,063.90	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	24,661	670.00	16,522,870.00	
	ISS A/S	21,888	171.00	3,742,848.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	488	8,150.00	3,977,200.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	810	8,622.00	6,983,820.00	
	DSV PANALPINA A/S	28,321	758.40	21,478,646.40	
	PANDORA A/S	12,951	375.40	4,861,805.40	
	CARLSBERG AS-B	13,955	1,038.50	14,492,267.50	
	COLOPLAST-B	15,792	857.40	13,540,060.80	
	DEMANT A/S	16,698	224.00	3,740,352.00	
	GENMAB A/S	8,604	1,534.50	13,202,838.00	
	H LUNDBECK A/S	9,745	277.10	2,700,339.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	231,502	418.85	96,964,612.70	
	DANSKE BANK A/S	82,780	109.60	9,072,688.00	
	TRYG A/S	17,515	209.40	3,667,641.00	
	ORSTED A/S	24,742	749.60	18,546,603.20	
デンマーククローネ 小計		552,809		250,670,592.00	
				(4,035,796,531)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	71,688	14.38	1,030,873.44	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,393	527.50	1,789,807.50	
	BANK HAPOALIM BM	135,631	29.40	3,987,551.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	197,481	24.94	4,925,176.14	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	155,641	15.80	2,459,127.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	20,283	93.30	1,892,403.90	
	AZRIELI GROUP LTD	4,300	259.50	1,115,850.00	
	NICE LTD	8,221	613.00	5,039,473.00	
イスラエルシェケル 小計		596,638		22,240,263.18	
				(701,457,900)	
ユーロ	ENI SPA	333,917	13.47	4,497,861.99	

GALP ENERGIA SGPS SA	67,192	14.11	948,415.08
NESTE OYJ	56,798	34.27	1,946,467.46
OMV AG	19,498	47.17	919,720.66
REPSOL SA	193,725	13.10	2,537,797.50
TENARIS SA	60,528	10.23	619,504.08
TOTAL SA	314,820	47.38	14,917,745.70
VOPAK	10,339	48.66	503,095.74
AIR LIQUIDE SA	61,948	130.60	8,090,408.80
AKZO NOBEL N.V.	30,062	88.04	2,646,658.48
ARCELORMITTAL	88,126	14.10	1,242,576.60
ARKEMA	9,094	85.96	781,720.24
BASF SE	120,113	63.69	7,649,996.97
COVESTRO AG	22,745	39.76	904,341.20
CRH PLC	105,653	34.99	3,696,798.47
EVONIK INDUSTRIES AG	26,587	25.99	690,996.13
FUCHS PETROLUB SE -PREF	10,122	42.00	425,124.00
HEIDELBERGCEMENT AG	19,503	65.10	1,269,645.30
KONINKLIJKE DSM NV	23,919	112.90	2,700,455.10
LANXESS AG	11,178	55.50	620,379.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	29,853	32.60	973,207.80
SOLVAY SA	9,767	95.00	927,865.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,887	11.95	894,899.65
SYMRISE AG	16,771	92.96	1,559,032.16
THYSSENKRUPP AG	51,741	11.31	585,449.41
UMICORE	24,596	42.90	1,055,168.40
UPM-KYMMENE OYJ	69,583	29.22	2,033,215.26
VOESTALPINE AG	17,200	23.36	401,792.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	33,753	31.93	1,077,733.29
AIRBUS SE	76,561	139.00	10,641,979.00
ALSTOM	24,963	47.12	1,176,256.56
ANDRITZ AG	9,933	37.58	373,282.14
BOUYGUES SA	29,012	38.08	1,104,776.96
BRENNETAG AG	20,601	48.73	1,003,886.73
CNH INDUSTRIAL NV	136,696	9.60	1,312,281.60
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	63,877	35.21	2,249,109.17
DASSAULT AVIATION SA	379	1,117.00	423,343.00
EIFFAGE	10,331	104.85	1,083,205.35
FERROVIAL SA	65,015	29.60	1,924,444.00
GEA GROUP AG	19,764	28.40	561,297.60
HOCHTIEF AG	3,785	109.70	415,214.50
KINGSPAN GROUP PLC	19,818	57.50	1,139,535.00
KION GROUP AG	8,618	57.96	499,499.28

KNORR-BREMSE AG	6,315	99.80	630,237.00
KONE OYJ-B	44,622	59.50	2,655,009.00
LEGRAND SA	34,257	73.40	2,514,463.80
LEONARDO SPA	52,963	11.17	591,861.52
METSO OYJ	14,331	34.97	501,155.07
MTU AERO ENGINES AG	6,937	286.70	1,988,837.90
PRYSMIAN SPA	30,405	21.20	644,586.00
SAFRAN SA	42,920	147.00	6,309,240.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	72,502	94.22	6,831,138.44
SIEMENS AG-REG	100,200	117.92	11,815,584.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	32,993	15.61	515,185.69
THALES SA	13,389	98.70	1,321,494.30
VINCI SA	66,912	102.40	6,851,788.80
WARTSILA OYJ ABP	56,373	11.03	622,076.05
BUREAU VERITAS SA	38,507	25.52	982,698.64
EDENRED	31,372	48.48	1,520,914.56
RANDSTAD NV	15,727	54.26	853,347.02
TELEPERFORMANCE	7,782	232.00	1,805,424.00
WOLTERS KLUWER	36,237	69.58	2,521,370.46
ADP	3,694	171.10	632,043.40
AENA SME SA	8,789	168.50	1,480,946.50
ATLANTIA SPA	64,892	21.36	1,386,093.12
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,318	14.42	451,762.15
DEUTSCHE POST AG-REG	130,074	33.20	4,319,107.17
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	6,188	69.70	431,303.60
GETLINK SE	57,368	15.82	907,561.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	42,295	69.41	2,935,695.95
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	7,940	53.40	423,996.00
CONTINENTAL AG	14,643	103.10	1,509,693.30
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	118,956	43.94	5,226,926.64
FAURECIA	10,213	43.18	440,997.34
FERRARI NV	15,610	157.00	2,450,770.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	142,775	12.14	1,733,574.05
MICHELIN (CGDE)	22,169	106.70	2,365,432.30
NOKIAN RENKAAT OYJ	17,852	23.24	414,880.48
PEUGEOT SA	74,421	19.27	1,434,092.67
PIRELLI & C SPA	60,013	4.78	287,402.25
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	19,325	66.58	1,286,658.50
RENAULT SA	24,461	36.27	887,200.47
VALEO SA	30,711	28.56	877,106.16
VOLKSWAGEN AG	4,043	175.45	709,344.35
VOLKSWAGEN AG-PREF	24,489	177.52	4,347,287.28

ADIDAS AG	23,640	313.00	7,399,320.00
ESSILORLUXOTTICA	37,157	139.00	5,164,823.00
HERMES INTERNATIONAL	4,155	711.00	2,954,205.00
KERING	9,940	573.30	5,698,602.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	36,485	416.30	15,188,705.50
MONCLER SPA	24,023	40.55	974,132.65
PUMA SE	11,447	78.10	894,010.70
SEB SA	3,301	129.00	425,829.00
ACCOR SA	23,608	38.18	901,353.44
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	10,002	105.30	1,053,210.60
SODEXO SA	11,860	98.30	1,165,838.00
ALTICE EUROPE NV	93,086	6.14	572,292.72
BOLLORE	127,306	3.71	472,559.87
EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,562	14.45	354,920.90
JCDECAUX SA	12,164	25.32	307,992.48
PUBLICIS GROUPE	28,920	41.30	1,194,396.00
SES	44,806	12.75	571,276.50
TELENET GROUP HOLDING NV	4,798	40.94	196,430.12
UBISOFT ENTERTAINMENT	10,331	66.00	681,846.00
VIVENDI	111,738	24.83	2,774,454.54
DELIVERY HERO SE	15,387	70.00	1,077,090.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	143,532	31.14	4,469,586.48
PROSUS NV	64,033	68.04	4,356,805.32
ZALANDO SE	18,493	46.02	851,047.86
CARREFOUR SA	79,394	15.29	1,213,934.26
CASINO GUICHARD PERRACHON	8,253	36.54	301,564.62
COLRUYT SA	7,590	45.28	343,675.20
JERONIMO MARTINS	35,504	15.81	561,495.76
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	152,999	22.44	3,434,062.55
METRO AG	25,884	12.84	332,350.56
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	99,955	70.71	7,067,818.05
DANONE	80,925	74.10	5,996,542.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	73,695	8.72	642,620.40
HEINEKEN HOLDING NV	15,074	91.40	1,377,763.60
HEINEKEN NV	33,892	100.50	3,406,146.00
KERRY GROUP PLC-A	20,962	117.80	2,469,323.60
PERNOD RICARD SA	27,926	164.20	4,585,449.20
REMY COINTREAU	3,129	98.95	309,614.55
BEIERSDORF AG	13,385	106.50	1,425,502.50
HENKEL AG & CO KGAA	13,862	87.55	1,213,618.10
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	23,407	95.64	2,238,645.48
L'OREAL	33,139	270.50	8,964,099.50

UNILEVER NV	192,348	51.86	9,975,167.28
BIOMERIEUX	5,688	89.00	506,232.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5,210	120.20	626,242.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	28,083	72.02	2,022,537.66
FRESENIUS SE & CO KGAA	54,955	48.82	2,683,177.87
KONINKLIJKE PHILIPS NV	118,734	45.61	5,415,457.74
SARTORIUS AG-VORZUG	4,855	218.80	1,062,274.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,888	45.09	896,849.36
BAYER AG-REG	122,223	75.25	9,197,280.75
EUROFINS SCIENTIFIC	1,598	479.40	766,081.20
GALAPAGOS NV	5,815	213.00	1,238,595.00
GRIFOLS SA	37,527	31.16	1,169,341.32
IPSEN	5,519	64.05	353,491.95
MERCK KGAA	16,993	120.00	2,039,160.00
ORION OYJ-CLASS B	13,641	43.38	591,746.58
QIAGEN N.V.	28,718	31.46	903,468.28
RECORDATI SPA	13,960	40.29	562,448.40
SANOFI	147,709	89.11	13,162,348.99
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,656	163.10	596,293.60
UCB SA	16,484	82.20	1,354,984.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	56,084	15.79	885,566.36
AIB GROUP PLC	119,393	2.69	321,167.17
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	863,336	4.60	3,977,388.95
BANCO DE SABADELL SA	781,778	0.96	753,633.99
BANCO SANTANDER SA	2,176,334	3.54	7,704,222.36
BANK OF IRELAND GROUP PLC	124,012	4.56	565,742.74
BANKIA SA	124,756	1.68	210,650.50
BANKINTER SA	87,575	5.94	520,545.80
BNP PARIBAS	147,460	49.91	7,359,728.60
CAIXABANK SA	472,728	2.65	1,254,147.38
COMMERZBANK AG	120,031	5.14	616,959.34
CREDIT AGRICOLE SA	152,766	12.57	1,921,032.45
ERSTE GROUP BANK AG	39,278	33.80	1,327,596.40
FINECOBANK SPA	82,757	10.98	909,085.64
ING GROEP NV	508,900	10.22	5,200,958.00
INTESA SANPAOLO	1,959,412	2.27	4,463,540.53
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248		
KBC GROUP NV	32,435	68.32	2,215,959.20
MEDIOBANCA SPA	82,124	9.56	785,269.68
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	21,657	21.10	456,962.70
SOCIETE GENERALE SA	105,495	30.19	3,184,894.05
UNICREDIT SPA	260,505	12.44	3,241,724.22

AMUNDI SA	7,883	74.00	583,342.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	258,817	7.82	2,026,278.29
DEUTSCHE BOERSE AG	24,605	150.10	3,693,210.50
EURAZEO SE	4,053	62.45	253,109.85
EXOR NV	14,150	73.50	1,040,025.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,661	95.46	1,017,699.06
NATIXIS	130,038	3.92	510,399.15
WENDEL	3,922	123.10	482,798.20
AEGON NV	230,907	3.85	888,991.95
AGEAS	24,055	51.50	1,238,832.50
ALLIANZ SE-REG	55,548	220.95	12,273,330.60
ASSICURAZIONI GENERALI	145,446	18.14	2,638,390.44
AXA SA	253,114	24.31	6,153,201.34
CNP ASSURANCES	24,823	17.05	423,232.15
HANNOVER RUECK SE	7,805	179.40	1,400,217.00
MAPFRE SA	149,830	2.39	358,093.70
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18,843	272.70	5,138,486.10
NN GROUP NV	40,126	32.43	1,301,286.18
POSTE ITALIANE SPA	64,711	10.58	684,965.93
SAMPO OYJ-A SHS	57,666	40.98	2,363,152.68
SCOR SE	21,136	38.40	811,622.40
AROUNDOWN SA	120,183	8.25	991,750.11
DEUTSCHE WOHNEN SE	47,758	38.05	1,817,191.90
VONOVIA SE	66,753	51.22	3,419,088.66
ADYEN NV	1,345	835.20	1,123,344.00
AMADEUS IT GROUP SA	56,999	77.70	4,428,822.30
ATOS SE	12,632	78.18	987,569.76
CAPGEMINI SE	20,746	119.05	2,469,811.30
DASSAULT SYSTEMES SA	16,878	163.95	2,767,148.10
SAP SE	128,827	126.90	16,348,146.30
WIRED CARD AG	15,509	140.60	2,180,565.40
WORLDLINE SA	12,405	67.60	838,578.00
INGENICO GROUP	8,222	100.85	829,188.70
NOKIA OYJ	725,911	3.67	2,668,085.88
CELLNEX TELECOM SA	32,861	43.85	1,440,954.85
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	434,695	14.80	6,433,486.00
ELISA OYJ	19,132	53.22	1,018,205.04
ILIAS SA	3,853	115.10	443,480.30
KONINKLIJKE KPN NV	471,015	2.73	1,288,226.02
ORANGE	258,836	13.09	3,388,163.24
PROXIMUS	19,845	25.72	510,413.40
TELECOM ITALIA SPA	1,162,736	0.50	586,367.76

TELECOM ITALIA-RSP	800,899	0.49	395,163.56	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	122,426	2.76	338,997.59	
TELEFONICA SA	603,239	6.11	3,690,616.20	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	17,522	30.00	525,660.00	
E.ON SE	294,203	10.45	3,076,774.97	
EDF	83,416	11.47	957,198.60	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	338,616	4.30	1,457,064.64	
ENAGAS SA	33,339	24.13	804,470.07	
ENDESA SA	41,913	24.65	1,033,155.45	
ENEL SPA	1,072,381	7.81	8,384,947.03	
ENGIE	237,011	15.71	3,723,442.81	
FORTUM OYJ	56,561	22.68	1,282,803.48	
IBERDROLA SA	810,671	9.88	8,014,293.50	
NATURGY ENERGY GROUP SA	40,831	23.47	958,303.57	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	57,318	18.36	1,052,645.07	
RWE AG	76,433	31.92	2,439,741.36	
SNAM SPA	261,877	4.87	1,277,436.00	
SUEZ	44,041	14.92	657,311.92	
TERNA SPA	181,560	6.32	1,147,822.32	
UNIPER SE	26,733	29.78	796,108.74	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	72,232	26.99	1,949,541.68	
VERBUND AG	9,803	47.00	460,741.00	
ASML HOLDING NV	55,846	270.65	15,114,719.90	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	162,519	22.00	3,576,230.59	
STMICROELECTRONICS NV	89,436	27.74	2,480,954.64	
ユーロ 小計	25,669,877		554,882,776.73 (66,752,398,040)	
合 計	145,202,017		580,880,722,594 (580,880,722,594)	

(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	14,839	2,443,389.74	
		AMERICAN TOWER CORP	58,125	13,805,850.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	18,137	3,977,988.21	
		BOSTON PROPERTIES INC	19,906	2,826,851.06	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	12,789	1,420,090.56	
		CROWN CASTLE INTL CORP	54,562	8,178,843.80	

DIGITAL REALTY TRUST INC	27,274	3,498,163.24		
DUKE REALTY CORP	47,068	1,699,154.80		
EQUINIX INC	11,126	6,586,146.96		
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,485	1,620,718.80		
EQUITY RESIDENTIAL	48,072	3,978,438.72		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,500	2,630,495.00		
EXTRA SPACE STORAGE INC	16,454	1,825,242.22		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,022	1,300,955.82		
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	64,139	2,373,143.00		
HOST HOTELS & RESORTS INC	97,217	1,660,466.36		
INVITATION HOMES INC	70,170	2,199,127.80		
IRON MOUNTAIN INC	37,384	1,179,465.20		
KIMCO REALTY CORP	55,108	1,121,447.80		
LIBERTY PROPERTY TRUST	20,305	1,316,982.30		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	65,182	1,460,076.80		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,082	2,065,630.72		
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	22,060	1,246,610.60		
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28,885	1,250,431.65		
PROLOGIS INC	82,845	7,965,546.75		
PUBLIC STORAGE	20,341	4,565,944.27		
REALTY INCOME CORP	41,685	3,215,164.05		
REGENCY CENTERS CORP	22,106	1,410,031.21		
SIMON PROPERTY GROUP INC	40,299	5,836,101.18		
SL GREEN REALTY CORP	10,901	1,017,717.36		
SUN COMMUNITIES INC	12,147	1,919,954.82		
UDR INC	38,912	1,874,780.16		
VENTAS INC	47,907	2,818,368.81		
VEREIT INC	141,388	1,371,463.60		
VICI PROPERTIES INC	62,234	1,658,536.10		
VORNADO REALTY TRUST	22,429	1,509,695.99		
WELLTOWER INC	53,670	4,666,606.50		
WEYERHAEUSER CO	98,720	3,013,921.60		
WP CAREY INC	21,791	1,837,852.94		
アメリカドル合計		1,562,266	116,347,396.50 (12,688,847,062)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,000	682,560.00
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	25,600	558,080.00
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	13,800	301,530.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,400	614,880.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,000	225,190.00
カナダドル合計		80,800	2,382,240.00 (197,582,985)	

オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	142,178	1,801,395.26		
		GOODMAN GROUP	216,736	3,255,374.72		
		GPT GROUP	259,201	1,542,245.95		
		MIRVAC GROUP	507,400	1,765,752.00		
		SCENTRE GROUP	722,072	2,830,522.24		
		STOCKLAND	324,334	1,631,400.02		
		VICINITY CENTRES	451,643	1,156,206.08		
オーストラリアドル合計			2,623,564	13,982,896.27		
				(1,038,929,192)		
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	123,528	729,062.25		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	89,539	868,528.30		
		SEGRO PLC	141,374	1,294,703.09		
イギリスピンド合計			354,441	2,892,293.64		
				(412,180,766)		
香港ドル	投資証券	LINK REIT	277,500	22,644,000.00		
香港ドル合計			277,500	22,644,000.00		
				(317,695,320)		
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	385,600	1,214,640.00		
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	354,800	759,272.00		
		CAPITALAND MALL TRUST	335,700	879,534.00		
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	298,700	725,841.00		
		SUNTEC REIT	302,900	563,394.00		
シンガポールドル合計			1,677,700	4,142,681.00		
				(333,900,088)		
ユーロ	投資証券	COVIVIO	5,818	628,344.00		
		GECINA SA	6,101	1,032,899.30		
		ICADE	4,014	399,192.30		
		KLEPIERRE	26,224	855,689.12		
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,815	2,351,580.00		
ユーロ合計			59,972	5,267,704.72		
				(633,704,877)		
合計				15,622,840,290		
				(15,622,840,290)		

(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 611銘柄	96.94%		67.50%
	投資証券 39銘柄		3.06%	2.13%

カナダドル	株式	85銘柄	99.10%		3.63%
	投資証券	5銘柄		0.90%	0.03%
オーストラリアドル	株式	61銘柄	93.01%		2.32%
	投資証券	7銘柄		6.99%	0.17%
イギリスポンド	株式	93銘柄	98.81%		5.76%
	投資証券	3銘柄		1.19%	0.07%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.00%		3.40%
香港ドル	株式	35銘柄	95.41%		1.11%
	投資証券	1銘柄		4.59%	0.05%
シンガポールドル	株式	20銘柄	87.78%		0.40%
	投資証券	5銘柄		12.22%	0.06%
ニュージーランドドル	株式	8銘柄	100.00%		0.10%
スウェーデンクローネ	株式	32銘柄	100.00%		0.96%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.00%		0.22%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.00%		0.68%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%		0.12%
ユーロ	株式	236銘柄	99.06%		11.19%
	投資証券	5銘柄		0.94%	0.11%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

[令和2年1月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	4,677,161,207
コール・ローン	654,103,564
株式	111,258,394,599
投資証券	253,246,699
未収入金	7,271,895
未収配当金	120,483,629
差入委託証拠金	888,181,608
流動資産合計	117,858,843,201
資産合計	117,858,843,201
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	83,786,936

[令和2年1月27日現在]

未払金	22,630
未払解約金	451,241,267
未払利息	282
流動負債合計	535,051,115
負債合計	535,051,115
純資産の部	
元本等	
元本	44,614,707,261
剰余金	
剰余金又は欠損金()	72,709,084,825
元本等合計	117,323,792,086
純資産合計	117,323,792,086
負債純資産合計	117,858,843,201

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。 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本となる重要な事項	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)

	[令和2年1月27日現在]
1. 期首	平成31年1月29日
期首元本額	33,164,110,297円
期中追加設定元本額	18,342,032,320円
期中一部解約元本額	6,891,435,356円
元本の内訳	
MAXIS全世界株式(オール・カントリー)上場投信	20,595,101円
eMAXIS 新興国株式インデックス	12,331,984,822円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,517,630,850円
eMAXIS バランス(波乗り型)	480,081,029円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	316,661,993円
コアバランス	215,423円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,102,632,310円

	[令和2年1月27日現在]
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	9,772,741,331円
つみたて新興国株式	1,574,724,838円
つみたて8資産均等バランス	806,636,110円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	556,635円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,003,294円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,135,230円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	657,698,597円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	187,516,384円
eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー)	680,148,864円
新興国株式インデックス・オープン(ラップ向け)	8,493,354円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	10,040,864,720円
新興国株式インデックスオープン	378,946,068円
eMAXIS 全世界株式インデックス	459,713,094円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	1,036,757,063円
新興国株式インデックスファンド(ラップ向け)	1,404,471円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	21,139,593円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	108,532,390円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	90,731,088円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	370,807,216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)	1,556,950,177円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	10,359,416円
MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定)	77,045,800円
合計	44,614,707,261円
2. 受益権の総数	44,614,707,261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 平成31年 1月29日 至 令和2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づいております。

区分	自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に 係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用してあります。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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <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</p> <p>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</p> <p>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あります。</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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和2年1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,860,264,054
投資証券	7,841,221
合計	8,852,422,833

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,998,364,345		5,915,332,605
	合計	5,998,364,345		5,915,332,605
				83,031,740

(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

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	298,448,696	297,693,500	755,196
	合計	298,448,696	297,693,500	755,196

(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。
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はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

		[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額		2,6297円
(1万口当たり純資産額)		(26,297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-SPON ADR	865,782	7.61	6,588,601.02	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	156,900	0.79	124,107.90	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	63,168	106.80	6,746,342.40	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	15,124	193.00	2,918,932.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	194,430	7.65	1,488,483.26	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,147,000	0.77	890,697.45	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	1,155,100	0.59	681,509.00	
	TATNEFT PJSC	244,892	12.85	3,147,214.13	
	TRANSNEFT PJSC	93	2,853.90	265,412.78	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	29,046	9.66	280,584.36	
	ALROSA PJSC	412,460	1.46	602,815.98	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	35,491	13.23	469,545.93	
	MAGNITOGORS-SPON REGS	29,002	9.59	278,129.18	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	10,156	342.20	3,475,481.61	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	201,380	2.34	471,613.97	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	19,869	12.85	255,316.65	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	8,265	59.95	495,486.75	

SEVERSTAL PJSC	36,910	15.44	570,026.60	
SOUTHERN COPPER CORP	13,577	39.85	541,043.45	
51JOB INC-ADR	4,511	80.83	364,624.13	
BEST INC - ADR	29,200	6.08	177,536.00	
DP WORLD PLC	24,786	14.27	353,696.22	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	54,163	22.61	1,224,625.43	
NIO INC - ADR	103,136	4.66	480,613.76	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	20,804	32.31	672,177.24	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	23,359	124.61	2,910,764.99	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	63,224	46.68	2,951,296.32	
YUM CHINA HOLDINGS INC	58,816	44.25	2,602,608.00	
58.COM INC-ADR	14,914	62.59	933,467.26	
AUTOHOME INC-ADR	9,607	81.44	782,394.08	
BAIDU INC - SPON ADR	45,400	130.00	5,902,000.00	
HUYA INC-ADR	9,100	18.15	165,165.00	
IQIYI INC-ADR	21,913	21.89	479,675.57	
JOYY INC	9,251	59.29	548,491.79	
MOMO INC-SPON ADR	23,726	30.05	712,966.30	
NETEASE INC-ADR	11,684	328.15	3,834,104.60	
SINA CORP	9,420	39.80	374,916.00	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	15,367	12.82	197,004.94	
WEIBO CORP-SPON ADR	9,514	43.56	414,429.84	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	276,981	213.75	59,204,688.75	
BAOZUN INC-SPN ADR	6,264	32.40	202,953.60	
JD.COM INC-ADR	121,208	39.55	4,793,776.40	
PINDUODUO INC-ADR	32,506	37.34	1,213,774.04	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	77,608	31.90	2,475,695.20	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	69,270	13.58	940,686.60	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	59,062	13.97	825,391.45	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	20,174	35.50	716,177.00	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	10,867	23.48	255,157.16	
BANCO MACRO SA-ADR	7,567	30.29	229,204.43	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	236,821	5.33	1,262,255.93	
CREDICORP LTD	11,371	217.47	2,472,851.37	
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	16,593	13.99	232,136.07	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	437,396	17.18	7,516,650.26	
VTB BANK PJSC	538,880,000	0.00	417,739.77	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	228,310	1.82	416,682.91	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	5,699	36.06	205,505.94	
QUDIAN INC-SPON ADR	30,091	3.21	96,592.11	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	196,860	0.94	186,229.56	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	10,391	52.33	543,761.03	

GLOBANT SA	5,502	124.18	683,238.36	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	88,816	10.77	956,548.32	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	21,480	11.38	244,442.40	
INTER RAO UES PJSC	5,999,000	0.09	569,716.03	
アメリカドル 小計	552,050,377		143,035,756.58 (15,599,479,612)	
イギリスポンド POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	33,359	12.66	422,324.94	
イギリスポンド 小計	33,359		422,324.94 (60,185,527)	
香港ドル CHINA COAL ENERGY CO-H	317,000	2.85	903,450.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	278,000	12.20	3,391,600.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,220,000	4.48	18,905,600.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	578,500	14.74	8,527,090.00	
CNOOC LTD	2,934,000	13.04	38,259,360.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	236,000	3.37	795,320.00	
PETROCHINA CO LTD-H	3,541,000	3.73	13,207,930.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	280,000	6.35	1,778,000.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	566,000	2.40	1,358,400.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	206,500	54.75	11,305,875.00	
BBMG CORP-H	416,000	2.26	940,160.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	304,000	4.30	1,307,200.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	540,000	3.25	1,755,000.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	608,000	8.54	5,192,320.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	444,000	9.72	4,315,680.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	284,400	2.87	816,228.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	255,000	9.87	2,516,850.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	247,000	6.10	1,506,700.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	232,000	2.99	693,680.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	248,000	8.29	2,055,920.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	531,000	2.17	1,152,270.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	155,500	8.90	1,383,950.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,054,000	3.78	3,984,120.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	406,000	3.45	1,400,700.00	
BOC AVIATION LTD	41,200	72.55	2,989,060.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	732,000	5.87	4,296,840.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	404,000	5.91	2,387,640.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	278,500	36.80	10,248,800.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	165,000	10.94	1,805,100.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	339,000	8.15	2,762,850.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	562,000	4.68	2,630,160.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	306,000	7.04	2,154,240.00	
CITIC LTD	990,000	9.66	9,563,400.00	

CRRC CORP LTD - H	817,550	5.51	4,504,700.50	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	457,000	11.52	5,264,640.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	118,000	18.52	2,185,360.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	467,000	1.67	779,890.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	428,000	2.51	1,074,280.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	123,000	14.58	1,793,340.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	191,500	4.61	882,815.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	116,000	15.70	1,821,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	302,800	14.76	4,469,328.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	117,200	8.82	1,033,704.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	84,200	27.40	2,307,080.00	
ZOMLION HEAVY INDUSTRY - H	219,400	6.24	1,369,056.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	59,250	29.20	1,730,100.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	603,111	5.88	3,546,292.68	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	186,000	27.65	5,142,900.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	166,000	9.00	1,494,000.00	
AIR CHINA LTD-H	280,000	6.72	1,881,600.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	310,000	6.41	1,987,100.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	240,000	3.79	909,600.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	258,000	13.28	3,426,240.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	280,000	4.66	1,304,800.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	440,500	3.07	1,352,335.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	248,000	6.09	1,510,320.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	194,000	10.40	2,017,600.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	106,000	10.50	1,113,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	190,000	17.22	3,271,800.00	
SINOTRANS LIMITED-H	358,000	2.69	963,020.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	238,000	6.91	1,644,580.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	262,000	4.31	1,129,220.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	474,000	7.05	3,341,700.00	
BYD CO LTD-H	103,500	46.20	4,781,700.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	440,000	6.40	2,816,000.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	79,600	24.65	1,962,140.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	834,000	13.44	11,208,960.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	489,000	5.67	2,772,630.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	464,945	8.67	4,031,073.15	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	158,000	6.24	985,920.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	180,000	73.05	13,149,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	492,000	2.81	1,382,520.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	196,000	24.70	4,841,200.00	
LI NING CO LTD	313,000	25.75	8,059,750.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	125,400	111.60	13,994,640.00	

CHINA EAST EDUCATION HOLDING	66,500	15.86	1,054,690.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	81,000	10.78	873,180.00
HAIDLALO INTERNATIONAL HOLDI	56,000	29.70	1,663,200.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	2,400,000	1.27	3,048,000.00
CHINA LITERATURE LTD	39,200	34.20	1,340,640.00
TENCENT HOLDINGS LTD	938,400	385.80	362,034,720.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,572,000	0.78	1,226,160.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	167,500	102.30	17,135,250.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	93,500	29.95	2,800,325.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	393,500	9.46	3,722,510.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	348,000	4.19	1,458,120.00
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	0.42	156,240.00
CHINA MENNIU DAIRY CO	457,000	31.55	14,418,350.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	248,000	38.25	9,486,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	336,000	6.00	2,016,000.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	310,000	14.14	4,383,400.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	62,000	47.25	2,929,500.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	204,000	8.47	1,727,880.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	778,000	6.89	5,360,420.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	75,000	45.90	3,442,500.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	124,500	62.10	7,731,450.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	578,000	10.76	6,219,280.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	48,100	69.85	3,359,785.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	344,000	9.91	3,409,040.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	115,900	14.98	1,736,182.00
SINOPHARM GROUP CO-H	186,400	27.65	5,153,960.00
3SBIO INC	189,000	11.00	2,079,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	212,000	11.66	2,471,920.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	235,000	7.74	1,818,900.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	302,000	3.92	1,183,840.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	780,000	18.70	14,586,000.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	154,000	17.60	2,710,400.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	70,000	28.10	1,967,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	141,500	31.30	4,428,950.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	222,500	5.69	1,266,025.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	83,500	22.75	1,899,625.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,162,000	11.48	13,339,760.00
SSY GROUP LTD	224,000	7.82	1,751,680.00
WUXI APPTEC CO LTD-H	23,460	102.00	2,392,920.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	95,000	104.50	9,927,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	4,882,000	3.20	15,622,400.00
BANK OF CHINA LTD-H	12,977,000	3.20	41,526,400.00

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,432,900	5.28	7,565,712.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,416,000	4.38	6,202,080.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,731,550	6.43	101,153,866.50
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	439,000	3.54	1,554,060.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	646,550	39.90	25,797,345.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,118,320	5.82	6,508,622.40
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	361,000	3.85	1,389,850.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	10,663,350	5.62	59,928,027.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,244,000	5.13	6,381,720.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,315,000	1.73	2,274,950.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	140,000	13.14	1,839,600.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	521,500	4.28	2,232,020.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2,000,000	1.16	2,320,000.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	250,000	14.92	3,730,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	356,000	16.72	5,952,320.00
FAR EAST HORIZON LTD	373,000	7.50	2,797,500.00
GF SECURITIES CO LTD-H	227,800	9.49	2,161,822.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	131,400	13.90	1,826,460.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	521,200	8.33	4,341,596.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	303,800	13.38	4,064,844.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,221,000	20.60	25,152,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	439,200	28.60	12,561,120.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	783,000	1.23	963,090.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	249,400	18.12	4,519,128.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	130,900	32.10	4,201,890.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,366,000	3.08	4,207,280.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,172,000	9.12	10,688,640.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	918,000	94.85	87,072,300.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	60,200	28.10	1,691,620.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	214,000	11.14	2,383,960.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	189,000	11.40	2,154,600.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	319,000	18.88	6,022,720.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	844,000	5.70	4,810,800.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	630,000	26.95	16,978,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	456,000	34.20	15,595,200.00
CHINA VANKE CO LTD-H	236,751	30.05	7,114,367.55
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	492,000	5.85	2,878,200.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,254,232	10.94	13,721,298.08
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	211,200	12.86	2,716,032.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	406,000	3.65	1,481,900.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	209,000	10.78	2,253,020.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	200,000	13.14	2,628,000.00

LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	279,500	34.65	9,684,675.00
SEAZEN GROUP LTD	276,000	8.38	2,312,880.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	542,000	2.91	1,577,220.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	181,500	27.35	4,964,025.00
SHUI ON LAND LTD	717,000	1.72	1,233,240.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	497,500	3.09	1,537,275.00
SOHO CHINA LTD	317,500	3.09	981,075.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	401,000	41.45	16,621,450.00
WHARF HOLDINGS LTD	200,000	20.80	4,160,000.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,056,000	1.69	1,784,640.00
YUZHOU PROPERTIES CO	336,000	4.00	1,344,000.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	228,000	5.07	1,155,960.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	370,000	9.14	3,381,800.00
KINGSOFT CORP LTD	127,000	25.05	3,181,350.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	143,000	18.06	2,582,580.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	124,000	62.50	7,750,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	126,000	17.54	2,210,040.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	237,000	4.17	988,290.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	108,000	23.45	2,532,600.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	183,500	9.10	1,669,850.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	54,900	16.34	897,066.00
LENOVO GROUP LTD	1,266,000	5.63	7,127,580.00
SUNNY OPTICAL TECH	118,000	141.00	16,638,000.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,296,800	13.34	17,299,312.00
ZTE CORP-H	143,531	28.00	4,018,868.00
CHINA MOBILE LTD	1,004,500	69.70	70,013,650.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	2,184,000	3.16	6,901,440.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,078,000	1.75	12,386,500.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	954,000	6.80	6,487,200.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	78,000	36.40	2,839,200.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	812,000	3.88	3,150,560.00
CGN POWER CO LTD-H	1,617,000	2.05	3,314,850.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	313,200	32.35	10,132,020.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	562,000	5.01	2,815,620.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	705,000	1.64	1,156,200.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	140,000	44.90	6,286,000.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	316,000	11.30	3,570,800.00
DATANG INTL POWER GEN CO-H	558,000	1.47	820,260.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	132,900	96.15	12,778,335.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	512,000	16.58	8,488,960.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	286,000	2.87	820,820.00
HUANENG POWER INTL INC-H	668,000	4.11	2,745,480.00

HUANENG RENEWABLES CORP-H	722,000	3.19	2,303,180.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	570,000	6.73	3,836,100.00	
TOWNGAS CHINA CO LTD	212,000	5.28	1,119,360.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	89,000	21.25	1,891,250.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	474,900	16.14	7,664,886.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	518,000	6.07	3,144,260.00	
香港ドル 小計	149,046,500		1,666,260,696.86 (23,377,637,576)	
マレーシアリンクス	DIALOG GROUP BHD	567,680	3.29	1,867,667.20
	PETRONAS DAGANGAN BHD	56,300	23.14	1,302,782.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	385,800	6.92	2,669,736.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	241,700	5.10	1,232,670.00
	GAMUDA BHD	282,700	4.04	1,142,108.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	97,000	9.85	955,450.00
	IJM CORP BHD	457,600	2.29	1,047,904.00
	SIME DARBY BERHAD	493,200	2.25	1,109,700.00
	AIRASIA GROUP BHD	215,200	1.56	335,712.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	158,300	6.83	1,081,189.00
	MISC BHD	228,100	8.12	1,852,172.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	148,400	4.06	602,504.00
	GENTING BHD	340,400	5.82	1,981,128.00
	GENTING MALAYSIA BHD	464,100	3.15	1,461,915.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	17,300	11.14	192,722.00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	24,500	33.00	808,500.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	39,200	10.74	421,008.00
	IOI CORP BHD	316,100	4.58	1,447,738.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	82,600	23.46	1,937,796.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	11,500	146.10	1,680,150.00
	PPB GROUP BERHAD	87,840	18.62	1,635,580.80
	QL RESOURCES BHD	101,400	8.17	828,438.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	319,700	5.28	1,688,016.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	230,000	6.03	1,386,900.00
	IHH HEALTHCARE BHD	356,100	5.79	2,061,819.00
	TOP GLOVE CORP BHD	236,400	5.54	1,309,656.00
	AMMB HOLDINGS BHD	271,500	3.83	1,039,845.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	767,700	5.06	3,884,562.00
	HONG LEONG BANK BERHAD	124,600	16.14	2,011,044.00
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	33,300	16.40	546,120.00
	MALAYAN BANKING BHD	627,200	8.53	5,350,016.00
	PUBLIC BANK BERHAD	518,500	19.18	9,944,830.00
	RHB BANK BHD	253,249	5.85	1,481,506.65

AXIATA GROUP BERHAD	443,000	4.23	1,873,890.00	
DIGI.COM BHD	486,900	4.48	2,181,312.00	
MAXIS BHD	393,200	5.50	2,162,600.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	214,800	4.00	859,200.00	
PETRONAS GAS BHD	137,800	16.40	2,259,920.00	
TENAGA NASIONAL BHD	522,900	12.88	6,734,952.00	
YTL CORP BHD	348,763	0.98	341,787.74	
マレーシアリンクット 小計	11,102,532		74,712,546.39	
			(2,007,526,121)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	768,500	11.00	8,453,500.00
	IRPC PCL - NVDR	2,038,500	3.02	6,156,270.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	218,400	128.50	28,064,400.00
	PTT PCL-NVDR	1,880,400	45.25	85,088,100.00
	THAI OIL PCL-NVDR	171,100	53.00	9,068,300.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	293,000	28.25	8,277,250.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	353,961	50.50	17,875,030.50
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	131,450	363.00	47,716,350.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	716,100	71.50	51,201,150.00
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	1,300,300	11.10	14,433,330.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,056,500	13.70	14,474,050.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	413,900	33.50	13,865,650.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	952,201	15.40	14,663,895.40
	ROBINSON PCL-NVDR	75,800	68.50	5,192,300.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	171,500	41.25	7,074,375.00
	CP ALL PCL-NVDR	963,300	73.50	70,802,550.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	636,600	30.50	19,416,300.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	110,500	46.50	5,138,250.00
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	552,100	14.60	8,060,660.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,606,300	26.00	41,763,800.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	67,000	144.50	9,681,500.00
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	72,800	147.50	10,738,000.00
	KASIKORN BANK PCL-NVDR	288,100	141.00	40,622,100.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	533,400	16.50	8,801,100.00
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	136,500	99.75	13,615,875.00
	TMB BANK PCL-NVDR	3,393,200	1.52	5,157,664.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	101,300	66.25	6,711,125.00
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	106,300	74.00	7,866,200.00
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	398,900	62.75	25,030,975.00
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	1,350,100	9.75	13,163,475.00
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	201,100	223.00	44,845,300.00
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	366,200	60.50	22,155,100.00
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	118,000	47.50	5,605,000.00

TRUE CORP PCL-NVDR	2,045,076	3.98	8,139,402.48	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	111,700	65.25	7,288,425.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	48,000	330.00	15,840,000.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	274,600	44.50	12,219,700.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	104,500	93.75	9,796,875.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	83,200	198.50	16,515,200.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	149,400	73.50	10,980,900.00	
	24,359,788		771,559,427.38	
タイバーツ 小計			(2,739,035,967)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	342,280	52.95	18,123,726.00
	AYALA CORPORATION	44,435	740.00	32,881,900.00
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	15,054	791.00	11,907,714.00
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	504,030	77.00	38,810,310.00
	SM INVESTMENTS CORP	37,890	1,032.00	39,102,480.00
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	189,020	132.50	25,045,150.00
	JOLLIBEE FOODS CORP	63,750	217.00	13,833,750.00
	UNIVERSAL ROBINA CORP	140,800	162.00	22,809,600.00
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	135,691	82.25	11,160,584.75
	BDO UNIBANK INC	310,170	156.00	48,386,520.00
	METROPOLITAN BANK & TRUST	286,156	64.55	18,471,369.80
	SECURITY BANK CORP	42,090	190.00	7,997,100.00
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,266,500	3.35	7,592,775.00
	AYALA LAND INC	1,163,120	41.40	48,153,168.00
	MEGAWORLD CORP	1,793,000	4.28	7,674,040.00
	ROBINSONS LAND CO	304,700	28.30	8,623,010.00
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,713,300	40.80	69,902,640.00
	GLOBE TELECOM INC	6,260	2,004.00	12,545,040.00
	PLDT INC	14,760	1,061.00	15,660,360.00
	ABOITIZ POWER CORP	249,500	33.30	8,308,350.00
	MANILA ELECTRIC COMPANY	34,020	302.40	10,287,648.00
		9,656,526		477,277,235.55
フィリピンペソ 小計			(1,026,146,056)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	2,113,600	1,380.00	2,916,768,000.00
	BUKIT ASAM TBK PT	590,500	2,370.00	1,399,485,000.00
	UNITED TRACTORS TBK PT	264,700	20,200.00	5,346,940,000.00
	BARITO PACIFIC TBK PT	4,174,300	1,375.00	5,739,662,500.00
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	438,900	7,975.00	3,500,227,500.00
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	310,600	18,825.00	5,847,045,000.00
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	228,200	10,675.00	2,436,035,000.00
	SEMENT INDONESIA PERSERO TBK	483,200	12,975.00	6,269,520,000.00
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	281,200	5,075.00	1,427,090,000.00
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,402,400	6,975.00	23,731,740,000.00

ACE HARDWARE INDONESIA	1,063,000	1,630.00	1,732,690,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,216,000	7,175.00	8,724,800,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	74,000	58,300.00	4,314,200,000.00	
HM SAMPOERNA TBK PT	1,631,300	2,160.00	3,523,608,000.00	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	385,700	11,700.00	4,512,690,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	743,900	8,200.00	6,099,980,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,240,000	8,175.00	10,137,000,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	3,583,600	1,540.00	5,518,744,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,631,600	34,050.00	55,555,980,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,132,100	7,925.00	24,821,892,500.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,196,600	7,700.00	9,213,820,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	9,175,400	4,740.00	43,491,396,000.00	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	580,600	2,070.00	1,201,842,000.00	
BUMI SERPONG DAMAI PT	975,000	1,185.00	1,155,375,000.00	
PAKUWON JATI TBK PT	2,557,200	570.00	1,457,604,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	8,172,300	3,920.00	32,035,416,000.00	
XL AXIATA TBK PT	514,700	3,190.00	1,641,893,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	1,707,300	1,880.00	3,209,724,000.00	
インドネシアルピア 小計		51,867,900	276,963,167,500.00	
			(2,243,401,656)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	2,384,468	7.85	18,718,073.80
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	587,970	52.71	30,991,898.70
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	22,650	199.78	4,525,017.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	162,298	47.01	7,629,628.98
	ALFA S.A.B.-A	471,800	15.19	7,166,642.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	72,700	71.76	5,216,952.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	55,000	239.83	13,190,650.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	37,250	376.85	14,037,662.50
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	38,620	207.00	7,994,340.00
	ALSEA SAB DE CV	100,300	45.53	4,566,659.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	378,700	45.34	17,170,258.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	51,600	74.00	3,818,400.00
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	26,000	101.37	2,635,620.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	861,400	56.84	48,961,976.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	69,266	105.85	7,331,806.10
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	86,100	118.16	10,173,576.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	318,400	175.86	55,993,824.00
	GRUMA S.A.B.-B	36,160	207.01	7,485,481.60
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	261,600	33.52	8,768,832.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	251,900	39.38	9,919,822.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	425,600	114.44	48,705,664.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	370,700	24.23	8,982,061.00

	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	5,482,100	15.67	85,904,507.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	99,300	88.45	8,783,085.00	
	メキシコペソ 小計	12,651,882		438,672,436.68	
				(2,539,913,408)	
ブラジルレアル	COSAN SA	25,300	80.57	2,038,421.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	488,300	31.11	15,191,013.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	688,600	29.30	20,175,980.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	116,600	27.53	3,209,998.00	
	BRASKEM SA-PREF A	32,300	37.63	1,215,449.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	96,700	14.91	1,441,797.00	
	GERDAU SA-PREF	187,000	21.67	4,052,290.00	
	KLABIN SA - UNIT	117,400	21.76	2,554,624.00	
	SUZANO SA	85,822	43.87	3,765,011.14	
	VALE SA	518,830	53.80	27,913,054.00	
	EMBRAER SA	112,600	18.55	2,088,730.00	
	WEG SA	144,244	41.43	5,976,028.92	
	CCR SA	194,300	19.82	3,851,026.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	101,713	51.41	5,229,065.33	
	RUMO SA	186,900	24.33	4,547,277.00	
	COGNA EDUCACAO	227,592	11.67	2,655,998.64	
	B2W CIA DIGITAL	31,900	74.25	2,368,575.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	120,861	28.95	3,498,925.95	
	LOJAS AMERICANAS SA-RTS	66	9.40	620.40	
	LOJAS RENNER S.A.	131,720	60.17	7,925,592.40	
	MAGAZINE LUIZA SA	115,700	56.15	6,496,555.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	110,300	29.59	3,263,777.00	
	ATACADAQ SA	74,700	23.66	1,767,402.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	25,000	88.70	2,217,500.00	
	RAIA DROGASIL SA	39,800	124.00	4,935,200.00	
	AMBEV SA	772,700	18.99	14,673,573.00	
	BRF SA	90,100	33.83	3,048,083.00	
	JBS SA	187,300	29.30	5,487,890.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	107,400	49.18	5,281,932.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	35,500	64.50	2,289,750.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	78,900	70.65	5,574,285.00	
	HYPERA SA	60,800	35.03	2,129,824.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	201,392	32.87	6,619,755.04	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	655,253	34.35	22,507,940.55	
	BANCO DO BRASIL S.A.	143,800	50.80	7,305,040.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	65,100	43.88	2,856,588.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	791,330	34.24	27,095,139.20	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	730,907	13.35	9,757,608.45	

B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	337,575	48.99	16,537,799.25	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	37,200	78.35	2,914,620.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	111,800	35.90	4,013,620.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	110,700	42.82	4,740,174.00	
PORTO SEGURO SA	15,400	65.01	1,001,154.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	45,858	66.78	3,062,397.24	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	127,554	18.74	2,390,361.96	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,300	35.13	1,591,389.00	
CIELO SA	207,121	7.00	1,449,847.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	70,675	59.94	4,236,259.50	
TIM PARTICIPACOES SA	129,277	16.39	2,118,850.03	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	48,100	42.38	2,038,478.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	41,500	40.75	1,691,125.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	140,773	15.44	2,173,535.12	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	53,600	62.47	3,348,392.00	
ENERGISA SA-UNITS	28,600	56.32	1,610,752.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	31,050	53.87	1,672,663.50	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	134,500	24.43	3,285,835.00	
ブラジルレアル 小計		9,611,313		312,884,571.62 (8,156,900,782)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	63,010	7,300.00	459,973,000.00
	EMPRESAS CMPC SA	188,413	1,930.00	363,637,090.00
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	20,422	22,552.00	460,556,944.00
	LATAM AIRLINES GROUP SA	49,335	6,710.00	331,037,850.00
	S.A.C.I. FALABELLA	119,154	3,190.10	380,113,175.00
	CENCOSUD SA	220,327	1,029.30	226,782,581.00
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,576	7,031.20	158,736,371.00
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	57,088	2,125.00	121,312,000.00
	BANCO DE CHILE	7,458,500	78.63	586,461,855.00
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	7,487	33,900.00	253,809,300.00
	BANCO SANTANDER CHILE	10,115,356	41.58	420,596,502.00
	ITAU CORPBANCA	33,365,954	3.95	131,795,518.00
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	26,107	5,380.00	140,455,660.00
	AGUAS ANDINAS SA-A	472,237	307.00	144,976,759.00
	COLBUN SA	1,351,330	120.20	162,429,866.00
韓国ウォン	ENEL AMERICAS SA	6,428,395	157.79	1,014,336,447.00
	ENEL CHILE SA	4,608,336	76.60	352,998,537.00
	チリペソ 小計		64,574,027	5,710,009,455.00 (800,543,325)
	GS HOLDINGS	7,782	48,350.00	376,259,700.00
	S-OIL CORP	6,898	80,900.00	558,048,200.00
	SK INNOVATION CO LTD	8,740	130,000.00	1,136,200,000.00

HANWHA SOLUTIONS CORP	16,472	19,150.00	315,438,800.00
HYUNDAI STEEL CO	11,824	29,550.00	349,399,200.00
KCC CORP	745	223,500.00	166,507,500.00
KOREA ZINC CO LTD	1,364	407,000.00	555,148,000.00
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2,964	76,100.00	225,560,400.00
LG CHEM LTD	7,540	348,500.00	2,627,690,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,367	191,500.00	261,780,500.00
LOTTE CHEMICAL CORP	2,697	209,000.00	563,673,000.00
OCI CO LTD	3,326	63,000.00	209,538,000.00
POSCO	12,880	240,500.00	3,097,640,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,967	60,700.00	240,796,900.00
CJ CORP	2,103	90,000.00	189,270,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	4,507	85,100.00	383,545,700.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	26,032	4,670.00	121,569,440.00
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	6,507	25,900.00	168,531,300.00
DOOSAN BOBCAT INC	8,098	31,550.00	255,491,900.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	10,115	30,300.00	306,484,500.00
HANWHA CORPORATION	5,451	23,500.00	128,098,500.00
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	4,074	23,550.00	95,942,700.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	12,475	40,650.00	507,108,750.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	1,547	303,000.00	468,741,000.00
KCC GLASS CORP	700	45,900.00	32,130,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	12,156	32,300.00	392,638,800.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,186	125,000.00	773,250,000.00
LG CORP	16,572	73,500.00	1,218,042,000.00
LOTTE CORP	3,952	38,900.00	153,732,800.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	7,531	17,700.00	133,298,700.00
SAMSUNG C&T CORP	14,709	117,000.00	1,720,953,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	25,856	18,300.00	473,164,800.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	68,511	7,160.00	490,538,760.00
SK HOLDINGS CO LTD	5,974	241,000.00	1,439,734,000.00
S-1 CORPORATION	3,669	92,600.00	339,749,400.00
CJ LOGISTICS	1,801	142,000.00	255,742,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	3,021	156,000.00	471,276,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	9,503	25,400.00	241,376,200.00
PAN OCEAN CO LTD	39,939	4,275.00	170,739,225.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	11,667	30,800.00	359,343,600.00
HANON SYSTEMS	29,646	11,150.00	330,552,900.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	11,015	251,500.00	2,770,272,500.00
HYUNDAI MOTOR CO	24,668	130,500.00	3,219,174,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	5,828	84,500.00	492,466,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	3,585	76,800.00	275,328,000.00

KIA MOTORS CORP	44,488	43,400.00	1,930,779,200.00
FILA HOLDINGS CORP	7,687	46,000.00	353,602,000.00
HLB INC	5,063	102,600.00	519,463,800.00
LG ELECTRONICS INC	16,775	69,000.00	1,157,475,000.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	8,149	88,500.00	721,186,500.00
KANGWON LAND INC	19,369	28,600.00	553,953,400.00
CHEIL WORLDWIDE INC	9,543	22,550.00	215,194,650.00
KAKAO CORP	7,989	165,500.00	1,322,179,500.00
NAVER CORP	22,974	183,000.00	4,204,242,000.00
NCSOFT CORP	2,801	646,000.00	1,809,446,000.00
NETMARBLE CORP	3,875	96,400.00	373,550,000.00
PEARL ABYSS CORP	1,102	193,300.00	213,016,600.00
CJ ENM CO LTD	1,662	151,000.00	250,962,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	5,157	97,000.00	500,229,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	2,000	87,500.00	175,000,000.00
LOTTE SHOPPING CO	2,198	130,000.00	285,740,000.00
SHINSEGAE INC	1,181	306,500.00	361,976,500.00
BGF RETAIL CO LTD	1,349	174,000.00	234,726,000.00
E-MART INC	3,358	118,000.00	396,244,000.00
GS RETAIL CO LTD	4,031	40,800.00	164,464,800.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,305	249,500.00	325,597,500.00
KT&G CORP	19,648	93,500.00	1,837,088,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,816	108,500.00	414,036,000.00
OTTOGI CORPORATION	187	535,000.00	100,045,000.00
AMOREPACIFIC CORP	5,136	212,500.00	1,091,400,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,222	97,700.00	119,389,400.00
AMOREPACIFIC GROUP	4,695	83,200.00	390,624,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,562	1,349,000.00	2,107,138,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	343	806,000.00	276,458,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,681	55,200.00	423,991,200.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD-NEW	384	55,200.00	21,196,800.00
CELLTRION INC	14,828	175,500.00	2,602,314,000.00
CELLTRION INC-NEW	707	175,500.00	124,078,500.00
HANMI PHARM CO LTD	1,079	294,500.00	317,765,500.00
HELIXMITH CO LTD	3,150	80,300.00	252,945,000.00
MEDY-TOX INC	645	331,800.00	214,011,000.00
MEDY-TOX INC-NEW	19	331,800.00	6,304,200.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,879	483,000.00	1,390,557,000.00
YUHAN CORP	1,398	227,000.00	317,346,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,834	7,240.00	353,558,160.00
HANA FINANCIAL GROUP	50,783	35,100.00	1,782,483,300.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	40,182	11,100.00	446,020,200.00

KB FINANCIAL GROUP INC	65,307	46,700.00	3,049,836,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	78,365	41,200.00	3,228,638,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	76,859	10,800.00	830,077,200.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	7,906	74,200.00	586,625,200.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	58,500	3,530.00	206,505,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	62,472	7,560.00	472,288,320.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	20,867	11,950.00	249,360,650.00	
SAMSUNG CARD CO	4,545	38,350.00	174,300,750.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	9,939	38,100.00	378,675,900.00	
DB INSURANCE CO LTD	7,371	44,500.00	328,009,500.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	39,802	2,215.00	88,161,430.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	10,238	23,100.00	236,497,800.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	5,352	225,000.00	1,204,200,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	11,024	73,300.00	808,059,200.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	5,535	205,000.00	1,134,675,000.00	
KMW CO LTD	3,900	60,100.00	234,390,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	36,816	14,850.00	546,717,600.00	
LG INNOTEK CO LTD	2,514	152,500.00	383,385,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,573	134,500.00	1,287,568,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	781,538	60,800.00	47,517,510,400.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	134,522	50,300.00	6,766,456,600.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	9,181	283,500.00	2,602,813,500.00	
LG UPLUS CORP	16,739	13,700.00	229,324,300.00	
SK TELECOM	3,276	237,000.00	776,412,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,174	26,400.00	1,166,193,600.00	
KOREA GAS CORPORATION	3,688	34,950.00	128,895,600.00	
SK HYNIX INC	89,547	98,700.00	8,838,288,900.00	
韓国ウォン 小計	2,456,748		143,173,611,235.00 (13,372,415,289)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	192,150	96.90	18,619,335.00
	ASIA CEMENT CORP	342,281	48.70	16,669,084.70
	CHINA STEEL CORP	1,968,947	24.05	47,353,175.35
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	588,430	88.20	51,899,526.00
	FORMOSA PLASTICS CORP	732,600	99.00	72,527,400.00
	NAN YA PLASTICS CORP	852,557	72.80	62,066,149.60
	TAIWAN CEMENT	837,563	44.95	37,648,456.85
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	19,000	520.00	9,880,000.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	503,138	29.40	14,792,257.20
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	36,405	330.50	12,031,852.50
	CHINA AIRLINES LTD	405,000	8.98	3,636,900.00
	EVA AIRWAYS CORP	335,365	13.60	4,560,964.00
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	439,883	12.95	5,696,484.85

TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	372,000	38.95	14,489,400.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	322,413	42.25	13,621,949.25
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	31,728	402.50	12,770,520.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	54,318	190.00	10,320,420.00
FORMOSA TAFFETA CO.	201,000	34.40	6,914,400.00
GIANT MANUFACTURING	49,000	194.00	9,506,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	28,000	285.00	7,980,000.00
POU CHEN	348,500	38.80	13,521,800.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	45,600	72.10	3,287,760.00
TATUNG CO LTD	297,000	21.65	6,430,050.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	48,000	702.00	33,696,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	90,000	308.00	27,720,000.00
STANDARD FOODS CORP	61,023	70.90	4,326,530.70
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	802,624	75.40	60,517,849.60
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	980,563	22.45	22,013,639.35
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	3,066,955	22.90	70,233,269.50
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,757,106	29.30	51,483,205.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,719,816	24.55	42,221,482.80
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,359,878	22.45	30,529,261.10
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,817,754	32.35	58,804,341.90
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,678,018	13.50	22,653,243.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,528,316	14.70	22,466,245.20
TAIWAN BUSINESS BANK	905,859	12.75	11,549,702.25
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,544,824	21.50	33,213,716.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	532,000	53.10	28,249,200.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	189,478	142.50	27,000,615.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,566,321	20.65	32,344,528.65
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,305,366	43.10	56,261,274.60
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,225,255	9.84	21,896,509.20
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	455,056	26.00	11,831,456.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,117,087	47.10	52,614,797.70
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,666,852	10.40	17,335,260.80
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	118,000	47.10	5,557,800.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	108,720	45.45	4,941,324.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	93,000	174.00	16,182,000.00
ACER INC	432,168	18.05	7,800,632.40
ADVANTECH CO LTD	55,676	314.50	17,510,102.00
ASUSTEK COMPUTER INC	113,774	236.00	26,850,664.00
AU OPTRONICS CORP	1,428,000	10.55	15,065,400.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	103,000	254.50	26,213,500.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	101,766	88.50	9,006,291.00
COMPAL ELECTRONICS	667,775	19.10	12,754,502.50

DELTA ELECTRONICS INC	310,220	152.50	47,308,550.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	163,042	65.90	10,744,467.80	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,042,272	92.30	188,501,705.60	
INNOLUX CORP	1,324,112	9.34	12,367,206.08	
INVENTEC CORP	385,429	22.90	8,826,324.10	
LARGAN PRECISION CO LTD	16,820	4,975.00	83,679,500.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	328,160	50.00	16,408,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	109,000	93.80	10,224,200.00	
PEGATRON CORP	309,976	68.00	21,078,368.00	
QUANTA COMPUTER INC	434,150	65.00	28,219,750.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	237,193	38.80	9,203,088.40	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	50,000	232.00	11,600,000.00	
WISTRON CORP	438,865	29.40	12,902,631.00	
WIWYNN CORP	12,000	721.00	8,652,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	258,168	39.00	10,068,552.00	
YAGEO CORPORATION	43,952	415.50	18,262,056.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	87,000	134.50	11,701,500.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	629,000	109.50	68,875,500.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	291,000	70.70	20,573,700.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	255,400	108.50	27,710,900.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	580,294	79.00	45,843,226.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	35,000	420.00	14,700,000.00	
MEDIATEK INC	248,236	419.00	104,010,884.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	189,000	85.20	16,102,800.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	89,000	230.50	20,514,500.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	30,000	354.00	10,620,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	111,300	111.50	12,409,950.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	80,703	260.50	21,023,131.50	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,031,000	333.00	1,342,323,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,752,000	16.05	28,119,600.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	147,000	79.30	11,657,100.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	53,000	286.00	15,158,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	460,000	19.20	8,832,000.00	
ニュー台湾ドル 小計		54,175,200	3,615,290,420.83 (13,123,504,227)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	102,078	466.10	47,578,555.80
	COAL INDIA LTD	194,070	193.95	37,639,876.50
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	105,207	244.80	25,754,673.60
	INDIAN OIL CORP LTD	296,005	119.65	35,416,998.25
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	399,371	118.35	47,265,557.85
	PETRONET LNG LTD	102,670	276.80	28,419,056.00
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	466,512	1,521.55	709,821,333.60

AMBUJA CEMENTS LTD	95,207	215.95	20,559,951.65
ASIAN PAINTS LTD	46,234	1,786.80	82,610,911.20
BERGER PAINTS INDIA LTD	34,748	559.75	19,450,193.00
GRASIM INDUSTRIES LTD	46,550	822.00	38,264,100.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	185,563	205.40	38,114,640.20
JSW STEEL LTD	140,009	271.90	38,068,447.10
PIDILITE INDUSTRIES LTD	20,574	1,457.60	29,988,662.40
SHREE CEMENT LTD	1,459	23,134.65	33,753,454.35
TATA STEEL LTD	54,834	483.40	26,506,755.60
ULTRATECH CEMENT LTD	17,710	4,642.75	82,223,102.50
UPL LTD	82,468	543.30	44,804,864.40
VEDANTA LTD	332,594	155.90	51,851,404.60
ASHOK LEYLAND LTD	170,035	86.50	14,708,027.50
HAVELLS INDIA LTD	39,680	622.90	24,716,672.00
LARSEN & TOUBRO LTD	80,836	1,359.20	109,872,291.20
SIEMENS LTD	10,672	1,624.95	17,341,466.40
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	93,749	384.75	36,069,927.75
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	32,335	561.35	18,151,252.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	15,619	1,501.50	23,451,928.50
BAJAJ AUTO LTD	13,088	3,074.15	40,234,475.20
BHARAT FORGE LTD	31,725	522.05	16,562,036.25
BOSCH LTD	1,518	15,022.45	22,804,079.10
EICHER MOTORS LTD	2,111	20,930.80	44,184,918.80
HERO MOTOCORP LTD	15,121	2,468.65	37,328,456.65
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	132,320	567.75	75,124,680.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	17,749	7,128.45	126,522,859.05
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	151,457	145.10	21,976,410.70
TATA MOTORS LTD	251,394	186.50	46,884,981.00
PAGE INDUSTRIES LTD	814	26,214.50	21,338,603.00
TITAN CO LTD	48,992	1,227.85	60,154,827.20
INFO EDGE INDIA LTD	10,000	2,708.05	27,080,500.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	115,713	280.80	32,492,210.40
AVENUE SUPERMARTS LTD	20,053	1,948.60	39,075,275.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,690	3,192.50	27,742,825.00
ITC LTD	576,344	238.15	137,256,323.60
NESTLE INDIA LTD	3,825	15,755.50	60,264,787.50
UNITED SPIRITS LTD	45,340	578.10	26,211,054.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	9,453	1,514.35	14,315,150.55
DABUR INDIA LTD	83,270	500.50	41,676,635.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	57,116	749.35	42,799,874.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	106,671	2,073.70	221,203,652.70
MARICO LTD	72,645	340.55	24,739,254.75

AUROBINDO PHARMA LTD	42,092	501.10	21,092,301.20	
CIPLA LTD	52,150	458.85	23,929,027.50	
DIVI'S LABORATORIES LTD	13,924	1,910.50	26,601,802.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,575	3,031.40	56,308,255.00	
LUPIN LTD	35,473	740.15	26,255,340.95	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	15,111	1,675.40	25,316,969.40	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	146,320	447.80	65,522,096.00	
AXIS BANK LTD	342,662	737.40	252,678,958.80	
BANDHAN BANK LTD	60,000	481.85	28,911,000.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	268,161	2,450.75	657,195,570.75	
ICICI BANK LTD	782,177	533.85	417,565,191.45	
LIC HOUSING FINANCE LTD	50,241	462.15	23,218,878.15	
STATE BANK OF INDIA	304,088	324.05	98,539,716.40	
BAJAJ FINANCE LTD	29,292	4,194.50	122,865,294.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	6,400	3,209.50	20,540,800.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	45,001	368.90	16,600,868.90	
REC LTD	126,676	141.45	17,918,320.20	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	26,516	1,083.90	28,740,692.40	
BAJAJ FINSERV LTD	5,992	9,633.75	57,725,430.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	89,500	607.25	54,348,875.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	29,789	1,350.35	40,225,576.15	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	51,500	519.95	26,777,425.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	55,300	999.80	55,288,940.00	
DLF LTD	87,825	262.85	23,084,801.25	
HCL TECHNOLOGIES LTD	182,809	607.70	111,093,029.30	
INFOSYS LTD	559,029	782.75	437,579,949.75	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	147,641	2,183.40	322,359,359.40	
TECH MAHINDRA LTD	82,058	787.30	64,604,263.40	
WIPRO LTD	186,814	247.60	46,255,146.40	
BHARTI AIRTEL LTD	401,097	524.25	210,275,102.25	
BHARTI INFRATEL LTD	49,169	244.30	12,011,986.70	
GAIL INDIA LTD	299,000	129.50	38,720,500.00	
NTPC LTD	375,308	114.75	43,066,593.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	322,242	196.95	63,465,561.90	
TATA POWER CO LTD	168,974	61.20	10,341,208.80	
インドルピー 小計		10,401,104	6,437,402,806.45	
			(9,913,600,321)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	12,401	804.00	9,970,404.00
	MONETA MONEY BANK AS	79,528	85.40	6,791,691.20
	CEZ AS	25,889	518.00	13,410,502.00
チェココルナ 小計		117,818	30,172,597.20	
			(144,225,014)	

コロンビアペソ	ECOPETROL SA	788,773	3,290.00	2,595,063,170.00	
	GRUPO ARGOS SA	41,950	17,960.00	753,422,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	39,604	43,900.00	1,738,615,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	75,283	45,800.00	3,447,961,400.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	647,007	1,440.00	931,690,080.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	38,050	32,860.00	1,250,323,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	72,705	19,380.00	1,409,022,900.00	
コロンビアペソ 小計		1,703,372		12,126,098,150.00	
				(392,885,580)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	65,456	2,710.00	177,385,760.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	22,681	6,580.00	149,240,980.00	
	OTP BANK PLC	37,595	14,740.00	554,150,300.00	
ハンガリーフォリント 小計		125,732		880,777,040.00	
				(314,965,869)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	444,785	7.97	3,544,936.45	
	DUBAI ISLAMIC BANK	283,746	5.78	1,640,051.88	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	447,951	15.78	7,068,666.78	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	624,020	2.22	1,385,324.40	
	EMAAR MALLS PJSC	427,406	1.83	782,152.98	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	620,849	4.11	2,551,689.39	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	276,549	16.50	4,563,058.50	
アラブディルハム 小計		3,125,306		21,535,880.38	
				(640,477,082)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	15,889	85.86	1,364,229.54	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	46,819	85.52	4,003,960.88	
	POLSKIE GORNICZTWO NAFTOWE I	280,587	4.06	1,139,183.22	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	22,065	97.36	2,148,248.40	
	CCC SA	4,541	91.20	414,139.20	
	LPP SA	201	8,585.00	1,725,585.00	
	AMREST HOLDINGS SE	10,699	47.00	502,853.00	
	CD PROJEKT SA	10,531	276.00	2,906,556.00	
	CYFRONY POLSAT SA	37,162	27.40	1,018,238.80	
	DINO POLSKA SA	7,855	161.80	1,270,939.00	
	BANK MILLENNIUM SA	121,585	6.04	734,373.40	
	BANK PEKAO SA	30,038	100.50	3,018,819.00	
	MBANK SA	2,305	379.00	873,595.00	
	PKO BANK POLSKI SA	149,420	35.72	5,337,282.40	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	5,432	292.00	1,586,144.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	101,801	41.49	4,223,723.49	
	ORANGE POLSKA SA	110,607	7.31	808,537.17	
	PGE SA	148,359	7.44	1,103,790.96	
		1,105,896		34,180,198.46	

ポーランドズロチ 小計

(966,274,210)

南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	37,964	129.06	4,899,633.84
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	8,667	1,192.27	10,333,404.09
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	69,523	293.42	20,399,438.66
	GOLD FIELDS LTD	129,576	91.41	11,844,542.16
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	135,814	135.50	18,402,797.00
	KUMBA IRON ORE LTD	10,081	381.07	3,841,566.67
	NORTHAM PLATINUM LTD	54,301	122.45	6,649,157.45
	SASOL LTD	93,516	264.50	24,734,982.00
	SIBANYE GOLD LTD	361,532	38.29	13,843,060.28
	BIDVEST GROUP LTD	45,518	221.24	10,070,402.32
	MULTICHOICE GROUP LTD	68,777	113.08	7,777,303.16
	MR PRICE GROUP LTD	41,305	182.62	7,543,119.10
	NASPERS LTD-N SHS	71,794	2,467.09	177,122,259.46
	PEPKOR HOLDINGS LTD	123,600	16.72	2,066,592.00
	THE FOSCHINI GROUP LTD	38,539	149.01	5,742,696.39
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	156,954	47.65	7,478,858.10
	BID CORP LTD	57,179	348.00	19,898,292.00
	CLICKS GROUP LTD	45,897	258.25	11,852,900.25
	PICK N PAY STORES LTD	55,770	66.54	3,710,935.80
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	72,826	122.50	8,921,185.00
	SPAR GROUP LIMITED/THE	32,210	204.03	6,571,806.30
	TIGER BRANDS LTD	26,414	210.00	5,546,940.00
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	230,622	25.33	5,841,655.26
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	61,227	117.09	7,169,069.43
	ABSA GROUP LTD	114,597	140.17	16,063,061.49
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,335	1,392.00	10,210,320.00
	NEDBANK GROUP LTD	58,739	203.51	11,953,973.89
	STANDARD BANK GROUP LTD	214,346	163.55	35,056,288.30
	FIRSTRAND LTD	554,259	60.40	33,477,243.60
	INVESTEC LTD	45,380	86.48	3,924,462.40
	PSG GROUP LTD	23,181	222.80	5,164,726.80
	REINET INVESTMENTS SCA	22,698	304.65	6,914,945.70
	REMGRO LTD	90,785	189.59	17,211,928.15
	RMB HOLDINGS LTD	121,022	76.99	9,317,483.78
	DISCOVERY LTD	63,437	125.29	7,948,021.73
	LIBERTY HOLDINGS LTD	22,169	109.68	2,431,495.92
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN	144,183	21.20	3,056,679.60
	OLD MUTUAL LTD	834,929	18.00	15,028,722.00
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	139,332	28.66	3,993,255.12
	SANLAM LTD	299,817	76.87	23,046,932.79
	NEPI ROCKCASTLE PLC	62,781	125.26	7,863,948.06

	MTN GROUP LTD	283,981	82.48	23,422,752.88	
	TELKOM SA SOC LTD	41,282	32.25	1,331,344.50	
	VODACOM GROUP LTD	104,225	120.80	12,590,380.00	
	南アフリカランド 小計	5,278,084		652,270,563.43	
				(4,931,165,459)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	57,700	6.31	364,087.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	242,225	4.94	1,196,591.50	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	41,728	17.28	721,059.84	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	26,000	5.92	153,920.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	64,500	3.25	209,625.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	7.19	301,980.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	154,000	5.64	868,560.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	79,200	8.39	664,488.00	
	SHANDONG XINCHAO ENERGY CO-A	64,800	2.04	132,192.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	28,400	6.70	190,280.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	39,000	7.79	303,810.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	29,900	5.58	166,842.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	36.98	336,518.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	21,055	9.68	203,812.40	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	124,400	3.30	410,520.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	50,680	3.03	153,560.40	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	38,000	48.00	1,824,000.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	176,396	5.43	957,830.28	
	BBMG CORPORATION-A	79,100	3.40	268,940.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	14,200	27.17	385,814.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	33,200	10.00	332,000.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	168,001	4.12	692,164.12	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	34,500	10.14	349,830.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	10,308	43.37	447,057.96	
	GEM CO LTD-A	39,400	5.77	227,338.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	28,700	9.21	264,327.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	55,700	17.07	950,799.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	27,037	13.72	370,947.64	
	HESTEEL CO LTD-A	100,800	2.41	242,928.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	12,900	21.40	276,060.00	
	HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	40,200	4.43	178,086.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	433,400	1.25	541,750.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	80,316	2.92	234,522.72	
	JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	2,900	64.52	187,108.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	19,700	15.13	298,061.00	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	25,500	7.29	185,895.00	
	LOMON BILLIONS GROUP CO -A	19,300	16.19	312,467.00	

LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD-A	13,900	9.66	134,274.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	56,600	2.84	160,744.00
NANJING IRON & STEEL CO-A	42,100	3.23	135,983.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	81,700	2.62	214,054.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	39,900	11.50	458,850.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	23,300	8.46	197,118.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	24,660	32.47	800,710.20
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,500	18.21	282,255.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	113,700	2.24	254,688.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	9,200	24.55	225,860.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	24,600	9.29	228,534.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	54,100	3.85	208,285.00
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A	43,700	3.35	146,395.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	16,700	8.10	135,270.00
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	33,900	4.06	137,634.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	84,100	1.47	123,627.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	58,100	3.88	225,428.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	12,800	15.30	195,840.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	10,800	30.82	332,856.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	17,600	14.16	249,216.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	100,100	2.21	221,221.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	30,906	7.10	219,432.60
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	29,800	51.91	1,546,918.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	4,900	46.90	229,810.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	12.50	167,500.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	20,400	6.20	126,480.00
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A	37,900	3.84	145,536.00
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A	30,300	4.71	142,713.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	18,900	12.39	234,171.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	6,400	59.10	378,240.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	15,900	10.56	167,904.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	10,250	47.20	483,800.00
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A	13,600	9.97	135,592.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	26,100	6.97	181,917.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	30,900	13.37	413,133.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	32,700	8.11	265,197.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	164,300	4.29	704,847.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	10,900	12.90	140,610.00
AECC AVIATION POWER CO-A	21,400	21.59	462,026.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	26,300	16.64	437,632.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	34,300	6.84	234,612.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	8,800	29.00	255,200.00

AVICOPTER PLC-A	5,500	44.43	244,365.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	16,100	25.75	414,575.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	25,900	6.14	159,026.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	13,900	14.35	199,465.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	26,000	8.40	218,400.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	43,700	6.29	274,873.00	
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	14,360	9.17	131,681.20	
CHINA MEHECO CO LTD -A	10,200	13.32	135,864.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	46,800	7.02	328,536.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	109,300	9.42	1,029,606.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	177,100	5.56	984,676.00	
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	21,100	10.35	218,385.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	217,404	5.04	1,095,716.16	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	11,200	29.48	330,176.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	398,980	5.47	2,182,420.60	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	20,808	130.57	2,716,900.56	
CRRC CORP LTD-A	231,325	6.76	1,563,757.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	26,100	8.88	231,768.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	9,200	60.30	554,760.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	25,817	11.22	289,666.74	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	10,800	24.95	269,460.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	6,400	36.89	236,096.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	7,100	34.37	244,027.00	
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	16,100	10.61	170,821.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	8,400	50.49	424,116.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	29,200	8.26	241,192.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	169,634	2.69	456,315.46	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	43,900	18.17	797,663.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	121,200	4.07	493,284.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	79,516	16.03	1,274,641.48	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	3.38	285,610.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	77,300	4.85	374,905.00	
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A	7,700	16.18	124,586.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	29,774	5.82	173,284.68	
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A	7,400	16.93	125,282.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15,900	29.25	465,075.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	14,800	15.13	223,924.00	
SINOCHM INTL CORP-A	25,700	5.21	133,897.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	14,700	24.30	357,210.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	25,400	8.68	220,472.00	
TBEA CO LTD-A	35,200	6.36	223,872.00	
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	39,300	3.10	121,830.00	

WEICHAI POWER CO LTD-A	56,851	13.53	769,194.03	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	74,400	5.19	386,136.00	
XIAMEN C & D INC-A	26,900	8.57	230,533.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	32,800	11.77	386,056.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,500	26.66	546,530.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	3,300	69.78	230,274.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	26,241	20.80	545,812.80	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	15,000	12.40	186,000.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	21,000	15.78	331,380.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	5,700	53.46	304,722.00	
ZOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	60,900	6.30	383,670.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	30,000	8.57	257,100.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	15,800	16.20	255,960.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8,800	50.10	440,880.00	
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	13,500	8.79	118,665.00	
AIR CHINA LTD-A	37,800	8.25	311,850.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	88,800	5.10	452,880.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	81,800	6.43	525,974.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	75,100	2.43	182,493.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	61,300	4.75	291,175.00	
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	73,500	1.96	144,060.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	141,289	7.70	1,087,925.30	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	53,800	2.87	154,406.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	19,688	15.34	302,013.92	
JUNYEAO AIRLINES CO LTD-A	15,600	13.20	205,920.00	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	83,600	3.66	305,976.00	
S F HOLDING CO LTD-A	15,500	39.22	607,910.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	9,100	68.98	627,718.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	80,900	5.20	420,680.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	19,500	9.03	176,085.00	
SINOTRANS LIMITED-A	41,600	4.11	170,976.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,700	39.17	340,779.00	
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A	56,400	2.47	139,308.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	14,200	29.66	421,172.00	
BYD CO LTD -A	17,200	59.83	1,029,076.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,600	98.50	256,100.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	37,000	9.88	365,560.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,938	24.59	465,685.42	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	22,600	10.86	245,436.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	29,900	26.70	798,330.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	21.73	268,582.80	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	74,044	22.61	1,674,134.84	

SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	11,400	22.06	251,484.00	
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	26,100	5.90	153,990.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	7,900	18.28	144,412.00	
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	20,800	7.25	150,800.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	28,493	63.94	1,821,842.42	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	57,929	18.57	1,075,741.53	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	32.82	295,380.00	
NAVINFO CO LTD-A	18,600	15.75	292,950.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	2,655	113.00	300,015.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	8,700	19.69	171,303.00	
TCL CORP-A	128,600	5.06	650,716.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	17,100	9.33	159,543.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	70.62	367,224.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	9,400	17.20	161,680.00	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	18,499	82.00	1,516,918.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	6,400	26.05	166,720.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	78,000	7.08	552,240.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	13,802	26.94	371,825.88	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	10.57	294,903.00	
CHINA FILM CO LTD-A	14,700	13.81	203,007.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	17,000	12.24	208,080.00	
CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A	13,000	14.37	186,810.00	
CITIC GUOAN INFORMATION-A	37,200	3.44	127,968.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,502	5.88	820,271.76	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	700	372.50	260,750.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	12,800	18.10	231,680.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	14,110	45.99	648,918.90	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	23,400	10.26	240,084.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	32,600	10.62	346,212.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	12,200	47.49	579,378.00	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	19,800	17.29	342,342.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	20,000	32.41	648,200.00	
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	8,400	27.70	232,680.00	
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	77,600	3.69	286,344.00	
HLA CORP LTD -A	28,000	7.44	208,320.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	14,500	16.33	236,785.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	7.59	233,772.00	
SUNING.COM CO LTD-A	88,480	10.00	884,800.00	
VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A	6,700	17.80	119,260.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	5.05	243,410.00	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	2,700	73.50	198,450.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	3,600	83.00	298,800.00	

YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	91,000	7.57	688,870.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	27.97	218,166.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,600	143.20	515,520.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5,625	51.00	286,875.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	5.85	235,755.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	7,000	52.40	366,800.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	26,800	6.31	169,108.00
CHONGQING BREWERY CO-A	4,600	47.91	220,386.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	7,500	23.55	176,625.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	21,322	107.21	2,285,931.62
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	20.95	205,310.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	15,000	34.05	510,750.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	16,900	9.80	165,620.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	26,200	29.26	766,612.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	57,900	30.64	1,774,056.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	11,890	30.86	366,925.40
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	14,281	107.16	1,530,351.96
JIANGXI ZHENG BANG TECH -A	23,200	13.84	321,088.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	37.86	287,736.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	5,500	38.18	209,990.00
KWEI CHOW MOUTAI CO LTD-A	11,878	1,052.80	12,505,158.40
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	13,900	82.65	1,148,835.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	16,500	81.68	1,347,720.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	40,000	18.14	725,600.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,300	91.68	760,944.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	4,600	51.39	236,394.00
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	11,000	9.96	109,560.00
TOLY BREAD CO LTD-A	5,200	38.33	199,316.00
TONGWEI CO LTD-A	37,000	13.54	500,980.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	48.33	318,978.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	50,450	32.68	1,648,706.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	36,800	126.16	4,642,688.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	12,500	17.97	224,625.00
BY-HEALTH CO LTD-A	15,000	16.80	252,000.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	6,400	28.45	182,080.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	29,425	40.00	1,177,000.00
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	2,700	113.50	306,450.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	3,600	49.48	178,128.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	7,200	29.60	213,120.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	50.45	221,980.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	16,640	20.85	346,944.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	4,000	80.78	323,120.00

JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	9,500	24.41	231,895.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	17,800	16.46	292,988.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,960	31.91	541,193.60	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	14.07	500,329.20	
OVCTEK CHINA INC-A	3,800	52.18	198,284.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	18,300	18.91	346,053.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	3,800	187.68	713,184.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,000	102.50	307,500.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	15,400	15.93	245,322.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	2,200	152.01	334,422.00	
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	9,800	14.20	139,160.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	9,900	31.32	310,068.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	13,000	27.35	355,550.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3,800	73.29	278,502.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	3,800	79.50	302,100.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	1,600	498.00	796,800.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	6,900	38.25	263,925.00	
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	9,900	13.77	136,323.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,300	35.76	332,568.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	12,598	59.59	750,714.82	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	6,200	34.13	211,606.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,400	37.68	504,912.00	
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	13,400	9.07	121,538.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	73.26	519,340.14	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	13,300	36.09	479,997.00	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	7,800	26.06	203,268.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	42,030	87.99	3,698,219.70	
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	11,100	16.33	181,263.00	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	10,700	20.16	215,712.00	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	10.38	190,992.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	37.95	220,110.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	5,700	49.74	283,518.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	10,780	20.79	224,116.20	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	19,200	26.18	502,656.00	
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	9,900	22.80	225,720.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,041	100.22	605,429.02	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	8,200	18.56	152,192.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	11,500	16.23	186,645.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	13,600	25.00	340,000.00	
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	14,300	15.66	223,938.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,300	12.16	234,688.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	14,680	28.22	414,269.60	

MUXI APPTEC CO LTD-A	13,900	95.79	1,331,481.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	11,700	17.90	209,430.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,100	86.60	1,047,860.00
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	5,800	128.79	746,982.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	25,300	6.07	153,571.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	12,600	17.49	220,374.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	20,400	23.57	480,828.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	5,000	48.38	241,900.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	708,100	3.52	2,492,512.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	200,800	5.42	1,088,336.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	34,393	8.68	298,531.24
BANK OF CHINA LTD-A	333,900	3.61	1,205,379.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	373,033	5.47	2,040,490.51
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	30,480	8.87	270,357.60
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	48,700	9.17	446,579.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	109,620	6.95	761,859.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	80,600	8.27	666,562.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	53,411	26.93	1,438,358.23
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	134,969	8.91	1,202,573.79
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	53,900	5.82	313,698.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	91,200	6.97	635,664.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	378,310	4.02	1,520,806.20
CHINA MERCHANTS BANK-A	195,999	36.81	7,214,723.19
CHINA MINSHENG BANKING-A	336,928	6.08	2,048,522.24
HUAXIA BANK CO LTD-A	121,750	7.40	900,950.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	512,528	5.72	2,931,660.16
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	197,374	18.59	3,669,182.66
JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A	26,000	8.34	216,840.00
PING AN BANK CO LTD-A	163,161	15.54	2,535,521.94
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	278,937	11.35	3,165,934.95
ANXIN TRUST CO LTD-A	52,000	3.68	191,360.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	85,300	4.54	387,262.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	58,800	3.46	203,448.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	34,125	10.82	369,232.50
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	52,500	6.88	361,200.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	54,300	18.75	1,018,125.00
CITIC SECURITIES CO-A	93,445	23.90	2,233,335.50
CSC FINANCIAL CO LTD-A	26,300	33.90	891,570.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	12.27	321,474.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	63,831	15.08	962,571.48
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	37,200	12.40	461,280.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	33,200	7.70	255,640.00

FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	78,300	8.04	629,532.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	56,200	14.81	832,322.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	39,000	12.30	479,700.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	71,400	17.57	1,254,498.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	8.69	277,211.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	76,830	14.55	1,117,876.50	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,130	109.05	559,426.50	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	34,400	6.97	239,768.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	69,840	18.94	1,322,769.60	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	24,900	10.60	263,940.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	63,600	6.80	432,480.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	31,300	12.74	398,762.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	22,200	8.63	191,586.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	56,800	10.29	584,472.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	64,800	3.52	228,096.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	33,500	13.96	467,660.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	40,000	4.65	186,000.00	
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD-A	15,400	9.09	139,986.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	26,900	7.92	213,048.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	214,214	4.82	1,032,511.48	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	28,700	8.83	253,421.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	28,500	9.14	260,490.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	5.07	272,259.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	33,200	9.25	307,100.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	26,400	10.57	279,048.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	26,400	32.26	851,664.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	59,700	35.96	2,146,812.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	47,000	6.48	304,560.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	19,786	47.99	949,530.14	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	102,922	83.49	8,592,957.78	
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	24,500	7.42	181,790.00	
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	38,700	4.56	176,472.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	28,500	26.40	752,400.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	75,223	18.13	1,363,792.99	
CHINA VANKE CO LTD -A	92,356	28.98	2,676,476.88	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	28,300	7.50	212,250.00	
GEMDALE CORP-A	42,900	13.17	564,993.00	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	31,100	6.34	197,174.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	77,200	6.49	501,028.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	35,200	9.29	327,008.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	50,700	7.14	361,998.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	32,901	4.57	150,357.57	

POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	113,000	15.33	1,732,290.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	41,300	9.06	374,178.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	21,500	34.00	731,000.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	14,800	14.50	214,600.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPM-A	28,600	6.87	196,482.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	81,700	3.51	286,767.00
YANGO GROUP CO LTD-A	38,500	7.17	276,045.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	12,800	24.57	314,496.00
AISINO CORP-A	17,800	22.90	407,620.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	8,400	37.56	315,504.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	14,700	21.20	311,640.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	4,700	72.30	339,810.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	14,100	22.71	320,211.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	29,500	13.92	410,640.00
GLODON CO LTD-A	10,700	40.00	428,000.00
HUNDSON TECHNOLOGIES INC-A	7,730	88.69	685,573.70
IFLYTEK CO LTD - A	21,000	35.19	738,990.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	9,900	18.67	184,833.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,200	154.00	492,800.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	54,860	3.16	173,357.60
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	8,000	37.62	300,960.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	8,200	20.53	168,346.00
VENUSTECH GROUP INC-A	8,500	39.19	333,115.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	23,200	8.20	190,240.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	23,550	32.56	766,788.00
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	6,400	29.55	189,120.00
AVIC JONHON Optronics TECH-A	10,000	37.37	373,700.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	321,800	4.72	1,518,896.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	16,597	23.21	385,216.37
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	27,800	14.18	394,204.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	8,600	41.65	358,190.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	11,100	26.00	288,600.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	37,800	20.00	756,000.00
GOERTEK INC -A	30,800	23.61	727,188.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	22,900	10.13	231,977.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	21,800	11.92	259,856.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	88,810	36.00	3,197,160.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	18,000	16.58	298,440.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	29,600	6.10	180,560.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	9,500	12.80	121,600.00
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	17,500	8.22	143,850.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	12,300	34.13	419,799.00

LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	31,100	20.68	643,148.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	24,200	7.56	182,952.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	54,200	12.96	702,432.00	
LUXSHARE PRECISION INDSTR-A	50,780	45.15	2,292,717.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	118.50	521,400.00	
NINESTAR CORP-A	10,100	39.00	393,900.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	25,700	17.92	460,544.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	21,600	24.32	525,312.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	3,200	177.49	567,968.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	9,200	44.00	404,800.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	15,300	28.70	439,110.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	19,400	16.54	320,876.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	5,700	55.84	318,288.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	16,120	33.06	532,927.20	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	13,800	19.77	272,826.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	8,000	25.72	205,760.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	8,900	31.07	276,523.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	16,400	23.97	393,108.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	8,400	43.99	369,516.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	4,700	82.08	385,776.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,500	20.12	573,420.00	
ZTE CORP-A	32,600	39.17	1,276,942.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	295,000	5.65	1,666,750.00	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	28,400	4.45	126,380.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	123,205	4.85	597,544.25	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	209,064	17.15	3,585,447.60	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	186,400	2.22	413,808.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	64,400	3.54	227,976.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	45,200	5.41	244,532.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	41,300	3.83	158,179.00	
INNER MONGOLIA MENDIAN HU-A	55,000	2.54	139,700.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	64,500	8.16	526,320.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	24,800	7.46	185,008.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	46,600	5.54	258,164.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	31,300	5.91	184,983.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	41,800	9.11	380,798.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	48,300	5.89	284,487.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	3,100	283.00	877,300.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	12,500	16.95	211,875.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	34,434	29.05	1,000,307.70	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	38,800	22.56	875,328.00	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	3,600	338.06	1,217,016.00	

	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	26,500	15.68	415,520.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	13,000	15.50	201,500.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,500	185.55	1,020,525.00	
	オフショア元 小計	20,699,756		268,098,538.85 (4,206,466,074)	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	32,700	20.48	669,696.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	169,158	34.30	5,802,119.40	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	23,559	49.30	1,161,458.70	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	48,940	12.90	631,326.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	53,660	17.70	949,782.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	26,773	77.10	2,064,198.30	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	67,788	43.50	2,948,778.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	123,354	89.80	11,077,189.20	
	SAUDI CEMENT	11,200	69.00	772,800.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	32,930	24.26	798,881.80	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	144,273	10.16	1,465,813.68	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	36,397	52.90	1,925,401.30	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	9,776	102.40	1,001,062.40	
	JARIR MARKETING CO	9,650	166.40	1,605,760.00	
	ALMARAI CO	40,211	47.80	1,922,085.80	
	SAVOLA	43,587	34.70	1,512,468.90	
	AL RAJHI BANK	200,010	65.50	13,100,655.00	
	ALINMA BANK	117,581	25.85	3,039,468.85	
	ARAB NATIONAL BANK	94,867	27.30	2,589,869.10	
	BANK AL-JAZIRA	60,000	15.22	913,200.00	
	BANK ALBILAD	60,225	27.05	1,629,086.25	
	BANQUE SAUDI FRANSI	85,881	38.20	3,280,654.20	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	197,749	46.70	9,234,878.30	
	RIYAD BANK	205,560	24.20	4,974,552.00	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	167,067	30.05	5,020,363.35	
	SAUDI BRITISH BANK	113,863	34.25	3,899,807.75	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	4,120	104.00	428,480.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	9,150	78.20	715,530.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	79,020	9.70	766,494.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	57,120	10.28	587,193.60	
	ETIHAD ETISALAT CO	62,514	26.80	1,675,375.20	
	SAUDI TELECOM CO	67,131	92.60	6,216,330.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	131,232	19.86	2,606,267.52	
	サウジアラビアリヤル 小計	2,587,046		96,987,027.20 (2,823,292,361)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	20,156	119.60	2,410,657.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	214,954	9.62	2,067,857.48	

ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	55,382	22.94	1,270,463.08	
KOC HOLDING AS	117,731	20.86	2,455,868.66	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	26,912	28.60	769,683.20	
TURK HAVA YOLLARI AO	86,226	14.54	1,253,726.04	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	14,221	74.10	1,053,776.10	
ARCELIK AS	29,629	21.94	650,060.26	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	67,016	50.30	3,370,904.80	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	27,231	26.00	708,006.00	
AKBANK T.A.S.	446,303	8.76	3,909,614.28	
TURKIYE GARANTİ BANKASI	374,684	11.97	4,484,967.48	
TURKIYE IS BANKASI-C	268,383	7.33	1,967,247.39	
HACI OMER SABANCI HOLDING	136,771	10.27	1,404,638.17	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	171,892	14.41	2,476,963.72	
トルコリラ 小計	2,057,491		30,254,434.26 (554,866,324)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,079	20.30	184,303.70
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	7,789	19.30	150,327.70
	FF GROUP	5,889	4.80	28,267.20
	OPAP SA	28,965	11.72	339,469.80
	JUMBO SA	16,679	19.46	324,573.34
	ALPHA BANK AE	249,860	1.85	463,490.30
	EUROBANK ERGASIAS SA	410,827	0.90	373,030.91
	NATIONAL BANK OF GREECE	102,627	3.04	312,499.21
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	42,454	13.77	584,591.58
ユーロ 小計	874,169		2,760,553.74 (332,094,614)	
カタールリヤル	QATAR FUEL QSC	67,700	22.61	1,530,697.00
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	610,180	2.26	1,379,006.80
	INDUSTRIES QATAR	251,850	10.27	2,586,499.50
	COMMERCIAL BANK PSQC	335,235	4.94	1,656,060.90
	MASRAF AL RAYAN	604,509	4.14	2,502,667.26
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	110,818	9.40	1,041,689.20
	QATAR ISLAMIC BANK	181,800	16.58	3,014,244.00
	QATAR NATIONAL BANK	737,034	20.70	15,256,603.80
	QATAR INSURANCE CO	225,560	3.20	721,792.00
	BARWA REAL ESTATE CO	334,664	3.60	1,204,790.40
	QOREDOO QPSC	128,720	6.97	897,178.40
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	88,613	16.29	1,443,505.77
カタールリヤル 小計	3,676,683		33,234,735.03 (991,392,145)	
合 計	993,338,609		111,258,394,599 (111,258,394,599)	

(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	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	506,300	16,307,923.00	
メキシコペソ合計			506,300	16,307,923.00 (94,422,874)	
南アフリカランド	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	180,191	3,324,523.95	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	474,804	10,051,600.68	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	1,045,523	7,632,317.90	
南アフリカランド合計			1,700,518	21,008,442.53 (158,823,825)	
		合計		253,246,699 (253,246,699)	

(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 63銘柄	100.00%		13.99%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.00%		0.05%
香港ドル	株式 208銘柄	100.00%		20.96%
マレーシアリンギット	株式 40銘柄	100.00%		1.80%
タイバーツ	株式 40銘柄	100.00%		2.46%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.00%		0.92%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.00%		2.01%
メキシコペソ	株式 24銘柄	96.42%		2.28%
	投資証券 1銘柄		3.58%	0.08%
ブラジルレアル	株式 56銘柄	100.00%		7.31%
チリペソ	株式 17銘柄	100.00%		0.72%
韓国ウォン	株式 114銘柄	100.00%		11.99%
ニュー台湾ドル	株式 88銘柄	100.00%		11.77%
インドルピー	株式 84銘柄	100.00%		8.89%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%		0.13%
コロンビアペソ	株式 7銘柄	100.00%		0.35%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%		0.28%

アラブディルハム	株式	7銘柄	100.00%		0.57%
ポーランドズロチ	株式	18銘柄	100.00%		0.87%
南アフリカランド	株式	44銘柄	96.88%		4.42%
	投資証券	3銘柄		3.12%	0.14%
オフショア元	株式	460銘柄	100.00%		3.77%
サウジアラビアリヤル	株式	33銘柄	100.00%		2.53%
トルコリラ	株式	15銘柄	100.00%		0.50%
ユーロ	株式	9銘柄	100.00%		0.30%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.00%		0.89%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

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)

[令和2年1月27日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,146,614,420
国債証券	526,025,366,850
地方債証券	32,604,803,520
特殊債券	36,212,227,784
社債券	32,091,278,000
派生商品評価勘定	2,355,600
未収入金	9,565,384,700
未収利息	1,149,276,478
前払費用	67,559,265
差入委託証拠金	1,920,000
流動資産合計	642,866,786,617
資産合計	642,866,786,617
負債の部	
流動負債	
前受金	1,280,000
未払金	3,419,693,100
未払解約金	254,393,242
未払利息	2,223
流動負債合計	3,675,368,565
負債合計	3,675,368,565
純資産の部	
元本等	
元本	469,427,501,298
剰余金	
剰余金又は欠損金()	169,763,916,754

[令和2年1月27日現在]

元本等合計	639,191,418,052
純資産合計	639,191,418,052
負債純資産合計	642,866,786,617

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)

	[令和2年1月27日現在]
1. 期首	平成31年1月29日
期首元本額	437,454,298,881円
期中追加設定元本額	157,528,268,732円
期中一部解約元本額	125,555,066,315円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内債券）	125,355,676,674円
eMAXIS 国内債券インデックス	9,962,077,765円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,699,425,274円
eMAXIS バランス（波乗り型）	77,530,817円
コアバランス	1,762,440円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	387,325,466円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	215,063,139円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	86,522,427円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	6,133,809,850円
国内債券セレクション（ラップ向け）	4,142,796,072円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	3,834,641,506円
つみたて8資産均等バランス	1,487,432,407円
つみたて4資産均等バランス	411,732,821円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	3,325,604円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	838,281円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	70,959円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	113,384,113円

	[令和2年1月27日現在]
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	38,210,313円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	17,914,726円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	14,993,243円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	9,482,285,049円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,635,695,544円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	169,738,956円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	2,709,268,887円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	6,632,236,578円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	253,372,348円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	292,632,742円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	72,396,139円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	385,174,288円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	610,144,494円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	376,727,585円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	644,016,767円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	75,829,766円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	12,309,150円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	81,575,095円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,937,444,955円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	1,199,892,335円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	5,118,505,915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)	196,609,389,945円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	552,102,415円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	21,154,430円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	6,285,844円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,030,745,030円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	3,306,982,670円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	17,383,435,443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)	6,735,874,726円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	3,199,553,671円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	211,800,625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)	14,772,292,064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)	1,112,917,353円

	[令和2年1月27日現在]
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)	3,897,895,953円
MUKAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	732,259円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	3,716,181,119円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	17,000,896円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長成長型)VA	31,112,981円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	17,397,175円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	12,575,397円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	99,695,846円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	247,326,463円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	81,862,803円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	167,491,501円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,122,594,354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)	2,040,818,372円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド(成長成長型)	3,848,475,521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)	2,167,766,436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)	1,342,259,516円
合計	469,427,501,298円
2. 受益権の総数	469,427,501,298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 平成31年 1月29日 至 令和2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号) 第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に 係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、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あります。 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。

区分	自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,223,780,420
地方債証券	88,319,679
特殊債券	22,430,263
社債券	223,500
合計	1,113,253,978

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	債券先物取引 買建	608,040,000	610,400,000	2,360,000
	合計	608,040,000	610,400,000	2,360,000

(注) 時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額	1.3616円
(1万口当たり純資産額)	(13,616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397回利付国債(2年)	1,200,000,000	1,202,976,000	
	第398回利付国債(2年)	7,100,000,000	7,118,886,000	
	第399回利付国債(2年)	300,000,000	300,861,000	
	第400回利付国債(2年)	800,000,000	802,456,000	
	第403回利付国債(2年)	1,900,000,000	1,907,011,000	

第407回利付国債(2年)	6,450,000,000	6,479,154,000
第127回利付国債(5年)	3,870,000,000	3,880,797,300
第128回利付国債(5年)	3,850,000,000	3,863,128,500
第129回利付国債(5年)	3,100,000,000	3,112,493,000
第130回利付国債(5年)	4,950,000,000	4,973,017,500
第131回利付国債(5年)	5,010,000,000	5,036,853,600
第132回利付国債(5年)	3,850,000,000	3,873,562,000
第133回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,833,120,000
第134回利付国債(5年)	7,760,000,000	7,818,588,000
第135回利付国債(5年)	3,580,000,000	3,609,356,000
第136回利付国債(5年)	1,400,000,000	1,412,404,000
第137回利付国債(5年)	7,100,000,000	7,167,592,000
第138回利付国債(5年)	5,150,000,000	5,202,427,000
第139回利付国債(5年)	600,000,000	606,372,000
第140回利付国債(5年)	1,960,000,000	1,981,658,000
第141回利付国債(5年)	10,640,000,000	10,761,828,000
第1回利付国債(40年)	475,000,000	735,751,250
第2回利付国債(40年)	870,000,000	1,312,951,800
第3回利付国債(40年)	733,000,000	1,114,863,680
第4回利付国債(40年)	1,098,000,000	1,687,318,560
第5回利付国債(40年)	1,445,000,000	2,155,593,200
第6回利付国債(40年)	1,000,000,000	1,473,400,000
第7回利付国債(40年)	1,240,000,000	1,761,234,000
第8回利付国債(40年)	1,500,000,000	1,999,080,000
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	2,267,141,600
第10回利付国債(40年)	1,420,000,000	1,668,457,400
第11回利付国債(40年)	2,310,000,000	2,637,581,100
第12回利付国債(40年)	1,310,000,000	1,356,622,900
第313回利付国債(10年)	3,469,000,000	3,525,995,670
第314回利付国債(10年)	1,190,000,000	1,206,838,500
第315回利付国債(10年)	3,633,000,000	3,700,864,440
第316回利付国債(10年)	2,280,000,000	2,319,421,200
第317回利付国債(10年)	1,957,000,000	1,996,981,510
第318回利付国債(10年)	2,480,000,000	2,526,574,400
第319回利付国債(10年)	1,719,000,000	1,759,448,070
第320回利付国債(10年)	1,980,000,000	2,022,827,400
第321回利付国債(10年)	2,515,000,000	2,576,793,550
第322回利付国債(10年)	1,470,000,000	1,502,957,400
第323回利付国債(10年)	1,675,000,000	1,717,210,000
第324回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,863,840,000
第325回利付国債(10年)	3,835,000,000	3,931,680,350
第326回利付国債(10年)	730,000,000	748,133,200

第327回利付国債(10年)	2,540,000,000	2,610,485,000
第328回利付国債(10年)	3,700,000,000	3,788,134,000
第329回利付国債(10年)	5,860,000,000	6,050,801,600
第330回利付国債(10年)	3,330,000,000	3,446,516,700
第331回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,089,319,600
第332回利付国債(10年)	5,040,000,000	5,189,032,800
第333回利付国債(10年)	6,550,000,000	6,755,997,500
第334回利付国債(10年)	4,330,000,000	4,474,535,400
第335回利付国債(10年)	4,470,000,000	4,606,916,100
第336回利付国債(10年)	3,880,000,000	4,005,285,200
第337回利付国債(10年)	940,000,000	961,084,200
第338回利付国債(10年)	3,580,000,000	3,682,925,000
第339回利付国債(10年)	5,060,000,000	5,212,660,200
第340回利付国債(10年)	7,650,000,000	7,891,663,500
第341回利付国債(10年)	3,570,000,000	3,666,604,200
第342回利付国債(10年)	11,440,000,000	11,620,752,000
第343回利付国債(10年)	910,000,000	924,678,300
第344回利付国債(10年)	4,410,000,000	4,483,955,700
第345回利付国債(10年)	4,190,000,000	4,262,947,900
第346回利付国債(10年)	5,590,000,000	5,688,775,300
第347回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,175,910,400
第348回利付国債(10年)	5,600,000,000	5,701,640,000
第349回利付国債(10年)	4,690,000,000	4,774,091,700
第350回利付国債(10年)	6,070,000,000	6,177,196,200
第351回利付国債(10年)	4,850,000,000	4,934,147,500
第352回利付国債(10年)	5,490,000,000	5,583,275,100
第353回利付国債(10年)	5,600,000,000	5,692,792,000
第354回利付国債(10年)	5,590,000,000	5,679,999,000
第355回利付国債(10年)	7,950,000,000	8,073,940,500
第356回利付国債(10年)	3,600,000,000	3,654,072,000
第1回利付国債(30年)	76,000,000	96,942,560
第2回利付国債(30年)	98,000,000	122,158,960
第3回利付国債(30年)	117,000,000	145,259,010
第4回利付国債(30年)	127,000,000	167,177,720
第5回利付国債(30年)	108,000,000	134,940,600
第6回利付国債(30年)	169,000,000	216,647,860
第7回利付国債(30年)	164,000,000	209,775,680
第8回利付国債(30年)	142,000,000	173,866,220
第9回利付国債(30年)	116,000,000	136,235,040
第10回利付国債(30年)	185,000,000	210,356,100
第11回利付国債(30年)	137,000,000	166,959,160
第12回利付国債(30年)	220,000,000	280,735,400

第13回利付国債(30年)	205,000,000	259,437,750
第14回利付国債(30年)	493,000,000	653,826,460
第15回利付国債(30年)	346,000,000	465,463,420
第16回利付国債(30年)	302,000,000	407,488,600
第17回利付国債(30年)	327,000,000	438,009,960
第18回利付国債(30年)	427,000,000	567,098,700
第19回利付国債(30年)	303,000,000	403,738,410
第20回利付国債(30年)	495,000,000	676,942,200
第21回利付国債(30年)	379,000,000	508,250,370
第22回利付国債(30年)	570,000,000	784,166,100
第23回利付国債(30年)	554,000,000	764,724,980
第24回利付国債(30年)	411,000,000	569,222,670
第25回利付国債(30年)	742,000,000	1,006,493,320
第26回利付国債(30年)	884,000,000	1,217,374,080
第27回利付国債(30年)	860,000,000	1,206,347,800
第28回利付国債(30年)	911,000,000	1,285,648,750
第29回利付国債(30年)	1,450,000,000	2,030,652,500
第30回利付国債(30年)	1,496,000,000	2,078,946,320
第31回利付国債(30年)	1,358,000,000	1,871,351,160
第32回利付国債(30年)	1,739,000,000	2,443,625,410
第33回利付国債(30年)	1,644,000,000	2,224,052,520
第34回利付国債(30年)	2,116,000,000	2,962,315,360
第35回利付国債(30年)	2,549,000,000	3,479,181,080
第36回利付国債(30年)	1,829,000,000	2,508,363,760
第37回利付国債(30年)	2,157,000,000	2,925,992,070
第38回利付国債(30年)	1,185,000,000	1,588,504,350
第39回利付国債(30年)	1,540,000,000	2,103,855,600
第40回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,642,144,400
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,524,233,000
第42回利付国債(30年)	770,000,000	1,023,014,300
第43回利付国債(30年)	2,450,000,000	3,259,210,500
第44回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,413,510,000
第45回利付国債(30年)	1,180,000,000	1,518,542,000
第46回利付国債(30年)	1,970,000,000	2,537,438,800
第47回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,326,629,600
第48回利付国債(30年)	1,600,000,000	2,026,320,000
第49回利付国債(30年)	2,660,000,000	3,375,167,600
第50回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,243,011,300
第51回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,707,461,200
第52回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,731,230,600
第53回利付国債(30年)	980,000,000	1,046,649,800
第54回利付国債(30年)	2,000,000,000	2,239,720,000

第55回利付国債(30年)	180,000,000	201,504,600
第56回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,186,203,600
第57回利付国債(30年)	2,010,000,000	2,251,280,400
第58回利付国債(30年)	3,520,000,000	3,940,886,400
第59回利付国債(30年)	380,000,000	415,419,800
第60回利付国債(30年)	3,520,000,000	4,039,763,200
第61回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,628,972,300
第63回利付国債(30年)	30,000,000	30,318,900
第64回利付国債(30年)	3,410,000,000	3,441,917,600
第49回利付国債(20年)	515,000,000	528,261,250
第51回利付国債(20年)	200,000,000	205,994,000
第52回利付国債(20年)	214,000,000	221,928,700
第54回利付国債(20年)	480,000,000	501,364,800
第55回利付国債(20年)	241,000,000	252,107,690
第56回利付国債(20年)	449,000,000	472,168,400
第58回利付国債(20年)	147,000,000	155,018,850
第59回利付国債(20年)	589,000,000	620,841,340
第61回利付国債(20年)	289,000,000	299,577,400
第63回利付国債(20年)	442,000,000	471,543,280
第64回利付国債(20年)	441,000,000	474,295,500
第65回利付国債(20年)	318,000,000	343,592,640
第66回利付国債(20年)	500,000,000	538,285,000
第68回利付国債(20年)	846,000,000	929,009,520
第70回利付国債(20年)	422,000,000	469,572,060
第71回利付国債(20年)	160,000,000	176,622,400
第72回利付国債(20年)	534,000,000	590,182,140
第73回利付国債(20年)	620,000,000	685,707,600
第74回利付国債(20年)	318,000,000	353,266,200
第75回利付国債(20年)	575,000,000	642,010,500
第76回利付国債(20年)	200,000,000	221,236,000
第77回利付国債(20年)	210,000,000	233,385,600
第78回利付国債(20年)	410,000,000	455,686,300
第79回利付国債(20年)	50,000,000	55,843,000
第80回利付国債(20年)	315,000,000	353,524,500
第81回利付国債(20年)	350,000,000	392,829,500
第82回利付国債(20年)	662,000,000	746,782,340
第83回利付国債(20年)	413,000,000	468,247,010
第84回利付国債(20年)	670,000,000	755,646,100
第85回利付国債(20年)	490,000,000	558,315,800
第86回利付国債(20年)	515,000,000	593,187,300
第87回利付国債(20年)	450,000,000	515,529,000
第88回利付国債(20年)	804,000,000	931,120,440

第89回利付国債(20年)	410,000,000	472,180,600
第90回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,273,470,000
第91回利付国債(20年)	468,000,000	544,943,880
第92回利付国債(20年)	1,432,000,000	1,656,408,720
第93回利付国債(20年)	390,000,000	450,348,600
第94回利付国債(20年)	615,000,000	714,605,400
第95回利付国債(20年)	1,017,000,000	1,202,338,080
第96回利付国債(20年)	320,000,000	373,536,000
第97回利付国債(20年)	343,000,000	404,698,840
第98回利付国債(20年)	470,000,000	550,915,200
第99回利付国債(20年)	1,345,000,000	1,582,930,500
第100回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,261,103,200
第101回利付国債(20年)	573,000,000	691,123,950
第102回利付国債(20年)	530,000,000	642,126,800
第103回利付国債(20年)	640,000,000	769,984,000
第104回利付国債(20年)	300,000,000	355,854,000
第105回利付国債(20年)	870,000,000	1,035,978,600
第106回利付国債(20年)	711,000,000	852,837,390
第107回利付国債(20年)	567,000,000	677,706,750
第108回利付国債(20年)	800,000,000	941,872,000
第109回利付国債(20年)	800,000,000	944,968,000
第110回利付国債(20年)	1,096,000,000	1,314,761,600
第111回利付国債(20年)	711,000,000	862,762,950
第112回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,613,373,400
第113回利付国債(20年)	1,182,000,000	1,428,955,260
第114回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,843,988,000
第115回利付国債(20年)	1,154,000,000	1,411,445,860
第116回利付国債(20年)	1,546,000,000	1,898,565,300
第117回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,692,839,300
第118回利付国債(20年)	1,076,000,000	1,304,370,240
第119回利付国債(20年)	660,000,000	786,310,800
第120回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,826,011,200
第121回利付国債(20年)	989,000,000	1,192,180,160
第122回利付国債(20年)	760,000,000	908,017,600
第123回利付国債(20年)	618,000,000	761,023,740
第124回利付国債(20年)	750,000,000	915,390,000
第125回利付国債(20年)	1,954,000,000	2,435,582,840
第126回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,799,500,500
第127回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,758,850,000
第128回利付国債(20年)	494,000,000	600,921,360
第130回利付国債(20年)	2,052,000,000	2,480,621,760
第131回利付国債(20年)	280,000,000	335,227,200

第132回利付国債(20年)	187,000,000	224,540,250
第133回利付国債(20年)	2,140,000,000	2,595,028,200
第134回利付国債(20年)	3,205,000,000	3,895,869,800
第135回利付国債(20年)	600,000,000	722,070,000
第137回利付国債(20年)	232,000,000	279,831,440
第138回利付国債(20年)	400,000,000	472,592,000
第139回利付国債(20年)	400,000,000	477,532,000
第140回利付国債(20年)	2,397,000,000	2,899,387,230
第141回利付国債(20年)	2,370,000,000	2,874,620,400
第142回利付国債(20年)	2,000,000,000	2,451,500,000
第143回利付国債(20年)	3,380,000,000	4,063,875,400
第144回利付国債(20年)	350,000,000	416,248,000
第145回利付国債(20年)	2,830,000,000	3,448,864,400
第146回利付国債(20年)	1,550,000,000	1,894,007,000
第147回利付国債(20年)	3,790,000,000	4,587,832,900
第148回利付国債(20年)	5,770,000,000	6,920,364,900
第149回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,437,805,800
第150回利付国債(20年)	990,000,000	1,177,436,700
第151回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,952,165,800
第152回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,303,096,400
第153回利付国債(20年)	3,750,000,000	4,425,412,500
第154回利付国債(20年)	1,560,000,000	1,820,098,800
第155回利付国債(20年)	3,050,000,000	3,465,867,500
第156回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,300,676,300
第157回利付国債(20年)	2,790,000,000	2,812,292,100
第158回利付国債(20年)	3,080,000,000	3,255,036,400
第159回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,577,677,500
第160回利付国債(20年)	3,530,000,000	3,847,982,400
第161回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,799,564,300
第162回利付国債(20年)	1,700,000,000	1,823,658,000
第163回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,124,144,000
第164回利付国債(20年)	2,560,000,000	2,699,136,000
第165回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,477,252,500
第166回利付国債(20年)	3,270,000,000	3,563,842,200
第167回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,210,649,000
第168回利付国債(20年)	2,570,000,000	2,654,938,500
第169回利付国債(20年)	2,080,000,000	2,108,974,400
第170回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,563,269,500
国債証券 合計	479,068,000,000	526,025,366,850
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	20,000,000
	第7回東京都公募公債(20年)	560,000,000
	第7回東京都公募公債(30年)	10,000,000

第8回東京都公募公債(30年)	80,000,000	108,340,000
第20回東京都公募公債(20年)	80,000,000	95,516,000
第21回東京都公募公債(20年)	80,000,000	96,649,600
第22回東京都公募公債(20年)	120,000,000	142,758,000
第28回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,325,000
第33回東京都公募公債(20年)	100,000,000	99,063,000
第700回東京都公募公債	200,000,000	203,370,000
第705回東京都公募公債	170,000,000	173,884,500
第709回東京都公募公債	100,000,000	101,901,000
第722回東京都公募公債	100,000,000	102,784,000
第729回東京都公募公債	100,000,000	102,936,000
第750回東京都公募公債	200,000,000	205,288,000
第758回東京都公募公債	300,000,000	300,402,000
第765回東京都公募公債	300,000,000	304,512,000
平成25年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,958,000
平成25年度第7回北海道公募公債	150,000,000	154,390,500
平成25年度第9回北海道公募公債	300,000,000	308,064,000
平成28年度第12回北海道公募公債	300,000,000	303,138,000
平成29年度第15回北海道公募公債	117,000,000	118,934,010
第29回1号宮城県公募公債	100,000,000	102,617,000
第1回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	270,256,000
第2回神奈川県公募公債(20年)	80,000,000	88,363,200
第2回神奈川県公募公債(30年)	80,000,000	113,848,000
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,055,000
第71回神奈川県公募公債(5年)	400,000,000	400,164,000
第189回神奈川県公募公債	400,000,000	407,684,000
第191回神奈川県公募公債	100,000,000	102,021,000
第226回神奈川県公募公債	300,000,000	304,191,000
第228回神奈川県公募公債	200,000,000	203,038,000
第232回神奈川県公募公債	200,000,000	202,842,000
第11回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	240,374,000
第348回大阪府公募公債	10,000,000	10,155,200
第351回大阪府公募公債	100,000,000	101,796,000
第358回大阪府公募公債	56,000,000	57,144,640
第359回大阪府公募公債	56,000,000	57,212,960
第376回大阪府公募公債	106,000,000	109,262,680
第385回大阪府公募公債	200,000,000	205,914,000
第388回大阪府公募公債	400,000,000	410,436,000
第393回大阪府公募公債	110,000,000	112,615,800
第394回大阪府公募公債	200,000,000	205,074,000
第410回大阪府公募公債	800,000,000	799,584,000
第429回大阪府公募公債	103,000,000	104,468,780

第451回大阪府公募公債	500,000,000	499,405,000
平成22年度第7回京都府公募公債	230,800,000	234,289,696
平成23年度第9回京都府公募公債	140,000,000	143,042,200
平成24年度第10回京都府公募公債	100,000,000	102,169,000
平成27年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	115,374,000
第2回兵庫県公募公債(20年)	300,000,000	354,015,000
第2回兵庫県公募公債(30年)	40,000,000	55,648,400
第3回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	470,296,000
第4回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,220,000
第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,714,000
第9回兵庫県公募公債(15年)	200,000,000	218,040,000
平成24年度第1回兵庫県公募公債	600,000,000	613,650,000
第29回兵庫県公募公債(20年)	200,000,000	206,056,000
第3回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,584,000
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,712,000
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,936,000
平成25年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	103,302,000
平成25年度第8回静岡県公募公債	130,000,000	133,493,100
平成23年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	101,679,000
平成23年度第9回愛知県公募公債	100,000,000	101,720,000
平成23年度第13回愛知県公募公債	300,000,000	331,164,000
平成23年度第14回愛知県公募公債	100,000,000	101,867,000
平成23年度第17回愛知県公募公債	100,000,000	102,021,000
平成24年度第13回愛知県公募公債	100,000,000	102,244,000
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	300,000,000	330,912,000
平成30年度第17回愛知県公募公債	400,000,000	403,408,000
平成22年度第8回広島県公募公債	26,650,000	27,062,275
平成23年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,592,000
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	102,791,000
平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	101,546,000
第4回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	233,380,000
第16回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	115,156,000
平成23年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,717,000
平成23年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	101,808,000
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,242,000
平成26年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	101,701,000
平成28年度第6回埼玉県公募公債	400,000,000	402,156,000
平成29年度第8回埼玉県公募公債	200,000,000	203,752,000
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	98,399,000
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	109,051,200
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	102,261,000
平成26年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,973,000

平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	102,770,000
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	94,844,800
平成23年度第9回千葉県公募公債	20,000,000	20,435,200
平成24年度第1回千葉県公募公債	20,000,000	20,475,600
平成24年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	102,340,000
平成25年度第1回千葉県公募公債	82,500,000	84,102,975
平成25年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,636,000
第7回群馬県公募公債(20年)	300,000,000	303,705,000
平成24年度第1回大分県公募公債	100,260,000	102,517,855
平成27年度第1回大分県公募公債	203,400,000	209,034,180
第99回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,318,000
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,809,000
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,668,000
第103回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,757,000
第107回共同発行市場公募地方債	700,000,000	714,833,000
第109回共同発行市場公募地方債	170,000,000	174,042,600
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,097,000
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,018,000
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,211,000
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,288,000
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,204,000
第126回共同発行市場公募地方債	210,000,000	216,375,600
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,617,000
第129回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,702,000
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,112,000
第132回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,646,000
第135回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,979,000
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,064,000
第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,638,000
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,896,000
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,153,000
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,932,000
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,800,000
第161回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,101,000
第162回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,016,000
第163回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,131,000
第166回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,732,000
第172回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,376,000
第178回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,512,000
平成24年度第2回堺市公募公債	200,000,000	204,222,000
平成25年度第1回長崎県公募公債	200,000,000	206,082,000
平成28年度第2回島根県公募公債(20年)	100,000,000	104,265,000

平成23年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	101,894,000
平成25年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	102,569,000
平成24年度第2回熊本県公募公債	50,000,000	51,120,000
平成23年度第1回浜松市公募公債	238,200,000	242,785,350
平成24年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	102,584,000
平成25年度第1回浜松市公募公債	161,000,000	166,013,540
第1回大阪市公募公債(15年)	200,000,000	222,606,000
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	121,033,000
平成23年度第10回大阪市公募公債	10,000,000	10,193,000
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	215,658,000
第1回名古屋市公募公債(30年)	200,000,000	269,042,000
第9回名古屋市公募公債(20年)	400,000,000	471,920,000
第10回名古屋市公募公債(20年)	80,000,000	96,703,200
第477回名古屋市公募公債	100,000,000	101,977,000
第1回京都市公募公債(20年)	200,000,000	221,152,000
第5回京都市公募公債(20年)	50,000,000	58,159,500
平成23年度第2回京都市公募公債	100,000,000	101,669,000
平成23年度第4回京都市公募公債	350,000,000	357,157,500
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,230,000
平成20年度第24回神戸市公募公債(20年)	300,000,000	354,207,000
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	119,005,000
第7回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	224,324,000
第20回横浜市公募公債(20年)	80,000,000	95,688,000
平成23年度第4回横浜市公募公債	600,000,000	611,328,000
平成24年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	102,542,000
平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	206,164,000
第27回横浜市公募公債(20年)	60,000,000	71,209,200
第33回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	101,461,000
第35回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	309,813,000
平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)	80,000,000	111,287,200
平成23年度第3回札幌市公募公債	300,000,000	362,274,000
平成26年度第5回札幌市公募公債	100,000,000	108,530,000
平成27年度第9回札幌市公募公債	100,000,000	101,148,000
第17回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	118,600,000
平成25年度第3回北九州市公募公債	300,000,000	308,721,000
平成22年度第9回福岡市公募公債	106,500,000	108,133,710
平成23年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	101,765,000
平成24年度第4回福岡市公募公債	200,000,000	204,504,000
平成25年度第4回福岡市公募公債	50,000,000	51,307,500
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	116,671,000
平成25年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,894,000
平成29年度第6回広島市公募公債	300,000,000	305,322,000

平成24年度第1回相模原市公募公債	200,000,000	204,222,000	
平成23年度第1回三重県公募公債	98,410,000	100,274,869	
平成24年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,555,000	
平成26年度第4回福井県公募公債	100,000,000	102,251,000	
平成27年度第4回福井県公募公債	200,000,000	201,010,000	
平成23年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	101,894,000	
平成24年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	204,490,000	
平成30年度第1回山梨県公募公債	100,000,000	102,215,000	
平成24年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	102,214,000	
平成26年度第1回岡山市公募公債	100,000,000	101,678,000	
第4回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	199,904,000	
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	118,380,000	
第132回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,468,000	
地方債証券 合計	30,905,720,000	32,604,803,520	
特殊債券	第3回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,070,000
	第11回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	400,000,000	400,408,000
	第19回政府保証日本政策投資銀行	400,000,000	408,996,000
	第22回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,579,000
	第94回日本政策投資銀行債券(財投機関債)	200,000,000	200,018,000
	第9回道路債券(財投機関債)	100,000,000	132,349,000
	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	47,926,200
	第19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	156,972,000
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	130,000,000	201,778,200
	第33回道路債券(財投機関債)	500,000,000	688,985,000
	第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	50,000,000	60,167,000
	第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)	50,000,000	60,220,000
	第89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	118,557,000
	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	138,812,000
	第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	406,956,000
	第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	91,000,000	92,445,990
	第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	878,000,000	893,663,520
	第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	122,000,000	124,109,380
	第145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	249,232,000

第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,810,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,082,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	136,000,000	138,720,000	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	200,000,000	225,798,000	
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	141,339,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,673,000	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	212,000,000	216,163,680	
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	109,000,000	111,191,990	
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	115,495,000	
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	119,966,000	
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	261,902,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	12,000,000	12,273,360	
第167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	225,952,000	
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	412,000,000	421,533,680	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,428,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	206,354,640	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,700,000	174,545,871	
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,775,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	155,943,720	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,196,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	223,000,000	230,530,710	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,130,000	
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,814,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	222,000,000	228,440,220	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	124,000,000	127,646,840	
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	117,711,000	

第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	283,000,000	290,479,690	
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,802,000	
第256回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	213,000,000	218,640,240	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	600,000,000	606,582,000	
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	60,206,500	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	300,000,000	303,363,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	300,000,000	303,123,000	
第3回公営企業債券(20年)(財投機関債)	20,000,000	20,661,200	
第5回政府保証公営企業債券(15年)	300,000,000	316,602,000	
第6回公営企業債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	107,945,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	200,000,000	239,440,000	
第9回公営企業債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	55,432,500	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	300,000,000	300,258,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	354,558,000	
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	98,128,000	
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	80,000,000	95,288,000	
F17回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	400,000,000	413,096,000	
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	150,000,000	171,688,500	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	240,000,000	240,252,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	30,000,000	30,465,600	
第22回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	101,555,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	355,224,000	
F24回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	70,000,000	73,733,100	
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	59,932,000	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	21,000,000	21,393,120	
第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	401,000,000	408,839,550	
第30回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	305,706,000	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	50,000,000	51,115,000	
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	204,000,000	208,645,080	
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,157,000	
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	115,655,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,648,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,383,010	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,779,400	

第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	160,000,000	164,632,000
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	315,000,000	324,541,350
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,047,000
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,915,000
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	246,609,600
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	310,519,420
第74回政府保証地方公共団体金融機構債券	416,000,000	429,594,880
F89回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	334,941,000
F104回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	106,571,000
F123回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	114,835,000
第128回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	400,000,000	402,328,000
F149回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	106,555,000
F197回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	323,157,000
F234回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	120,170,000
第2回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	102,659,000
第10回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	96,264,000
第15回日本政策金融公庫(財投機関債)	80,000,000	95,060,800
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,664,000
第17回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	303,393,000
第211回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,319,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,541,000	14,010,872
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,989,000	14,554,295
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,900,000	15,619,968
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,271,000	14,964,713
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	77,542,000	77,607,135
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	163,266,000	164,005,594
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,141,000	14,766,739
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	197,338,000	197,073,567
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,324,000	12,590,568
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,809,000	13,252,575
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,092,000	14,672,731
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,820,000	15,449,998
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,801,000	13,239,690
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,173,000	15,835,453
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,412,000	13,947,809
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,779,000	16,706,489
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,046,000	20,084,889
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,839,000	14,396,434
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,012,000	16,789,062

第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,593,000	10,684,947
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,439,000	13,637,090
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,936,000	16,275,914
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,062,000	16,413,436
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	48,408,000	49,424,568
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,898,000	12,171,059
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,116,000	12,449,674
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,586,000	51,602,258
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,296,000	12,573,520
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,926,000	27,702,545
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,670,000	15,166,579
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,037,000	31,156,701
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,859,000	32,930,564
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,588,000	32,502,502
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,461,000	15,022,665
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,568,000	35,520,986
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,817,000	14,338,591
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,750,000	36,463,870
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,106,000	15,853,898
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,640,000	14,311,088
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,250,000	42,817,145
第43回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	100,000,000	121,464,000
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,486,000	42,260,286
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,372,000	35,593,907
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,067,000	32,098,025
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,420,000	99,613,746
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,923,000	32,878,570
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,510,000	33,423,602
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,532,000	14,124,972
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,098,000	36,184,456
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,873,000	39,033,020
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,426,000	40,680,453
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,537,000	45,042,854
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	128,175,000	135,875,754
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,638,000	46,261,516
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,529,000	48,088,185
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,826,000	49,208,506
第62回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	290,000,000	352,184,700
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,919,000	49,101,202
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,939,000	51,270,943
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,405,000	46,713,171

第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,656,000	52,511,220
第75回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	80,000,000	97,028,800
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	301,028,000	315,877,711
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	33,261,900
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,968,000	46,949,290
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,084,000	191,172,651
第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,864,000	103,351,436
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,987,000	51,215,908
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,018,000	54,343,204
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,972,000	107,417,301
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,106,000	110,765,114
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,746,000	59,080,530
第89回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)	1,000,000,000	1,021,460,000
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,495,000	180,986,214
第91回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	118,214,000	122,454,336
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,559,000	62,421,189
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,316,000	130,296,467
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,267,000	227,162,804
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,531,000	228,564,700
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,820,000	152,802,915
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	381,365,000	396,699,686
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	418,135,000	422,512,873
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,812,000	263,480,545
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	438,995,000	446,888,130
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	179,695,100
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	119,950,000
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	542,760,000	551,015,379
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,224,000	92,608,780
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,111,000	93,763,471
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,231,000	93,656,891
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,404,000	187,988,531
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,182,000	187,770,844
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	466,275,000	473,474,286
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,412,000	190,885,849
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,608,000	192,787,726
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,151,000	96,958,869
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,668,000	97,697,118
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,524,000	98,397,889
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,742,000	198,414,075

第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,718,000	200,169,362	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,604,000	
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	203,769,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)	50,000,000	55,425,000	
い第832号商工債券	300,000,000	300,417,000	
第322回信金中金債	300,000,000	300,147,000	
第327回信金中金債	200,000,000	200,246,000	
第332回信金中金債	300,000,000	300,708,000	
第336回信金中金債	300,000,000	300,921,000	
第338回信金中金債	200,000,000	200,718,000	
第11号商工債券(10年)	100,000,000	102,922,000	
第223号商工債券(3年)	300,000,000	300,495,000	
第229号商工債券(3年)	500,000,000	500,885,000	
第230号商工債券(3年)	300,000,000	300,552,000	
第2回信金中金債(10年)	300,000,000	307,974,000	
第18回韓国輸出入銀行	100,000,000	100,092,000	
第7回国際協力機構債券(財投機関債)	70,000,000	84,313,600	
第33回中日本高速道路	50,000,000	50,887,500	
第77回中日本高速道路	600,000,000	601,608,000	
第78回中日本高速道路	600,000,000	601,446,000	
第27回西日本高速道路	600,000,000	617,766,000	
第41回西日本高速道路	500,000,000	501,490,000	
特殊債券 合計	34,278,424,000	36,212,227,784	
社債券	第14回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	301,656,000
	第19回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	206,972,000
	第29回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,980,000
	第8回新韓銀行	300,000,000	300,813,000
	第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	300,000,000	299,364,000
	第1回韓国石油公社債	100,000,000	99,964,000
	第38回関西国際空港	50,000,000	51,058,500
	第10回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	200,000,000	208,246,000
	第17回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,308,000
	第5回日揮	700,000,000	699,895,000
	第7回明治ホールディングス	100,000,000	100,418,000
	第3回コカ・コーラウエスト	300,000,000	303,120,000
	第24回味の素	100,000,000	100,388,000
	第3回 キューピー	100,000,000	100,244,000
	第12回日本たばこ産業	200,000,000	200,040,000
	第13回日本たばこ産業	300,000,000	302,532,000
	第6回ヒューリック	300,000,000	303,318,000
	第7回ヒューリック	200,000,000	199,914,000

第6回J.フロント リテイリング	200,000,000	202,504,000
第4回トヨタ紡織	300,000,000	301,044,000
第22回森ビル	200,000,000	200,038,000
第31回東レ	100,000,000	100,603,000
第4回野村総合研究所	100,000,000	100,967,000
第1回電通	300,000,000	300,315,000
第2回電通	200,000,000	200,964,000
第2回大塚ホールディングス	100,000,000	100,610,000
第11回ヤフー	300,000,000	298,008,000
第3回富士フィルムホールディングス	100,000,000	102,263,000
第11回プリヂストン	300,000,000	302,022,000
第13回プリヂストン	200,000,000	200,816,000
第10回日本特殊陶業	100,000,000	99,870,000
第1回日本製鉄	100,000,000	99,870,000
第4回新日本製鐵	100,000,000	100,895,000
第19回豊田自動織機	100,000,000	101,683,000
第48回日本精工	200,000,000	200,294,000
第51回日本精工	100,000,000	99,920,000
第53回日本電気	200,000,000	200,620,000
第15回パナソニック	300,000,000	300,435,000
第17回パナソニック	100,000,000	101,555,000
第18回デンソー	500,000,000	504,400,000
第29回三菱重工業	300,000,000	307,086,000
第1回日本生命2017基金	100,000,000	100,086,000
第2回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	200,000,000	200,630,000
第13回アイシン精機	100,000,000	102,670,000
第1回明治安田生命2018基金	300,000,000	300,411,000
第1回明治安田生命2019基金	200,000,000	199,872,000
第1回楽天カード	300,000,000	299,874,000
第15回パン・パシフィック・インターナショナル	300,000,000	299,379,000
第48回クレディセゾン	200,000,000	206,034,000
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000,000	304,896,000
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000,000	302,322,000
第8回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	100,000,000	102,516,000
第9回みずほコーポレート銀行(劣後特約付)	100,000,000	112,375,000
第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	101,438,000
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	221,786,000
第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	100,000,000	119,901,000
第57回三菱東京UFJ銀行	200,000,000	211,948,000
第8回三菱UFJ信託銀行(劣後特約付)	200,000,000	218,242,000
第6回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	115,173,000
第13回住友信託銀行(劣後特約付)	100,000,000	112,715,000

第23回三井住友銀行(劣後特約付)	100,000,000	101,330,000
第25回三井住友銀行(劣後特約付)	200,000,000	223,648,000
第5回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	112,790,000
第9回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	115,525,000
第18回みずほ銀行(劣後特約付)	100,000,000	111,743,000
第15回芙蓉総合リース	100,000,000	100,584,000
第47回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	199,400,000
第20回東京センチュリーリース	100,000,000	100,039,000
第23回東京センチュリーリース	200,000,000	199,978,000
第29回ホンダファイナンス	200,000,000	200,772,000
第38回ホンダファイナンス	300,000,000	299,730,000
第42回ホンダファイナンス	100,000,000	99,887,000
第77回トヨタファイナンス	200,000,000	200,542,000
第23回リコーリース	200,000,000	199,798,000
第27回リコーリース	100,000,000	100,082,000
第30回リコーリース	200,000,000	200,140,000
第35回リコーリース	100,000,000	99,787,000
第37回リコーリース	300,000,000	299,145,000
第7回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	199,602,000
第47回日立キャピタル	100,000,000	102,316,000
第70回日立キャピタル	200,000,000	200,492,000
第194回オリックス	400,000,000	400,124,000
第21回三井住友ファイナンス&リース	200,000,000	200,216,000
第63回三菱UFJリース	300,000,000	300,201,000
第66回三菱UFJリース	300,000,000	300,369,000
第75回三菱UFJリース	200,000,000	200,316,000
第27回野村ホールディングス	100,000,000	109,740,000
第50回野村ホールディングス	200,000,000	200,168,000
第58回三井不動産	300,000,000	299,964,000
第116回三菱地所	100,000,000	102,466,000
第125回三菱地所	300,000,000	300,648,000
第95回住友不動産	100,000,000	103,280,000
第99回住友不動産	300,000,000	308,517,000
第12回イオンモール	200,000,000	201,002,000
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	102,268,000
第36回京王電鉄	100,000,000	101,131,000
第38回京王電鉄	100,000,000	100,891,000
第19回東日本旅客鉄道	100,000,000	104,799,000
第26回東日本旅客鉄道	100,000,000	103,280,000
第39回東日本旅客鉄道	500,000,000	552,140,000
第83回東日本旅客鉄道	100,000,000	110,282,000
第100回東日本旅客鉄道	100,000,000	133,613,000

第9回東海旅客鉄道	100,000,000	104,452,000
第11回東海旅客鉄道	100,000,000	103,165,000
第34回東海旅客鉄道	200,000,000	233,168,000
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	116,493,000
第56回東海旅客鉄道	100,000,000	120,249,000
第74回東海旅客鉄道	100,000,000	127,577,000
第8回東京地下鉄	200,000,000	233,324,000
第11回東京地下鉄	100,000,000	102,078,000
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	201,970,000
第16回三菱倉庫	200,000,000	200,788,000
第8回関西高速鉄道	200,000,000	204,546,000
第63回日本電信電話	100,000,000	101,959,000
第21回KDDI	100,000,000	102,540,000
第27回KDDI	300,000,000	300,675,000
第20回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	102,392,000
第567回東京電力	100,000,000	109,538,000
第499回中部電力	50,000,000	51,882,500
第500回中部電力	100,000,000	103,247,000
第518回中部電力	200,000,000	200,656,000
第528回中部電力	200,000,000	200,190,000
第496回関西電力	100,000,000	103,403,000
第499回関西電力	200,000,000	204,654,000
第508回関西電力	200,000,000	201,428,000
第510回関西電力	300,000,000	302,649,000
第512回関西電力	200,000,000	201,034,000
第517回関西電力	300,000,000	300,567,000
第532回関西電力	100,000,000	99,914,000
第381回中国電力	100,000,000	103,493,000
第385回中国電力	100,000,000	102,980,000
第402回中国電力	200,000,000	201,038,000
第409回中国電力	300,000,000	303,174,000
第304回北陸電力	100,000,000	103,314,000
第307回北陸電力	100,000,000	105,314,000
第310回北陸電力	200,000,000	206,082,000
第322回北陸電力	200,000,000	201,906,000
第475回東北電力	300,000,000	309,003,000
第481回東北電力	200,000,000	206,606,000
第490回東北電力	100,000,000	100,352,000
第494回東北電力	100,000,000	101,244,000
第253回四国電力	100,000,000	103,002,000
第371回九州電力	100,000,000	103,816,000
第429回九州電力	200,000,000	206,830,000

第437回九州電力	100,000,000	102,750,000
第445回九州電力	300,000,000	302,268,000
第460回九州電力	200,000,000	200,398,000
第482回九州電力	400,000,000	400,096,000
第484回九州電力	300,000,000	300,534,000
第333回北海道電力	300,000,000	300,972,000
第344回北海道電力	200,000,000	200,290,000
第38回電源開発	100,000,000	103,301,000
第39回電源開発	100,000,000	103,206,000
第40回電源開発	200,000,000	206,408,000
第50回電源開発	200,000,000	201,828,000
第57回電源開発	200,000,000	200,518,000
第4回東京電力パワーグリッド	400,000,000	405,800,000
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,522,000
第8回東京電力パワーグリッド	200,000,000	202,290,000
第13回東京電力パワーグリッド	200,000,000	201,266,000
第15回東京電力パワーグリッド	200,000,000	201,634,000
第28回東京電力パワーグリッド	200,000,000	204,104,000
第30回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,766,000
第31回東京電力パワーグリッド	200,000,000	203,670,000
第23回東京ガス	200,000,000	206,348,000
第13回広島ガス	200,000,000	201,622,000
第6回SCSK	100,000,000	99,958,000
第3回ファーストリテイリング	100,000,000	101,111,000
第4回ファーストリテイリング	100,000,000	103,346,000
第7回ファーストリテイリング	200,000,000	202,554,000
社債券 合計	31,400,000,000	32,091,278,000
合計	575,652,144,000	626,933,676,154

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)

[令和2年1月27日現在]

資産の部

流動資産

預金	1,136,776,983
コール・ローン	101,729,130
国債証券	143,977,137,504
派生商品評価勘定	6,300
未収利息	1,109,482,408
前払費用	75,606,166
流動資産合計	146,400,738,491

資産合計

資産合計	146,400,738,491
------	-----------------

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	195,286
未払金	134,593,483
未払解約金	42,428,502
未払利息	43
流動負債合計	177,217,314

負債合計

負債合計	177,217,314
------	-------------

純資産の部

元本等

元本	68,485,530,430
剰余金	
剰余金又は欠損金()	77,737,990,747
元本等合計	146,223,521,177
純資産合計	146,223,521,177

負債純資産合計

負債純資産合計	146,400,738,491
---------	-----------------

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本となる重要な事項	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)

	[令和2年1月27日現在]
1. 期首	平成31年1月29日
期首先元本額	65,118,468,587円
期中追加設定元本額	14,098,178,838円
期中一部解約元本額	10,731,116,995円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー(海外債券)	692,761,828円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,254,739,089円

	[令和2年1月27日現在]
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,873,877,240円
eMAXIS バランス(波乗り型)	244,736,979円
コアバランス	1,975,716円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	18,612,488円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	15,098,461円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	8,563,371円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	3,556,022,830円
海外債券セレクション(ラップ向け)	1,801,415,473円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	2,639,491,465円
つみたて8資産均等バランス	1,022,640,955円
つみたて4資産均等バランス	271,373,601円
eMAXISマイマネージャー1970s	607,464円
eMAXISマイマネージャー1980s	212,157円
eMAXISマイマネージャー1990s	44,933円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	6,403,765円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	3,265,718円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	2,099,044円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	8,258,730円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	1,828,939円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	9,834,726,461円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	253,910,691円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	225,751,650円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	112,704,381円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	119,116,053円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	19,203,268円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	7,793,467円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	43,380,978円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	2,560,604,907円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,635,345,994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)	25,503,395,517円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	712,250,814円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,984,468円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	2,701,680円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,121,256,894円

	[令和2年1月27日現在]
アドバンスト・バランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	103,414,254円
アドバンスト・バランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	147,003,945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)	111,933,537円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	16,046,347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)	2,669,099,342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)	131,164,150円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	1,907,633円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	4,756,503円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	3,488,534円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	1,497,598円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	45,461,928円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	25,174,492円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	52,328,854円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	39,042,036円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	64,157,529円
外国債券インデックスファンドi (適格機関投資家限定)	1,101,582,681円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,987,313,895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)	227,115,255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)	582,539,235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)	429,939,688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)	157,405,525円
合計	68,485,530,430円
2. 受益権の総数	68,485,530,430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 平成31年 1月29日 至 令和2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号) 第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づいております。

区分	自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に 係るリスク	<p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、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、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <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</p> <p>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</p> <p>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あります。</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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,376,277,438
合計	5,376,277,438

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	買建			
	アメリカドル	10,909,400	10,904,200	5,200
	オーストラリアドル	6,028,640	5,943,200	85,440
	イギリスポンド	2,850,096	2,850,000	96
	シンガポールドル	1,626,640	1,611,800	14,840
	マレーシアリンギット	11,286,969	11,240,559	46,410
	ユーロ	9,661,000	9,624,000	37,000
	合計	42,362,745	42,173,759	188,986

(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。

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はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1351円 (21,351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	1.125 T-NOTE 210228	2,600,000.00	2,587,710.93	
		1.125 T-NOTE 210630	2,000,000.00	1,988,437.50	
		1.125 T-NOTE 210731	1,600,000.00	1,589,875.00	
		1.125 T-NOTE 210831	2,200,000.00	2,185,906.25	
		1.125 T-NOTE 210930	3,400,000.00	3,378,218.75	
		1.25 T-NOTE 210331	1,000,000.00	996,484.37	
		1.25 T-NOTE 211031	2,000,000.00	1,991,093.75	
		1.25 T-NOTE 230731	2,000,000.00	1,985,156.25	
		1.375 T-NOTE 210430	2,400,000.00	2,395,312.50	
		1.375 T-NOTE 210531	2,400,000.00	2,394,375.00	
		1.375 T-NOTE 230630	4,350,000.00	4,336,746.09	
		1.375 T-NOTE 230831	2,850,000.00	2,840,648.43	
		1.375 T-NOTE 230930	2,100,000.00	2,092,781.25	
		1.5 T-NOTE 211031	6,000,000.00	5,999,765.62	
		1.5 T-NOTE 220131	2,300,000.00	2,300,539.06	
		1.5 T-NOTE 230228	2,300,000.00	2,302,875.00	
		1.5 T-NOTE 230331	3,250,000.00	3,253,554.68	
		1.5 T-NOTE 241031	1,500,000.00	1,499,882.81	
		1.5 T-NOTE 241130	2,000,000.00	2,000,468.75	
		1.5 T-NOTE 260815	5,700,000.00	5,669,718.74	
		1.625 T-NOTE 220815	1,700,000.00	1,707,371.09	
		1.625 T-NOTE 220831	7,640,000.00	7,671,634.37	
		1.625 T-NOTE 221115	2,000,000.00	2,008,671.86	
		1.625 T-NOTE 221215	8,000,000.00	8,036,562.49	
		1.625 T-NOTE 230430	2,450,000.00	2,461,867.18	
		1.625 T-NOTE 230531	1,500,000.00	1,507,734.37	
		1.625 T-NOTE 231031	3,100,000.00	3,116,953.12	
		1.625 T-NOTE 260215	5,120,000.00	5,134,400.00	
		1.625 T-NOTE 260515	7,000,000.00	7,020,234.36	
		1.625 T-NOTE 260930	3,700,000.00	3,708,093.75	
		1.625 T-NOTE 261130	2,200,000.00	2,203,953.12	
		1.625 T-NOTE 290815	5,600,000.00	5,574,187.49	

1.75 T-NOTE 211130	3,700,000.00	3,716,765.62
1.75 T-NOTE 220228	3,400,000.00	3,419,390.62
1.75 T-NOTE 220331	2,100,000.00	2,112,632.81
1.75 T-NOTE 220430	1,100,000.00	1,106,960.93
1.75 T-NOTE 220515	1,400,000.00	1,408,859.37
1.75 T-NOTE 220531	1,700,000.00	1,710,890.62
1.75 T-NOTE 220630	4,900,000.00	4,931,007.81
1.75 T-NOTE 220930	1,800,000.00	1,813,781.25
1.75 T-NOTE 230131	2,700,000.00	2,722,781.25
1.75 T-NOTE 230515	3,500,000.00	3,531,445.31
1.875 T-NOTE 211130	2,300,000.00	2,315,902.34
1.875 T-NOTE 220131	2,550,000.00	2,569,125.00
1.875 T-NOTE 220228	5,100,000.00	5,140,640.62
1.875 T-NOTE 220331	2,450,000.00	2,470,480.46
1.875 T-NOTE 220430	9,700,000.00	9,785,632.81
1.875 T-NOTE 220531	6,760,000.00	6,823,375.00
1.875 T-NOTE 220731	4,500,000.00	4,545,000.00
1.875 T-NOTE 220831	1,500,000.00	1,515,234.37
1.875 T-NOTE 220930	2,000,000.00	2,021,718.75
1.875 T-NOTE 221031	2,700,000.00	2,729,742.18
2 T-NOTE 210115	2,900,000.00	2,912,347.65
2 T-NOTE 210228	3,300,000.00	3,315,468.75
2 T-NOTE 210531	1,700,000.00	1,709,894.53
2 T-NOTE 210831	1,850,000.00	1,864,525.38
2 T-NOTE 211031	1,700,000.00	1,714,742.18
2 T-NOTE 211115	2,650,000.00	2,673,912.10
2 T-NOTE 211231	5,850,000.00	5,905,757.81
2 T-NOTE 220215	2,200,000.00	2,223,460.93
2 T-NOTE 220731	2,900,000.00	2,937,156.25
2 T-NOTE 221031	2,000,000.00	2,028,593.75
2 T-NOTE 221130	6,200,000.00	6,292,515.62
2 T-NOTE 230215	3,050,000.00	3,099,324.21
2 T-NOTE 240430	2,000,000.00	2,040,468.75
2 T-NOTE 240531	2,500,000.00	2,553,125.00
2 T-NOTE 240630	2,200,000.00	2,246,750.00
2 T-NOTE 250215	3,600,000.00	3,685,781.25
2 T-NOTE 250815	5,300,000.00	5,425,875.00
2 T-NOTE 261115	5,150,000.00	5,284,382.81
2.125 T-NOTE 210131	610,000.00	613,526.56
2.125 T-NOTE 210630	1,650,000.00	1,663,921.87
2.125 T-NOTE 210815	4,500,000.00	4,539,550.77
2.125 T-NOTE 210930	2,200,000.00	2,222,515.62

2.125 T-NOTE 211231	2,560,000.00	2,590,400.00
2.125 T-NOTE 220630	1,800,000.00	1,828,546.87
2.125 T-NOTE 221231	5,150,000.00	5,246,964.84
2.125 T-NOTE 231130	4,500,000.00	4,608,632.81
2.125 T-NOTE 240229	4,550,000.00	4,662,683.59
2.125 T-NOTE 240331	2,700,000.00	2,769,187.50
2.125 T-NOTE 240731	1,750,000.00	1,797,714.84
2.125 T-NOTE 240930	2,250,000.00	2,313,281.25
2.125 T-NOTE 241130	1,900,000.00	1,954,773.43
2.125 T-NOTE 250515	4,900,000.00	5,045,851.56
2.25 T-BOND 460815	1,870,000.00	1,911,198.39
2.25 T-NOTE 210215	1,700,000.00	1,712,351.56
2.25 T-NOTE 210331	1,600,000.00	1,613,062.49
2.25 T-NOTE 210430	1,800,000.00	1,815,679.68
2.25 T-NOTE 210731	3,400,000.00	3,436,921.87
2.25 T-NOTE 220415	2,700,000.00	2,745,246.08
2.25 T-NOTE 231231	4,900,000.00	5,043,554.68
2.25 T-NOTE 240131	7,300,000.00	7,517,859.37
2.25 T-NOTE 240430	5,000,000.00	5,155,859.37
2.25 T-NOTE 241031	2,800,000.00	2,895,812.50
2.25 T-NOTE 241115	9,250,000.00	9,567,246.09
2.25 T-NOTE 251115	6,570,000.00	6,819,967.96
2.25 T-NOTE 270215	4,750,000.00	4,957,070.31
2.25 T-NOTE 270815	7,670,000.00	8,018,146.09
2.25 T-NOTE 271115	2,100,000.00	2,196,796.87
2.375 T-NOTE 210415	3,300,000.00	3,331,839.84
2.375 T-NOTE 230131	5,000,000.00	5,133,203.12
2.375 T-NOTE 240815	4,300,000.00	4,465,953.12
2.375 T-NOTE 270515	2,690,000.00	2,833,536.71
2.375 T-NOTE 290515	2,510,000.00	2,661,972.64
2.5 T-BOND 450215	2,800,000.00	2,992,937.50
2.5 T-BOND 460215	3,170,000.00	3,398,834.37
2.5 T-BOND 460515	3,300,000.00	3,539,765.62
2.5 T-NOTE 210131	7,000,000.00	7,065,898.43
2.5 T-NOTE 230815	3,400,000.00	3,521,390.62
2.5 T-NOTE 240131	6,400,000.00	6,651,500.00
2.5 T-NOTE 240515	4,350,000.00	4,532,156.25
2.5 T-NOTE 250131	2,200,000.00	2,305,187.50
2.625 T-NOTE 210515	2,300,000.00	2,331,894.53
2.625 T-NOTE 210615	3,100,000.00	3,146,136.71
2.625 T-NOTE 210715	4,600,000.00	4,672,414.06
2.625 T-NOTE 230228	3,000,000.00	3,104,531.25
2.625 T-NOTE 230630	2,500,000.00	2,595,898.43

2.625 T-NOTE 250331	3,700,000.00	3,903,210.93
2.625 T-NOTE 251231	2,600,000.00	2,756,000.00
2.625 T-NOTE 260131	3,700,000.00	3,925,179.68
2.625 T-NOTE 290215	5,320,000.00	5,748,925.00
2.75 T-BOND 420815	1,350,000.00	1,506,515.62
2.75 T-BOND 421115	1,550,000.00	1,730,126.95
2.75 T-BOND 470815	3,340,000.00	3,770,025.00
2.75 T-BOND 471115	2,200,000.00	2,485,484.36
2.75 T-NOTE 210815	12,560,000.00	12,795,009.36
2.75 T-NOTE 230430	2,000,000.00	2,081,093.75
2.75 T-NOTE 230531	4,600,000.00	4,790,828.12
2.75 T-NOTE 231115	8,050,000.00	8,426,714.84
2.75 T-NOTE 240215	5,960,000.00	6,256,137.50
2.75 T-NOTE 250228	2,150,000.00	2,280,175.78
2.75 T-NOTE 250630	6,000,000.00	6,375,937.50
2.75 T-NOTE 250831	5,840,000.00	6,217,775.00
2.75 T-NOTE 280215	6,860,000.00	7,433,453.12
2.875 T-BOND 430515	2,800,000.00	3,187,625.00
2.875 T-BOND 450815	4,200,000.00	4,810,312.50
2.875 T-BOND 461115	3,080,000.00	3,548,978.12
2.875 T-NOTE 211015	4,700,000.00	4,808,136.71
2.875 T-NOTE 250430	2,600,000.00	2,777,328.12
2.875 T-NOTE 250531	2,400,000.00	2,565,937.50
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	4,079,062.50
2.875 T-NOTE 280515	4,200,000.00	4,601,296.87
2.875 T-NOTE 280815	5,060,000.00	5,554,535.93
3 T-BOND 420515	950,000.00	1,102,890.62
3 T-BOND 441115	5,600,000.00	6,531,000.00
3 T-BOND 450515	2,750,000.00	3,213,417.96
3 T-BOND 451115	2,950,000.00	3,456,339.84
3 T-BOND 470215	3,150,000.00	3,718,476.56
3 T-BOND 470515	2,500,000.00	2,950,781.24
3 T-BOND 480215	3,050,000.00	3,609,484.37
3 T-BOND 480815	3,710,000.00	4,399,538.28
3 T-BOND 490215	4,700,000.00	5,590,062.50
3.125 T-BOND 411115	800,000.00	947,062.50
3.125 T-BOND 420215	900,000.00	1,065,585.93
3.125 T-BOND 430215	1,700,000.00	2,014,367.18
3.125 T-BOND 440815	4,450,000.00	5,294,109.37
3.125 T-BOND 480515	2,450,000.00	2,968,328.12
3.125 T-NOTE 210515	1,100,000.00	1,122,214.84
3.125 T-NOTE 281115	10,800,000.00	12,094,312.50

3.375 T-BOND 440515	4,500,000.00	5,565,937.50		
3.375 T-BOND 481115	3,090,000.00	3,925,989.84		
3.5 T-BOND 390215	1,000,000.00	1,247,343.75		
3.625 T-BOND 430815	2,350,000.00	3,007,816.40		
3.625 T-BOND 440215	4,550,000.00	5,836,441.40		
3.625 T-NOTE 210215	2,900,000.00	2,961,738.27		
3.75 T-BOND 410815	1,000,000.00	1,293,828.12		
3.75 T-BOND 431115	4,900,000.00	6,395,265.62		
3.875 T-BOND 400815	1,000,000.00	1,312,656.25		
4.25 T-BOND 390515	1,350,000.00	1,848,550.78		
4.25 T-BOND 401115	900,000.00	1,240,031.25		
4.375 T-BOND 380215	650,000.00	895,832.02		
4.375 T-BOND 391115	850,000.00	1,184,421.87		
4.375 T-BOND 400515	1,250,000.00	1,745,898.43		
4.375 T-BOND 410515	1,300,000.00	1,822,843.75		
4.5 T-BOND 360215	1,150,000.00	1,572,265.62		
4.5 T-BOND 390815	750,000.00	1,059,902.34		
4.625 T-BOND 400215	1,700,000.00	2,442,820.31		
4.75 T-BOND 410215	1,530,000.00	2,244,916.40		
5 T-BOND 370515	240,000.00	350,906.25		
5.25 T-BOND 281115	550,000.00	712,292.96		
5.25 T-BOND 290215	300,000.00	390,703.12		
5.375 T-BOND 310215	990,000.00	1,356,300.00		
5.5 T-BOND 280815	600,000.00	785,015.62		
6 T-BOND 260215	2,250,000.00	2,830,957.03		
6.25 T-BOND 230815	130,000.00	151,444.92		
6.25 T-BOND 300515	550,000.00	787,917.96		
6.5 T-BOND 261115	1,600,000.00	2,110,000.00		
8 T-BOND 211115	600,000.00	669,117.18		
アメリカドル合計	603,930,000.00	640,038,971.07 (69,802,650,184)		
カナダドル	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	1,500,000.00	1,469,775.00
		0.75 CAN GOVT 210301	1,450,000.00	1,436,877.50
		0.75 CAN GOVT 210901	3,120,000.00	3,082,466.40
		1 CAN GOVT 220901	2,350,000.00	2,322,528.50
		1 CAN GOVT 270601	950,000.00	924,863.00
		1.5 CAN GOVT 230601	850,000.00	851,691.50
		1.5 CAN GOVT 260601	800,000.00	806,136.00
		1.75 CAN GOVT 210501	1,100,000.00	1,102,442.00
		1.75 CAN GOVT 230301	800,000.00	807,552.00
		2 CAN GOVT 230901	2,400,000.00	2,448,528.00
		2 CAN GOVT 280601	900,000.00	944,343.00

		2 CAN GOVT 511201	520,000.00	587,912.00		
		2.25 CAN GOVT 240301	800,000.00	827,624.00		
		2.25 CAN GOVT 250601	1,300,000.00	1,358,201.00		
		2.25 CAN GOVT 290601	890,000.00	958,841.50		
		2.5 CAN GOVT 240601	1,500,000.00	1,570,245.00		
		2.75 CAN GOVT 220601	850,000.00	874,786.00		
		2.75 CAN GOVT 481201	860,000.00	1,111,206.00		
		2.75 CANADA GOVER 641201	310,000.00	439,276.20		
		3.25 CAN GOVT 210601	800,000.00	817,936.00		
		3.5 CAN GOVT 451201	1,350,000.00	1,924,182.00		
		4 CAN GOVT 410601	1,100,000.00	1,599,510.00		
		5 CAN GOVT 370601	850,000.00	1,307,138.50		
		5.75 CAN GOVT 290601	850,000.00	1,172,464.50		
		5.75 CAN GOVT 330601	1,250,000.00	1,905,162.50		
		8 CAN GOVT 270601	500,000.00	729,005.00		
カナダドル合計			29,950,000.00	33,380,693.10		
				(2,768,594,685)		
オーストラリアドル	国債証券	2 AUST GOVT 211221	1,150,000.00	1,176,853.76		
		2.25 AUST GOVT 221121	1,000,000.00	1,042,328.70		
		2.25 AUST GOVT 280521	2,300,000.00	2,522,340.76		
		2.5 AUST GOVT 300521	2,300,000.00	2,612,502.38		
		2.75 AUST GOVT 240421	1,700,000.00	1,838,673.76		
		2.75 AUST GOVT 271121	1,950,000.00	2,205,241.54		
		2.75 AUST GOVT 281121	1,650,000.00	1,884,025.44		
		2.75 AUST GOVT 291121	1,830,000.00	2,112,653.19		
		2.75 AUST GOVT 350621	500,000.00	600,629.10		
		3 AUST GOVT 470321	1,090,000.00	1,400,105.43		
		3.25 AUST GOVT 250421	1,800,000.00	2,021,293.80		
		3.25 AUST GOVT 290421	1,810,000.00	2,154,918.84		
		3.25 AUST GOVT 390621	900,000.00	1,166,138.10		
		3.75 AUST GOVT 370421	900,000.00	1,224,177.30		
		4.25 AUST GOVT 260421	2,950,000.00	3,546,877.92		
		4.5 AUST GOVT 330421	1,270,000.00	1,784,795.26		
		4.75 AUST GOVT 270421	1,950,000.00	2,464,520.56		
		5.5 AUST GOVT 230421	1,750,000.00	2,015,082.12		
		5.75 AUST GOVT 210515	2,060,000.00	2,191,168.64		
		5.75 AUST GOVT 220715	1,600,000.00	1,795,936.32		
オーストラリアドル合計			32,460,000.00	37,760,262.92		
				(2,805,587,534)		
イギリスポンド	国債証券	0.5 GILT 220722	1,100,000.00	1,103,658.82		
		0.75 GILT 230722	2,450,000.00	2,481,188.50		
		1 GILT 240422	600,000.00	615,469.44		

1.25 GILT 270722	1,600,000.00	1,695,868.80		
1.5 GILT 210122	520,000.00	525,220.74		
1.5 GILT 260722	1,660,000.00	1,777,566.51		
1.5 GILT 470722	2,060,000.00	2,274,286.96		
1.625 GILT 281022	2,150,000.00	2,359,324.00		
1.75 GILT 220907	3,000,000.00	3,108,090.60		
1.75 GILT 370907	950,000.00	1,071,398.60		
1.75 GILT 570722	610,000.00	760,363.29		
2 GILT 250907	980,000.00	1,069,474.00		
2.25 GILT 230907	1,700,000.00	1,814,068.98		
2.5 GILT 650722	1,440,000.00	2,262,922.56		
2.75 GILT 240907	1,550,000.00	1,717,273.52		
3.25 GILT 440122	1,790,000.00	2,618,603.17		
3.5 GILT 450122	1,820,000.00	2,792,755.78		
3.5 GILT 680722	2,100,000.00	4,168,836.00		
3.75 GILT 210907	900,000.00	948,109.32		
3.75 GILT 520722	1,250,000.00	2,196,025.50		
4 GILT 220307	1,050,000.00	1,129,866.78		
4 GILT 600122	1,110,000.00	2,231,725.59		
4.25 GILT 271207	980,000.00	1,268,985.92		
4.25 GILT 320607	1,220,000.00	1,732,956.32		
4.25 GILT 360307	1,375,000.00	2,070,956.25		
4.25 GILT 390907	1,150,000.00	1,821,535.14		
4.25 GILT 401207	1,240,000.00	1,995,037.72		
4.25 GILT 461207	1,410,000.00	2,459,675.62		
4.25 GILT 491207	930,000.00	1,691,059.17		
4.25 GILT 551207	1,310,000.00	2,599,761.02		
4.5 GILT 340907	1,260,000.00	1,901,144.95		
4.5 GILT 421207	1,190,000.00	2,029,366.50		
4.75 GILT 301207	460,000.00	661,466.75		
4.75 GILT 381207	1,600,000.00	2,652,494.08		
5 GILT 250307	1,130,000.00	1,393,399.15		
6 GILT 281207	1,080,000.00	1,596,948.26		
8 GILT 210607	900,000.00	992,379.24		
イギリスポンド合計		49,625,000.00		
		67,589,263.55		
		(9,632,145,948)		
シンガ ポールド ル	国債証券	1.25 SINGAPORGGOVT 211001	550,000.00	548,680.00
		1.75 SINGAPORGGOVT 220401	350,000.00	352,635.18
		1.75 SINGAPORGGOVT 230201	250,000.00	252,619.35
		2 SINGAPORGGOVT 240201	100,000.00	102,284.36
		2.125 SINGAPORGGOVT 260601	230,000.00	238,624.08
		2.25 SINGAPORGGOVT 210601	420,000.00	424,742.09

		2.25 SINGAPORGVT 360801	260,000.00	275,170.58		
		2.375 SINGAPORGGOV 250601	300,000.00	314,016.54		
		2.375 SINGAPORGGOV 390701	200,000.00	216,387.24		
		2.625 SINGAPORGGOV 280501	300,000.00	324,028.98		
		2.75 SINGAPORGVT 230701	450,000.00	470,074.86		
		2.75 SINGAPORGVT 420401	290,000.00	331,342.34		
		2.75 SINGAPORGGOV 460301	520,000.00	595,257.00		
		2.875 SINGAPORGGOV 290701	100,000.00	110,698.50		
		2.875 SINGAPORGVT 300901	300,000.00	334,093.11		
		3 SINGAPORGVT 240901	600,000.00	641,292.00		
		3.125 SINGAPORGVT 220901	300,000.00	313,155.54		
		3.375 SINGAPORGGOV 330901	560,000.00	667,769.20		
		3.5 SINGAPORGVT 270301	650,000.00	735,262.58		
シンガポールドル合計			6,730,000.00	7,248,133.53		
				(584,199,562)		
マレーシアリングット	国債証券	3.418 MALAYSIAGOV 220815	900,000.00	912,419.91		
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	1,200,000.00	1,221,840.00		
		3.502 MALAYSIAGOV 270531	300,000.00	307,356.06		
		3.733 MALAYSIAGO 280615	1,100,000.00	1,144,544.28		
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	500,000.00	511,349.95		
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	200,000.00	206,153.18		
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	600,000.00	633,900.00		
		3.882 MALAYSIAGOV 220310	500,000.00	510,613.20		
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	1,000,000.00	1,041,740.00		
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	500,000.00	524,272.90		
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	1,100,000.00	1,157,461.14		
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	1,000,000.00	1,047,641.90		
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	800,000.00	837,600.00		
		4.048 MALAYSIA 210930	900,000.00	918,649.71		
		4.127 MALAYSIA 320415	1,060,000.00	1,147,407.07		
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	2,250,000.00	2,292,299.55		
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	1,000,000.00	1,050,862.10		
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	850,000.00	943,426.47		
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	900,000.00	966,572.73		
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	900,000.00	997,200.00		
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	1,200,000.00	1,374,000.00		
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,050,000.00	1,210,650.00		
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	1,600,000.00	1,883,017.60		
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	1,200,000.00	1,430,400.00		
		5.248 MALAYSIA 280915	860,000.00	992,725.26		
マレーシアリングット合計			23,470,000.00	25,264,103.01		
				(678,846,447)		

スウェーデンクローネ	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	2,550,000.00	2,720,954.55	
		0.75 SWD GOVT 291112	3,400,000.00	3,628,429.00	
		1 SWD GOVT 261112	3,960,000.00	4,264,991.28	
		1.5 SWD GOVT 231113	5,520,000.00	5,892,840.67	
		2.5 SWD GOVT 250512	4,630,000.00	5,298,723.86	
		3.5 SWD GOVT 220601	6,900,000.00	7,520,634.30	
		3.5 SWD GOVT 390330	3,330,000.00	5,187,913.56	
		スウェーデンクローネ合計	30,290,000.00	34,514,487.22	(393,465,154)
ノルウェークローネ	国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	2,160,000.00	2,188,684.80	
		1.75 NORWE GOVT 250313	2,300,000.00	2,355,625.50	
		1.75 NORWE GOVT 270217	3,050,000.00	3,143,879.00	
		1.75 NORWE GOVT 290906	2,200,000.00	2,280,751.00	
		2 NORWE GOVT 230524	5,150,000.00	5,269,258.55	
		2 NORWE GOVT 280426	2,850,000.00	3,001,791.00	
		3 NORWE GOVT 240314	3,550,000.00	3,794,417.50	
		3.75 NORWE GOVT 210525	4,750,000.00	4,900,860.00	
ノルウェークローネ合計			26,010,000.00	26,935,267.35	(324,569,971)
デンマーククローネ	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	7,350,000.00	7,905,101.40	
		1.5 DMK GOVT 231115	3,650,000.00	3,946,204.80	
		1.75 DMK GOVT 251115	4,850,000.00	5,503,013.70	
		3 DMK GOVT 211115	6,020,000.00	6,419,938.70	
		4.5 DMK GOVT 391115	10,060,000.00	19,181,671.60	
デンマーククローネ合計			31,930,000.00	42,955,930.20	(691,590,476)
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	19,300,000.00	21,928,081.00	
		10 MEXICAN BONOS 361120	6,600,000.00	8,567,460.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	11,700,000.00	11,127,636.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	26,740,000.00	26,661,651.80	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	19,400,000.00	19,316,968.00	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	7,000,000.00	7,009,450.00	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	6,500,000.00	6,567,015.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	24,150,000.00	25,171,786.50	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	9,450,000.00	10,113,957.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	9,500,000.00	10,236,915.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	13,240,000.00	14,227,704.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	18,450,000.00	19,244,457.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	10,800,000.00	11,999,766.60	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	15,000,000.00	16,754,400.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	9,600,000.00	11,050,560.00	
			207,430,000.00	219,977,807.90	

メキシコペソ合計		(1,273,671,507)	
ポーランドズロチ	国債証券	1.75 POLAND 210725	1,900,000.00
		2 POLAND 210425	1,900,000.00
		2.25 POLAND 220425	1,250,000.00
		2.5 POLAND 230125	2,500,000.00
		2.5 POLAND 240425	1,600,000.00
		2.5 POLAND 260725	2,650,000.00
		2.5 POLAND 270725	2,050,000.00
		2.75 POLAND 280425	2,660,000.00
		3.25 POLAND 250725	2,850,000.00
		4 POLAND 231025	2,700,000.00
		5.75 POLAND 211025	1,700,000.00
		5.75 POLAND 220923	1,550,000.00
		5.75 POLAND 290425	1,570,000.00
ポーランドズロチ合計		26,880,000.00	28,378,132.78 (802,249,813)
南アフリカランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	16,100,000.00
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	6,950,000.00
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	9,700,000.00
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	3,000,000.00
		7 SOUTH AFRICA 310228	9,500,000.00
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	9,000,000.00
		8 SOUTH AFRICA 300131	11,500,000.00
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	7,800,000.00
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	8,200,000.00
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	10,050,000.00
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	16,300,000.00
		8.875 SOUTH AFRICA 350228	7,950,000.00
		9 SOUTH AFRICA 400131	7,500,000.00
南アフリカランド合計		123,550,000.00	112,442,081.92 (850,062,139)
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	400,000.00
		0 AUSTRIA GOVT 230715	950,000.00
		0 BUND 500815	260,000.00
		0 FINNISH GOVT 220415	250,000.00
		0 FINNISH GOVT 230915	350,000.00
		0 IRISH GOVT 221018	250,000.00
		0 NETH GOVT 220115	800,000.00
		0 NETH GOVT 240115	1,250,000.00
		0 O.A.T 210525	1,300,000.00
		0 O.A.T 220525	5,650,000.00
		0 O.A.T 230325	2,700,000.00
			2,748,111.84

0 OBL 211008	1,000,000.00	1,010,487.00
0 OBL 220408	1,000,000.00	1,013,961.60
0 OBL 221007	1,900,000.00	1,932,451.05
0 OBL 230414	1,400,000.00	1,428,757.40
0 OBL 231013	2,150,000.00	2,200,424.81
0.05 ITALY GOVT 210415	1,300,000.00	1,303,841.50
0.2 BEL GOVT 231022	920,000.00	944,688.20
0.25 BUND 270215	1,650,000.00	1,738,862.40
0.25 BUND 280815	1,990,000.00	2,108,090.58
0.25 BUND 290215	1,600,000.00	1,696,211.20
0.25 NETH GOVT 250715	1,750,000.00	1,819,874.00
0.25 NETH GOVT 290715	400,000.00	418,736.80
0.25 O.A.T 261125	400,000.00	415,163.20
0.35 ITALY GOVT 211101	400,000.00	402,901.20
0.35 SPAIN GOVT 230730	1,100,000.00	1,122,973.94
0.4 SPAIN GOVT 220430	1,500,000.00	1,526,067.00
0.45 ITALY GOVT 210601	1,300,000.00	1,310,741.90
0.45 SPAIN GOVT 221031	1,450,000.00	1,481,411.35
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	700,000.00	740,734.40
0.5 BEL GOVT 241022	800,000.00	835,404.80
0.5 BUND 260215	2,600,000.00	2,766,948.60
0.5 BUND 270815	2,300,000.00	2,473,385.50
0.5 BUND 280215	1,900,000.00	2,049,026.50
0.5 FINNISH GOVT 260415	400,000.00	421,255.20
0.5 FINNISH GOVT 270915	350,000.00	370,337.45
0.5 FINNISH GOVT 280915	250,000.00	265,231.92
0.5 FINNISH GOVT 290915	200,000.00	212,292.20
0.5 NETH GOVT 260715	1,350,000.00	1,431,349.65
0.5 O.A.T 250525	2,750,000.00	2,887,274.50
0.5 O.A.T 260525	3,250,000.00	3,423,273.75
0.65 ITALY GOVT 231015	2,700,000.00	2,738,380.50
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	1,100,000.00	1,180,404.50
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	900,000.00	971,946.18
0.75 FINNISH GOVT 310415	350,000.00	380,817.50
0.75 NETH GOVT 270715	1,180,000.00	1,278,512.30
0.75 NETH GOVT 280715	880,000.00	960,109.92
0.75 O.A.T 280525	3,190,000.00	3,444,562.00
0.75 O.A.T 281125	3,300,000.00	3,567,795.00
0.75 SPAIN GOVT 210730	2,600,000.00	2,646,579.00
0.8 BEL GOVT 250622	1,300,000.00	1,383,621.20
0.8 BEL GOVT 270622	1,080,000.00	1,163,311.20
0.8 BEL GOVT 280622	900,000.00	973,824.30

0.8 IRISH GOVT 220315	500,000.00	513,898.20
0.875 FINNISH GOV 250915	500,000.00	535,981.00
0.9 BEL GOVT 290622	1,060,000.00	1,159,485.24
0.9 IRISH GOVT 280515	1,200,000.00	1,305,136.80
0.9 ITALY GOVT 220801	3,200,000.00	3,266,252.80
0.95 ITALY GOVT 230315	1,980,000.00	2,025,943.92
1 BEL GOVT 260622	1,100,000.00	1,193,120.50
1 BEL GOVT 310622	650,000.00	720,450.25
1 BUND 240815	1,750,000.00	1,879,472.00
1 BUND 250815	2,050,000.00	2,230,810.00
1 IRISH GOVT 260515	1,100,000.00	1,188,875.60
1 O.A.T 251125	1,920,000.00	2,075,458.56
1 O.A.T 270525	2,900,000.00	3,171,567.60
1.125 FINNISH GOV 340415	280,000.00	320,489.40
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1,250,000.00	1,365,702.50
1.2 ITALY GOVT 220401	1,400,000.00	1,436,224.16
1.25 BEL GOVT 330422	940,000.00	1,076,844.26
1.25 BUND 480815	1,550,000.00	2,023,246.00
1.25 ITALY GOVT 261201	1,300,000.00	1,337,429.60
1.25 O.A.T 340525	1,780,000.00	2,044,831.96
1.25 O.A.T 360525	2,730,000.00	3,136,076.58
1.3 IRISH GOVT 330515	300,000.00	343,197.00
1.3 SPAIN GOVT 261031	2,100,000.00	2,274,106.80
1.35 IRISH GOVT 310318	100,000.00	114,234.00
1.35 ITALY GOVT 220415	1,150,000.00	1,183,346.55
1.375 FINNISH GOV 470415	240,000.00	301,617.84
1.4 SPAIN GOVT 280430	1,300,000.00	1,425,450.00
1.4 SPAIN GOVT 280730	2,350,000.00	2,578,514.00
1.45 BEL GOVT 370622	220,000.00	259,189.70
1.45 ITALY GOVT 220915	900,000.00	932,019.30
1.45 ITALY GOVT 241115	900,000.00	939,819.96
1.45 ITALY GOVT 250515	1,600,000.00	1,667,718.40
1.45 SPAIN GOVT 271031	2,500,000.00	2,746,620.00
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	530,000.00	671,557.70
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	150,000.00	202,245.30
1.5 BUND 220904	1,300,000.00	1,372,891.00
1.5 BUND 230215	1,200,000.00	1,279,296.00
1.5 BUND 230515	1,500,000.00	1,606,890.00
1.5 BUND 240515	1,550,000.00	1,692,744.15
1.5 FINNISH GOVT 230415	250,000.00	266,731.25
1.5 IRISH GOVT 500515	260,000.00	312,808.60
1.5 ITALY GOVT 250601	1,550,000.00	1,620,184.00
1.5 O.A.T 310525	3,660,000.00	4,274,803.14

1.5 SPAIN GOVT 270430	1,050,000.00	1,154,486.55
1.6 BEL GOVT 470622	430,000.00	530,693.10
1.6 SPAIN GOVT 250430	1,800,000.00	1,959,427.80
1.625 FINNISH GOV 220915	300,000.00	317,594.70
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	700,000.00	771,111.60
1.65 ITALY GOVT 320301	1,460,000.00	1,503,205.78
1.7 BEL GOVT 500622	350,000.00	440,352.50
1.7 IRISH GOVT 370515	450,000.00	547,395.30
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	800,000.00	869,046.40
1.75 BUND 220704	1,600,000.00	1,693,537.76
1.75 BUND 240215	7,150,000.00	7,845,523.40
1.75 NETH GOVT 230715	1,000,000.00	1,082,042.00
1.75 O.A.T 230525	11,650,000.00	12,551,017.99
1.75 O.A.T 241125	2,900,000.00	3,212,959.30
1.75 O.A.T 390625	850,000.00	1,060,749.00
1.75 O.A.T 660525	1,270,000.00	1,684,693.10
1.85 ITALY GOVT 240515	850,000.00	900,896.30
1.85 SPAIN GOVT 350730	700,000.00	810,169.84
1.9 BEL GOVT 380622	530,000.00	667,978.08
1.95 SPAIN GOVT 260430	1,600,000.00	1,792,424.00
1.95 SPAIN GOVT 300730	1,550,000.00	1,794,947.74
2 BUND 220104	1,300,000.00	1,367,256.80
2 BUND 230815	1,450,000.00	1,587,068.50
2 FINNISH GOVT 240415	200,000.00	221,370.20
2 IRISH GOVT 450218	590,000.00	782,661.55
2 ITALY GOVT 251201	1,730,000.00	1,858,073.63
2 ITALY GOVT 280201	1,800,000.00	1,943,908.20
2 NETH GOVT 240715	950,000.00	1,058,604.95
2 O.A.T 480525	1,800,000.00	2,410,200.00
2.05 ITALY GOVT 270801	1,300,000.00	1,404,877.50
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	420,000.00	738,219.72
2.1 ITALY GOVT 260715	1,050,000.00	1,135,366.05
2.15 BEL GOVT 660622	470,000.00	691,332.40
2.15 SPAIN GOVT 251031	1,700,000.00	1,913,220.80
2.2 ITALY GOVT 270601	1,400,000.00	1,527,650.60
2.25 BEL GOVT 230622	820,000.00	898,816.76
2.25 BEL GOVT 570622	290,000.00	420,806.24
2.25 ITALY GOVT 360901	1,170,000.00	1,255,863.96
2.25 NETH GOVT 220715	900,000.00	964,380.60
2.25 O.A.T 221025	2,350,000.00	2,533,488.00
2.25 O.A.T 240525	2,740,000.00	3,069,881.75
2.35 SPAIN GOVT 330730	1,930,000.00	2,358,394.95

2.4 AUSTRIA GOVT 340523	320,000.00	423,693.76
2.4 IRISH GOVT 300515	800,000.00	998,301.60
2.45 ITALY GOVT 330901	1,200,000.00	1,332,783.60
2.5 BUND 440704	1,780,000.00	2,821,223.46
2.5 BUND 460815	1,820,000.00	2,949,666.72
2.5 ITALY GOVT 241201	1,800,000.00	1,968,089.40
2.5 ITALY GOVT 251115	1,610,000.00	1,772,625.45
2.5 NETH GOVT 330115	1,010,000.00	1,351,607.25
2.5 O.A.T 300525	2,950,000.00	3,731,856.20
2.6 BEL GOVT 240622	1,180,000.00	1,340,941.38
2.625 FINNISH GOV 420704	300,000.00	453,189.60
2.7 ITALY GOVT 470301	1,200,000.00	1,328,390.40
2.7 SPAIN GOVT 481031	970,000.00	1,308,013.47
2.75 FINNISH GOVT 280704	600,000.00	751,924.50
2.75 NETH GOVT 470115	940,000.00	1,575,575.36
2.75 O.A.T 271025	3,000,000.00	3,706,860.00
2.75 SPAIN GOVT 241031	1,550,000.00	1,763,759.72
2.8 ITALY GOVT 281201	1,550,000.00	1,776,298.45
2.8 ITALY GOVT 670301	680,000.00	739,612.88
2.9 SPAIN GOVT 461031	1,410,000.00	1,955,158.17
2.95 ITALY GOVT 380901	1,550,000.00	1,804,275.95
3 BEL GOVT 340622	310,000.00	433,773.39
3.1 ITALY GOVT 400301	640,000.00	754,313.60
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	450,000.00	743,053.50
3.25 BUND 420704	880,000.00	1,512,425.20
3.25 ITALY GOVT 460901	1,150,000.00	1,397,338.55
3.25 NETH GOVT 210715	1,600,000.00	1,691,140.80
3.25 O.A.T 211025	2,600,000.00	2,775,000.80
3.25 O.A.T 450525	1,750,000.00	2,837,383.50
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	650,000.00	723,729.50
3.4 IRISH GOVT 240318	600,000.00	695,912.40
3.45 ITALY GOVT 480301	1,020,000.00	1,281,234.24
3.45 SPAIN GOVT 660730	620,000.00	1,006,043.62
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	1,050,000.00	1,120,771.05
3.5 FINNISH GOVT 210415	400,000.00	420,057.20
3.5 ITALY GOVT 300301	1,700,000.00	2,067,132.00
3.5 O.A.T 260425	2,050,000.00	2,549,263.15
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	600,000.00	657,348.00
3.75 BEL GOVT 450622	670,000.00	1,166,403.00
3.75 ITALY GOVT 210501	1,800,000.00	1,889,195.40
3.75 ITALY GOVT 210801	3,000,000.00	3,175,443.30
3.75 ITALY GOVT 240901	1,500,000.00	1,720,473.45
3.75 NETH GOVT 230115	300,000.00	339,218.70

3.75 NETH GOVT 420115	1,420,000.00	2,541,019.00
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	250,000.00	546,387.50
3.8 SPAIN GOVT 240430	2,500,000.00	2,923,620.00
3.85 ITALY GOVT 490901	1,020,000.00	1,363,271.82
3.9 IRISH GOVT 230320	400,000.00	455,562.64
4 BEL GOVT 220328	750,000.00	825,294.00
4 BEL GOVT 320328	620,000.00	916,533.60
4 BUND 370104	1,650,000.00	2,806,115.40
4 FINNISH GOVT 250704	550,000.00	684,460.70
4 ITALY GOVT 370201	2,050,000.00	2,700,762.25
4 NETH GOVT 370115	1,050,000.00	1,754,760.00
4 O.A.T 381025	1,620,000.00	2,685,597.12
4 O.A.T 550425	1,440,000.00	2,858,520.67
4 O.A.T 600425	1,310,000.00	2,726,018.30
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,000,000.00	1,667,393.00
4.2 SPAIN GOVT 370131	1,470,000.00	2,266,714.86
4.25 BEL GOVT 210928	950,000.00	1,027,210.11
4.25 BEL GOVT 220928	1,100,000.00	1,242,819.38
4.25 BEL GOVT 410328	1,300,000.00	2,275,841.10
4.25 BUND 390704	1,030,000.00	1,893,023.61
4.25 O.A.T 231025	3,240,000.00	3,827,431.44
4.4 SPAIN GOVT 231031	1,350,000.00	1,585,440.00
4.5 BEL GOVT 260328	880,000.00	1,145,778.48
4.5 ITALY GOVT 230501	2,300,000.00	2,617,593.20
4.5 ITALY GOVT 240301	2,120,000.00	2,470,883.32
4.5 ITALY GOVT 260301	1,450,000.00	1,774,701.40
4.5 O.A.T 410425	2,650,000.00	4,813,645.50
4.65 SPAIN GOVT 250730	1,550,000.00	1,950,915.25
4.7 SPAIN GOVT 410730	2,640,000.00	4,525,039.20
4.75 BUND 280704	650,000.00	940,006.60
4.75 BUND 340704	1,290,000.00	2,226,058.83
4.75 BUND 400704	1,250,000.00	2,472,755.00
4.75 ITALY GOVT 210901	3,000,000.00	3,231,674.70
4.75 ITALY GOVT 230801	1,700,000.00	1,965,856.20
4.75 ITALY GOVT 280901	2,000,000.00	2,608,908.00
4.75 ITALY GOVT 440901	1,220,000.00	1,816,887.44
4.75 O.A.T 350425	2,550,000.00	4,284,153.00
4.8 SPAIN GOVT 240131	1,300,000.00	1,561,163.50
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	550,000.00	728,294.05
4.9 SPAIN GOVT 400730	1,300,000.00	2,254,985.07
5 BEL GOVT 350328	1,580,000.00	2,697,028.40
5 ITALY GOVT 220301	1,500,000.00	1,657,764.00

5 ITALY GOVT 250301	2,250,000.00	2,747,481.30
5 ITALY GOVT 340801	2,100,000.00	3,007,227.30
5 ITALY GOVT 390801	1,620,000.00	2,416,027.50
5 ITALY GOVT 400901	1,400,000.00	2,090,411.40
5.15 SPAIN GOVT 281031	1,350,000.00	1,921,051.21
5.25 ITALY GOVT 291101	2,100,000.00	2,885,311.80
5.4 IRISH GOVT 250313	700,000.00	907,954.60
5.4 SPAIN GOVT 230131	1,750,000.00	2,050,501.25
5.5 BEL GOVT 280328	1,500,000.00	2,206,182.00
5.5 BUND 310104	1,290,000.00	2,128,538.70
5.5 ITALY GOVT 220901	1,150,000.00	1,311,599.15
5.5 ITALY GOVT 221101	2,200,000.00	2,524,550.60
5.5 NETH GOVT 280115	1,150,000.00	1,692,963.30
5.5 O.A.T 290425	3,050,000.00	4,661,284.50
5.625 BUND 280104	950,000.00	1,417,998.50
5.75 ITALY GOVT 330201	1,450,000.00	2,171,424.30
5.75 O.A.T 321025	2,140,000.00	3,686,385.40
5.75 SPAIN GOVT 320730	1,350,000.00	2,207,036.70
5.85 SPAIN GOVT 220131	1,850,000.00	2,082,335.95
5.9 SPAIN GOVT 260730	3,400,000.00	4,689,718.94
6 ITALY GOVT 310501	2,350,000.00	3,494,591.00
6 O.A.T 251025	3,700,000.00	5,071,978.50
6 SPAIN GOVT 290131	1,650,000.00	2,490,052.29
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	970,000.00	1,449,965.70
6.25 BUND 240104	1,130,000.00	1,439,395.24
6.25 BUND 300104	750,000.00	1,253,976.75
6.5 BUND 270704	1,200,000.00	1,834,299.60
6.5 ITALY GOVT 271101	2,700,000.00	3,817,705.50
7.25 ITALY GOVT 261101	1,100,000.00	1,562,880.00
7.5 NETH GOVT 230115	650,000.00	808,564.25
8.5 O.A.T 230425	1,300,000.00	1,687,254.79
9 ITALY GOVT 231101	1,200,000.00	1,589,227.92
ユーロ合計	364,360,000.00	443,636,775.43 (53,369,504,084)
合計		143,977,137,504 (143,977,137,504)

(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 188銘柄	100.00%	48.48%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.00%	1.92%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	100.00%	1.95%
イギリスポンド	国債証券 37銘柄	100.00%	6.69%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.00%	0.41%
マレーシアリンギット	国債証券 25銘柄	100.00%	0.47%
スウェーデンクローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.27%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.23%
デンマーククローネ	国債証券 5銘柄	100.00%	0.48%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.00%	0.88%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.00%	0.56%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.00%	0.59%
ユーロ	国債証券 255銘柄	100.00%	37.07%

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)

[令和2年1月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	330,676,390
コール・ローン	50,471,569
国債証券	29,739,673,089
派生商品評価勘定	408
未収利息	407,037,600
前払費用	62,292,824
流動資産合計	30,590,151,880
資産合計	30,590,151,880
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	137,897
未払金	52,648,002
未払解約金	17,164,752
未払利息	21
流動負債合計	69,950,672
負債合計	69,950,672

[令和2年1月27日現在]

純資産の部		
元本等		
元本	21,159,314,350	
剰余金		
剰余金又は欠損金()	9,360,886,858	
元本等合計	30,520,201,208	
純資産合計	30,520,201,208	
負債純資産合計	30,590,151,880	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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本となる重要な事項	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)

	[令和2年1月27日現在]
1. 期首	平成31年1月29日
期首元本額	15,407,521,844円
期中追加設定元本額	7,011,221,547円
期中一部解約元本額	1,259,429,041円
元本の内訳	
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,784,891,430円
eMAXIS バランス(波乗り型)	360,275,489円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	579,123,955円
コアバランス	1,422,253円
海外債券セレクション(ラップ向け)	158,727,367円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	3,887,604,316円
つみたて8資産均等バランス	1,503,550,049円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,024,252円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,871,095円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	264,359円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,127,296,896円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	7,247,804,820円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	9,769,125円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	39,070,562円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	200,503,821円

	[令和2年1月27日現在]
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	169,425,523円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	45,830,320円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	7,863,232円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	14,049,651円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	18,945,835円
合計	21,159,314,350円
2. 受益権の総数	21,159,314,350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 平成31年 1月29日 至 令和2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づいております。
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、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。 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、あくまでモデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和2年1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引

区分	[令和2年1月27日現在]
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>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</p> <p>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>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和2年1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,376,807,270
合計	1,376,807,270

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建			
	マレーシアリンギット	16,894,461	16,824,994	69,467
	メキシコペソ	2,904,550	2,890,000	14,550
	チェコクロナ	1,443,810	1,431,000	12,810
	ハンガリーフォリント	1,797,040	1,788,000	9,040
	ポーランドズロチ	1,426,040	1,413,000	13,040
	南アフリカランド	2,274,040	2,265,000	9,040
	ルーマニアレイ	1,267,450	1,257,500	9,950
	トルコリラ	1,465,992	1,466,400	408
	合計	29,473,383	29,335,894	137,489

(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あります。

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

		[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額		1,4424円
(1万口当たり純資産額)		(14,424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
マレーシアリンギット	国債証券	3.62 MALAYSIAGOV 211130	4,400,000.00	4,466,193.60	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	5,900,000.00	6,138,919.32	
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	7,100,000.00	7,318,437.89	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	3,300,000.00	3,495,842.13	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	5,000,000.00	5,261,187.00	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	8,620,000.00	9,030,673.17	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	8,800,000.00	9,213,600.00	
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	6,700,000.00	7,016,181.71	
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4,000,000.00	4,075,199.20	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	5,500,000.00	5,779,741.55	

マレーシアリンクット合計			66,220,000.00	69,614,616.57 (1,870,544,747)	
タイバーツ	国債証券	1.45 THAILAND 241217	44,000,000.00	44,517,039.60	
		1.875 THAILAND 220617	44,000,000.00	44,762,660.80	
		2 THAILAND 221217	39,100,000.00	40,040,683.44	
		2.125 THAILAND 261217	53,500,000.00	56,556,615.50	
		2.4 THAILAND 231217	48,100,000.00	50,311,435.98	
		2.875 THAILAND 281217	66,800,000.00	75,203,740.60	
		2.875 THAILAND 460617	42,200,000.00	50,113,550.78	
		3.3 THAILAND 380617	29,700,000.00	36,948,641.40	
		3.4 THAILAND 360617	43,300,000.00	54,067,696.78	
		3.625 THAILAND 230616	42,400,000.00	45,870,270.40	
		3.65 THAILAND 211217	43,700,000.00	45,767,993.25	
		3.65 THAILAND 310620	43,900,000.00	53,729,407.55	
		3.775 THAILAND 320625	58,500,000.00	72,878,504.40	
		3.85 THAILAND 251212	51,800,000.00	59,472,724.78	
		4.875 THAILAND 290622	47,400,000.00	61,941,921.84	
タイバーツ合計			698,400,000.00	792,182,887.10 (2,812,249,249)	
フィリピンペソ	国債証券	6.25 PHILIPPI(GL) 360114	20,000,000.00	24,460,942.00	
フィリピンペソ合計			20,000,000.00	24,460,942.00 (52,591,025)	
インドネシアルピア	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	7,050,000,000.00	8,947,494,105.00	
		11 INDONESIA 250915	8,850,000,000.00	10,793,991,000.00	
		12.8 INDONESIA 210615	1,790,000,000.00	1,972,597,900.00	
		5.625 INDONESIA 230515	28,400,000,000.00	28,343,200,000.00	
		6.125 INDONESIA 280515	27,300,000,000.00	26,518,947,000.00	
		6.625 INDONESIA 330515	16,900,000,000.00	16,159,273,000.00	
		7 INDONESIA 220515	16,250,000,000.00	16,807,212,500.00	
		7 INDONESIA 270515	18,450,000,000.00	19,011,249,000.00	
		7.5 INDONESIA 320815	8,900,000,000.00	9,124,013,000.00	
		7.5 INDONESIA 380515	11,100,000,000.00	11,183,139,000.00	
		8.25 INDONESIA 210715	18,400,000,000.00	19,197,824,000.00	
		8.25 INDONESIA 290515	19,500,000,000.00	21,704,475,000.00	
		8.25 INDONESIA 320615	15,000,000,000.00	16,241,850,000.00	
		8.25 INDONESIA 360515	18,400,000,000.00	19,932,352,000.00	
		8.375 INDONESIA 240315	42,200,000,000.00	45,979,854,000.00	
		8.375 INDONESIA 260915	25,130,000,000.00	27,879,473,300.00	
		8.375 INDONESIA 340315	31,300,000,000.00	34,718,586,000.00	
		8.375 INDONESIA 390415	12,200,000,000.00	13,483,440,000.00	
		8.75 INDONESIA 310515	15,100,000,000.00	17,268,813,000.00	
		9 INDONESIA 290315	15,500,000,000.00	17,849,335,000.00	

		9.5 INDONESIA 310715	5,050,000,000.00	6,025,761,000.00	
インドネシアルピア合計			362,770,000,000.00	389,142,879,805.00	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	45,900,000.00	52,150,203.00	
		10 MEXICAN BONOS 361120	14,700,000.00	19,082,070.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	28,200,000.00	26,820,456.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	26,900,000.00	26,821,183.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	54,200,000.00	53,968,024.00	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	38,000,000.00	38,391,780.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	46,200,000.00	48,154,722.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	24,300,000.00	26,007,318.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	15,400,000.00	16,594,578.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	31,900,000.00	34,279,740.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	57,300,000.00	59,767,338.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	21,000,000.00	22,070,766.90	
		8 MEXICAN BONOS 471107	23,300,000.00	25,888,385.35	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	40,200,000.00	44,901,792.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	25,700,000.00	29,583,270.00	
メキシコペソ合計			493,200,000.00	524,481,626.25	
				(3,036,748,615)	
プラジル レアル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	16,170,000.00	19,286,314.74	
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	13,100,000.00	15,224,167.62	
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	6,100,000.00	7,440,497.57	
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	20,100,000.00	22,575,638.61	
		BRAZIL-LTN 210701	9,800,000.00	9,189,493.09	
		BRAZIL-LTN 220101	17,800,000.00	16,209,082.28	
		BRAZIL-LTN 220701	11,500,000.00	10,154,194.10	
		BRAZIL-LTN 230701	15,600,000.00	12,861,222.49	
プラジルレアル合計			110,170,000.00	112,940,610.50	
				(2,944,361,715)	
チリペソ	国債証券	4.5 BONOS TESORER 210301	870,000,000.00	910,585,500.00	
		4.5 BONOS TESORER 260301	1,200,000,000.00	1,329,932,160.00	
		4.7 BONOS TESORER 300901	1,000,000,000.00	1,140,850,000.00	
		5 BONOS TESORERIA 350301	1,000,000,000.00	1,193,185,300.00	
		6 BONOS TESORERIA 430101	890,000,000.00	1,210,177,500.00	
チリペソ合計			4,960,000,000.00	5,784,730,460.00	
				(811,019,210)	
チェココ ルナ	国債証券	0.25 CZECH REPUBL 270210	19,500,000.00	17,865,045.90	
		0.45 CZECH REPUBL 231025	24,400,000.00	23,458,963.73	
		0.95 CZECH REPUBL 300515	25,200,000.00	23,807,700.00	
		1 CZECH REPUBLIC 260626	25,300,000.00	24,574,616.61	
		2.4 CZECH REPUBL 250917	26,800,000.00	27,968,480.00	

		2.5 CZECH REPUBLI 280825	28,000,000.00	30,106,020.00	
		2.75 CZECH REPUBL 290723	23,000,000.00	25,408,484.10	
		3.85 CZECH REPUBL 210929	13,600,000.00	14,083,353.52	
		4.7 CZECH REPUBLI 220912	20,400,000.00	22,033,020.00	
		5.7 CZECH REPUBLI 240525	18,500,000.00	21,763,400.00	
チエココルナ合計			224,700,000.00	231,069,083.86	
			(1,104,510,220)		
コロンビアペソ	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	6,200,000,000.00	7,401,790,020.00	
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	1,680,000,000.00	1,646,884,478.40	
		6 TITULOS DE TESO 280428	7,280,000,000.00	7,414,307,264.00	
		6.25 TITULOS DE T 251126	5,190,000,000.00	5,408,641,206.00	
		7 TITULOS DE TESO 220504	8,010,000,000.00	8,396,023,527.00	
		7 TITULOS DE TESO 320630	6,000,000,000.00	6,484,364,400.00	
		7.25 TITULOS DE T 341018	2,300,000,000.00	2,520,991,590.00	
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7,770,000,000.00	8,619,619,197.00	
		7.75 COLOMBI(GL) 210414	1,000,000,000.00	1,030,514,500.00	
		7.75 TITULOS DE T 300918	4,860,000,000.00	5,536,317,600.00	
		9.85 COLOMBI(GL) 270628	1,290,000,000.00	1,633,546,350.00	
コロンビアペソ合計			51,580,000,000.00	56,093,000,132.40	
			(1,817,413,204)		
ハンガリーフォーリント	国債証券	1.75 HUNGARY 221026	307,000,000.00	318,166,971.50	
		2.5 HUNGARY 211027	40,000,000.00	41,692,000.00	
		2.75 HUNGARY 261222	243,000,000.00	261,639,315.00	
		3 HUNGARY 240626	329,000,000.00	359,695,700.00	
		3 HUNGARY 271027	358,000,000.00	391,406,376.20	
		3 HUNGARY 300821	155,000,000.00	168,713,764.50	
		5.5 HUNGARY 250624	512,000,000.00	628,439,040.00	
		6 HUNGARY 231124	333,000,000.00	400,192,740.00	
		6.75 HUNGARY 281022	167,000,000.00	233,115,300.00	
		7 HUNGARY 220624	223,000,000.00	260,029,150.00	
ハンガリーフォーリント合計			2,667,000,000.00	3,063,090,357.20	
			(1,095,361,111)		
ペルーヌエボソル	国債証券	5.4 PERU 340812	2,600,000.00	2,780,137.10	
		5.7 PERU 240812	1,300,000.00	1,459,035.50	
		5.94 PERU 290212	3,700,000.00	4,212,826.66	
		6.15 PERU 320812	2,800,000.00	3,222,990.96	
		6.35 PERU 280812	3,900,000.00	4,558,892.13	
		6.9 PERU 370812	3,800,000.00	4,664,413.36	
		6.95 PERU 310812	5,700,000.00	6,966,338.79	
		8.2 PERU 260812	3,200,000.00	4,081,849.92	
ペルーヌエボソル合計			27,000,000.00	31,946,484.42	
			(1,047,844,688)		

ポーランドズロチ	国債証券	1.75 POLAND 210725	8,300,000.00	8,330,338.16		
		2 POLAND 210425	3,800,000.00	3,828,348.00		
		2.25 POLAND 220425	7,500,000.00	7,608,202.50		
		2.25 POLAND 241025	5,000,000.00	5,075,864.50		
		2.5 POLAND 230125	7,700,000.00	7,872,732.56		
		2.5 POLAND 240425	7,800,000.00	8,007,364.56		
		2.5 POLAND 260725	8,600,000.00	8,791,135.86		
		2.5 POLAND 270725	8,000,000.00	8,158,548.00		
		2.75 POLAND 280425	6,900,000.00	7,157,715.00		
		2.75 POLAND 291025	4,400,000.00	4,592,940.00		
		3.25 POLAND 250725	6,700,000.00	7,123,877.51		
		4 POLAND 231025	6,400,000.00	6,907,897.60		
		5.75 POLAND 211025	3,400,000.00	3,645,548.00		
		5.75 POLAND 220923	5,600,000.00	6,189,792.00		
ポーランドズロチ合計			90,100,000.00	93,290,304.25		
				(2,637,316,901)		
南アフリカランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	53,900,000.00	60,615,147.67		
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	24,400,000.00	17,432,339.16		
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	20,300,000.00	14,110,748.22		
		6.75 SOUTH AFRICA 210331	4,500,000.00	4,510,350.00		
		7 SOUTH AFRICA 310228	21,500,000.00	18,245,816.97		
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	25,900,000.00	26,544,910.00		
		8 SOUTH AFRICA 300131	45,700,000.00	42,674,641.72		
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	25,000,000.00	22,917,548.50		
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	26,300,000.00	23,180,639.05		
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	37,000,000.00	32,382,400.00		
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	52,100,000.00	45,425,990.00		
		8.875 SOUTH AFRICA 350228	29,600,000.00	27,517,581.07		
		9 SOUTH AFRICA 400131	22,100,000.00	20,097,429.05		
南アフリカランド合計			388,300,000.00	355,655,541.41		
				(2,688,755,893)		
ウルグアイペソ	国債証券	8.5 URUGUAY(GL) 280315	7,000,000.00	6,230,000.00		
		9.875 URUGUAY(GL) 220620	8,200,000.00	8,138,500.00		
ウルグアイペソ合計			15,200,000.00	14,368,500.00		
				(42,099,705)		
ロシアルーブル	国債証券	6.5 RUSSIA OFZ 240228	90,000,000.00	92,857,050.00		
		6.9 RUSSIA OFZ 290523	44,200,000.00	46,935,538.00		
		7 RUSSIA GOVT 230125	36,500,000.00	38,014,750.00		
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	62,000,000.00	64,843,010.00		
		7 RUSSIA OFZ 211215	72,500,000.00	74,453,875.00		
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	106,700,000.00	113,844,632.00		
		7.1 RUSSIA OFZ 241016	122,400,000.00	129,258,072.00		

		7.25 RUSSIA OFZ 340510	56,300,000.00	61,651,033.50		
		7.4 RUSSIA OFZ 221207	76,700,000.00	80,548,806.00		
		7.4 RUSSIA OFZ 240717	90,000,000.00	95,860,800.00		
		7.5 RUSSIA OFZ 210818	61,900,000.00	63,757,000.00		
		7.6 RUSSIA GOVT 210414	30,400,000.00	31,190,552.00		
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	55,000,000.00	57,657,600.00		
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	95,700,000.00	108,421,879.50		
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	149,600,000.00	164,709,600.00		
		7.95 RUSSIA OFZ 261007	25,800,000.00	28,644,450.00		
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	111,000,000.00	124,929,945.00		
		8.5 RUSSIA OFZ 310917	111,200,000.00	132,886,224.00		
ロシアルーブル合計			1,397,900,000.00	1,510,464,817.00		
				(2,643,313,429)		
ドミニカ ペソ	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8,000,000.00	8,029,332.80		
		9.75 DOMINICAN 260605	16,000,000.00	16,492,116.80		
ドミニカペソ合計			24,000,000.00	24,521,449.60		
				(50,268,971)		
ルーマニア アレイ	国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 210322	1,600,000.00	1,597,056.00		
		3.25 ROMANIA GOVE 240429	2,300,000.00	2,250,929.50		
		3.4 ROMANIA GOVER 220308	3,300,000.00	3,287,278.50		
		3.5 ROMANIA GOVER 221219	3,200,000.00	3,186,000.00		
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	6,300,000.00	6,541,920.00		
		5 ROMANIA GOVERN 290212	2,760,000.00	2,916,961.20		
		5.8 ROMANIA GOV 270726	2,600,000.00	2,888,314.00		
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	4,000,000.00	4,258,820.00		
		5.95 ROMANIA 210611	3,600,000.00	3,718,980.00		
ルーマニアアレイ合計			29,660,000.00	30,646,259.20		
				(771,059,881)		
トルコリ ラ	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	2,400,000.00	2,428,800.00		
		10.5 TURKEY GOVT 270811	5,900,000.00	6,026,850.00		
		10.6 TURKEY GOVT 260211	6,200,000.00	6,336,400.00		
		10.7 TURKEY GOVT 210217	3,300,000.00	3,339,600.00		
		10.7 TURKEY GOVT 220817	3,800,000.00	3,879,800.00		
		11 TURKEY GOVT 220302	4,400,000.00	4,494,600.00		
		11 TURKEY GOVT 270224	3,300,000.00	3,438,600.00		
		12.2 TURKEY GOVT 230118	4,600,000.00	4,885,200.00		
		12.4 TURKEY GOVT 280308	3,100,000.00	3,489,050.00		
		16.2 TURKEY GOVT 230614	2,800,000.00	3,295,600.00		
		7.1 TURKEY GOVT 230308	4,900,000.00	4,534,950.00		
		8 TURKEY GOVT 250312	4,000,000.00	3,668,200.00		
		8.5 TURKEY GOVT 220914	4,200,000.00	4,086,600.00		
		9 TURKEY GOVT 240724	3,100,000.00	2,997,700.00		

	9.2 TURKEY GOVT 210922	4,200,000.00	4,176,900.00	
	9.5 TURKEY GOVT 220112	2,300,000.00	2,288,500.00	
トルコリラ合計		62,500,000.00	63,367,350.00	
	合計		29,739,673,089	(29,739,673,089)

(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 12銘柄	100.00%	6.29%
タイバーツ	国債証券 15銘柄	100.00%	9.46%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.18%
インドネシアルピア	国債証券 21銘柄	100.00%	10.60%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.00%	10.21%
ブラジルレアル	国債証券 8銘柄	100.00%	9.90%
チリペソ	国債証券 5銘柄	100.00%	2.73%
チェココルナ	国債証券 10銘柄	100.00%	3.71%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	100.00%	6.11%
ハンガリーフォリント	国債証券 10銘柄	100.00%	3.68%
ペルーヌエボソル	国債証券 8銘柄	100.00%	3.52%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.00%	8.87%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.00%	9.04%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.14%
ロシアルーブル	国債証券 18銘柄	100.00%	8.89%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.17%
ルーマニアレイ	国債証券 9銘柄	100.00%	2.59%
トルコリラ	国債証券 16銘柄	100.00%	3.91%

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)

[令和2年1月27日現在]

資産の部

流動資産

コール・ローン	9,898,671,199
投資証券	34,600,208,736
派生商品評価勘定	15,457,740
未収入金	910,580
未収配当金	229,289,329
未収利息	266,942
その他未収収益	235,267
差入委託証拠金	10,941,500
流動資産合計	44,755,981,293

資産合計

44,755,981,293

負債の部

流動負債

前受金	18,428,000
未払解約金	68,698,342
未払利息	4,276
受入担保金	9,491,309,604
流動負債合計	9,578,440,222

負債合計

9,578,440,222

純資産の部

元本等

元本	9,655,654,154
剰余金	
剰余金又は欠損金()	25,521,886,917
元本等合計	35,177,541,071
純資産合計	35,177,541,071

負債純資産合計

44,755,981,293

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)

	[令和2年1月27日現在]
1. 期首	平成31年1月29日
期首先元本額	8,070,576,759円
期中追加設定元本額	4,019,694,773円
期中一部解約元本額	2,434,617,378円
元本の内訳	
eMAXIS 国内リートインデックス	4,496,639,368円

	[令和2年1月27日現在]
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,116,834,542円
eMAXIS バランス(波乗り型)	144,963,384円
三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド	40,523,857円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	175,691,467円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	986,741,786円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	163,771,919円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	1,566,185,865円
つみたて8資産均等バランス	607,770,669円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	307,954円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	504,067円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	106,910円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	176,752,849円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	4,403,577円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	19,037,293円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	9,514,615円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	15,607,869円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	60,495,444円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	45,520,639円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	18,532,347円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	5,747,733円
合計	9,655,654,154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	9,025,175,640円
3. 受益権の総数	9,655,654,154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 平成31年 1月29日 至 令和2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づいております。
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あります。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。

区分	自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,253,482,757
合計	4,253,482,757

(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

[令和 2年 1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	561,334,000	576,821,000	15,487,000
	合計	561,334,000	576,821,000	15,487,000

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

		[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額		3.6432円
(1万口当たり純資産額)		(36,432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	318	44,806,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	449	60,839,500	貸付有価証券 97口
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,029	719,271,000	貸付有価証券 325口
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,971	492,801,100	貸付有価証券 1,159口
	森ヒルズリート投資法人	3,561	655,224,000	

産業ファンド投資法人	3,987	670,613,400	
アドバンス・レジデンス投資法人	2,936	1,011,452,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,926	415,630,800	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,551	879,417,000	貸付有価証券 490口
G L P投資法人	7,709	1,052,278,500	貸付有価証券 2,434口
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,286	461,031,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,447	1,328,763,600	貸付有価証券 1,404口
星野リゾート・リート投資法人	471	262,347,000	貸付有価証券 149口
Oneリート投資法人	482	173,279,000	貸付有価証券 152口
イオンリート投資法人	3,340	502,670,000	
ヒューリックリート投資法人	2,632	518,240,800	貸付有価証券 794口
日本リート投資法人	1,005	504,510,000	貸付有価証券 317口
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	19,886	463,940,380	貸付有価証券 6,278口
日本ヘルスケア投資法人	150	32,250,000	貸付有価証券 47口
積水ハウス・リート投資法人	9,051	828,166,500	貸付有価証券 2,857口
トーセイ・リート投資法人	674	91,327,000	貸付有価証券 180口
ケネディクス商業リート投資法人	1,195	323,725,500	貸付有価証券 358口
ヘルスケア&メディカル投資法人	660	93,720,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	620	74,028,000	
野村不動産マスタートファンド投資法人	9,993	1,861,695,900	貸付有価証券 3,047口
いちごホテルリート投資法人	513	67,818,600	
ラサールロジポート投資法人	2,878	482,640,600	貸付有価証券 811口
スターアジア不動産投資法人	1,027	118,926,600	
マリモ地方創生リート投資法人	305	38,796,000	貸付有価証券 84口
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	762	406,908,000	
大江戸温泉リート投資法人	526	48,392,000	貸付有価証券 166口
さくら総合リート投資法人	670	64,320,000	貸付有価証券 211口
投資法人みらい	3,520	212,608,000	貸付有価証券 1,060口
森トラスト・ホテルリート投資法人	726	107,302,800	貸付有価証券 229口

三菱地所物流リート投資法人	609	225,634,500	貸付有価証券 156口
C R E ロジスティクスファンド投資法人	582	84,099,000	貸付有価証券 137口
ザイマックス・リート投資法人	449	62,276,300	貸付有価証券 142口
タカラレーベン不動産投資法人	878	113,086,400	貸付有価証券 207口
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	478	61,231,800	
日本ビルファンド投資法人	2,997	2,571,426,000	貸付有価証券 946口
ジャパンリアルエスティート投資法人	3,095	2,423,385,000	貸付有価証券 977口
日本リテールファンド投資法人	5,850	1,344,330,000	貸付有価証券 1,847口
オリックス不動産投資法人	6,167	1,431,977,400	貸付有価証券 1,947口
日本プライムリアルティ投資法人	1,959	952,074,000	貸付有価証券 619口
プレミア投資法人	2,796	436,735,200	貸付有価証券 883口
東急リアル・エステート投資法人	2,075	442,390,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,149	308,381,500	貸付有価証券 679口
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,950	1,355,250,000	貸付有価証券 2,194口
森トラスト総合リート投資法人	2,212	433,330,800	貸付有価証券 698口
インヴィンシブル投資法人	13,578	737,285,400	貸付有価証券 4,287口
フロンティア不動産投資法人	1,099	493,451,000	貸付有価証券 332口
平和不動産リート投資法人	1,928	267,799,200	貸付有価証券 609口
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,022	588,402,000	
福岡リート投資法人	1,601	297,625,900	貸付有価証券 505口
ケネディクス・オフィス投資法人	958	820,048,000	貸付有価証券 302口
いちごオフィスリート投資法人	2,397	278,771,100	貸付有価証券 757口
大和証券オフィス投資法人	714	612,612,000	貸付有価証券 226口
阪急阪神リート投資法人	1,398	237,380,400	貸付有価証券 441口
スターツプロシード投資法人	482	98,906,400	貸付有価証券 152口
大和ハウスリート投資法人	4,173	1,180,541,700	貸付有価証券 1,317口
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,971	720,903,300	貸付有価証券 3,148口

日本賃貸住宅投資法人	3,482	368,395,600	貸付有価証券 1,099口
ジャパンエクセレント投資法人	2,863	556,280,900	貸付有価証券 875口
エスコンジャパンリート投資法人 (新)	14	1,920,940	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)	9	3,180,150	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人(新)	30	15,823,770	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人(新)	44	5,532,296	
合計	180,265	34,600,208,736	

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)

[令和2年1月27日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	222,982,418
コール・ローン	70,659,570
投資証券	31,446,406,936
未収入金	347,551
未収配当金	38,003,085
流動資産合計	31,778,399,560
資産合計	31,778,399,560
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	242,350
未払解約金	14,372,380
未払利息	30
流動負債合計	14,614,760
負債合計	14,614,760
純資産の部	
元本等	
元本	16,663,327,716
剰余金	
剰余金又は欠損金()	15,100,457,084
元本等合計	31,763,784,800
純資産合計	31,763,784,800
負債純資産合計	31,778,399,560

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	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本となる重要な事項	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）

	[令和2年 1月27日現在]
1. 期首	平成31年 1月29日
期首元本額	13,296,026,449円
期中追加設定元本額	4,606,374,994円
期中一部解約元本額	1,239,073,727円
元本の内訳	
三菱UFJ 6 資産バランスファンド（2ヶ月分配型）	147,188,030円
三菱UFJ 6 資産バランスファンド（成長型）	104,718,175円
三菱UFJ 資産設計ファンド（分配型）	24,905,605円
三菱UFJ 資産設計ファンド（バランス型）	50,453,807円
三菱UFJ 資産設計ファンド（株式重視型）	22,585,769円
ファンド・マネジャー（海外リート）	39,663,487円
eMAXIS 先進国リートインデックス	5,802,230,857円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,131,989,693円
eMAXIS バランス（波乗り型）	273,712,287円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	2,395,646,317円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	339,828,831円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）	447,001,359円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	2,954,349,734円
つみたて8資産均等バランス	1,147,693,641円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	894,621円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,423,080円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	406,372円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	263,263,033円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	11,558,325円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	50,339,632円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	27,102,913円

	[令和2年1月27日現在]
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	44,538,111円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	171,667,258円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	128,896,365円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	70,152,950円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	11,117,464円
合計	16,663,327,716円
2. 受益権の総数	16,663,327,716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 平成31年 1月29日 至 令和2年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づいております。
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、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。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和2年1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

区分	[令和2年1月27日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[令和2年1月27日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	930,603,766
合計	930,603,766

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和2年1月27日現在]

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル ユーロ	48,174,090	47,981,300	192,790
		7,267,560	7,218,000	49,560
		55,441,650	55,199,300	242,350

(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。

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はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和2年1月27日現在]
1口当たり純資産額	1,9062円
(1万口当たり純資産額)	(19,062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	18,327	476,868.54	
		AGREE REALTY CORP	8,878	662,920.26	
		ALEXANDER'S INC	451	153,416.67	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,528	4,203,440.48	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,825	469,045.50	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	29,196	1,369,292.40	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	21,702	287,117.46	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	53,112	1,453,675.44	
		AMERICOLD REALTY TRUST	39,844	1,404,501.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	30,909	1,669,704.18	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	44,569	690,373.81	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	97,000	83,905.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,040	39,254.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,305	6,427,465.65	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,512	42,354.72	
		BOSTON PROPERTIES INC	30,225	4,292,252.25	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,240	51,105.60	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	36,786	592,254.60	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	62,222	1,309,773.10
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	14,447	276,948.99
BRIT APARTMENTS CORP	2,200	39,226.00
CAMDEN PROPERTY TRUST	20,447	2,270,434.88
CARETRUST REIT INC	19,847	434,053.89
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	31,483	29,594.02
CEDAR REALTY TRUST INC	17,360	49,302.40
CHATHAM LODGING TRUST	9,069	159,705.09
CITY OFFICE REIT INC	11,927	163,161.36
CLIPPER REALTY INC	2,958	32,685.90
COLONY CAPITAL INC	100,469	466,176.16
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	24,052	527,219.84
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,800	174,192.00
CORECIVIC INC	25,233	409,531.59
COREPOINT LODGING INC	7,095	67,260.60
CORESITE REALTY CORP	7,799	918,098.28
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	23,510	704,829.80
COUSINS PROPERTIES INC	30,711	1,257,001.23
CUBESMART	40,348	1,277,014.20
CYRUSONE INC	23,460	1,469,065.20
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	41,243	417,379.16
DIGITAL REALTY TRUST INC	43,820	5,620,353.20
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	48,273	388,356.28
DOUGLAS EMMETT INC	34,187	1,448,845.06
DUKE REALTY CORP	76,963	2,778,364.30
EAGLE HOSPITALITY TRUST	202,000	107,060.00
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,641	377,260.92
EASTGROUP PROPERTIES INC	7,876	1,080,350.92
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	30,604	431,516.40
EPR PROPERTIES	16,173	1,169,146.17
EQUINIX INC	17,868	10,577,141.28
EQUITY COMMONWEALTH	25,000	817,500.00
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	38,372	2,765,853.76
EQUITY RESIDENTIAL	72,852	6,029,231.52
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	16,634	443,795.12
ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,888	4,297,919.36
EXTRA SPACE STORAGE INC	27,456	3,045,694.08
FARMLAND PARTNERS INC	4,300	29,154.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,597	1,894,836.57
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,996	1,127,186.56
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,722	407,543.40
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	22,567	176,022.60

FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,903	123,421.96
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	43,129	1,992,128.51
GEO GROUP INC/THE	25,688	416,145.60
GETTY REALTY CORP	7,396	240,517.92
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,890	130,404.60
GLADSTONE LAND CORP	4,008	54,148.08
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,792	115,087.84
GLOBAL NET LEASE INC	18,594	381,177.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	29,687	1,056,560.33
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	42,969	1,379,304.90
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	103,697	3,836,789.00
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,383	99,006.03
HIGHWOODS PROPERTIES INC	21,572	1,082,698.68
HOST HOTELS & RESORTS INC	149,467	2,552,896.36
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	32,209	1,185,935.38
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	18,648	277,295.76
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14,045	323,175.45
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,380	192,208.80
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,215	163,201.20
INVITATION HOMES INC	113,280	3,550,195.20
IRON MOUNTAIN INC	59,789	1,886,342.95
JBG SMITH PROPERTIES	24,811	1,018,491.55
KILROY REALTY CORP	20,350	1,675,822.50
KIMCO REALTY CORP	87,701	1,784,715.35
KITE REALTY GROUP TRUST	17,470	323,893.80
LEXINGTON REALTY TRUST	52,389	571,563.99
LIBERTY PROPERTY TRUST	33,336	2,162,172.96
LIFE STORAGE INC	9,948	1,137,056.40
LTC PROPERTIES INC	8,126	381,515.70
MACERICH CO/THE	22,744	568,600.00
MACK-CALI REALTY CORP	18,538	427,300.90
MANULIFE US REAL ESTATE INV	292,120	297,962.40
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	107,941	2,417,878.40
MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,761	3,254,306.56
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	20,766	310,036.38
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	35,755	2,020,515.05
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,075	422,021.25
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,901	765,129.96
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	16,700	130,761.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,930	238,316.20
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,652	329,519.28
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	46,184	1,999,305.36
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,107	89,170.90

PARAMOUNT GROUP INC	42,453	601,983.54
PARK HOTELS & RESORTS INC	49,767	1,169,524.50
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	27,709	681,641.40
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12,160	54,841.60
PHYSICIANS REALTY TRUST	37,879	741,292.03
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	25,714	596,307.66
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,073	75,961.45
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9,200	121,532.00
PRIME US REIT	111,000	109,890.00
PROLOGIS INC	132,336	12,724,106.40
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,095	699,262.20
PUBLIC STORAGE	31,512	7,073,498.64
QTS REALTY TRUST INC-CL A	12,230	699,678.30
REALTY INCOME CORP	68,437	5,278,545.81
REGENCY CENTERS CORP	34,773	2,217,995.80
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	24,685	432,851.47
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	43,805	573,845.50
RETAIL VALUE INC	3,278	114,205.52
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22,884	1,110,789.36
RLJ LODGING TRUST	35,114	570,251.36
RPT REALTY	15,760	234,036.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,740	1,012,692.40
SABRA HEALTH CARE REIT INC	40,138	890,662.22
SAFEHOLD INC	2,695	121,975.70
SAUL CENTERS INC	2,552	143,652.08
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	6,963	277,545.18
SERVICE PROPERTIES TRUST	33,870	781,042.20
SIMON PROPERTY GROUP INC	64,314	9,313,953.48
SITE CENTERS CORP	31,810	428,480.70
SL GREEN REALTY CORP	17,034	1,590,294.24
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,785	1,077,910.10
STAG INDUSTRIAL INC	29,339	966,133.27
STORE CAPITAL CORP	45,247	1,739,747.15
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	21,560	251,605.20
SUN COMMUNITIES INC	19,520	3,085,331.20
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,904	602,260.48
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	18,355	285,053.15
TAUBMAN CENTERS INC	12,839	398,650.95
TERRENO REALTY CORP	14,004	800,888.76
UDR INC	61,010	2,939,461.80
UMH PROPERTIES INC	7,858	129,106.94
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,637	325,854.09

	URBAN EDGE PROPERTIES	23,225	454,281.00		
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,040	144,960.00		
	VENTAS INC	77,559	4,562,795.97		
	VEREIT INC	225,537	2,187,708.90		
	VICI PROPERTIES INC	95,797	2,552,990.05		
	VORNADO REALTY TRUST	33,442	2,250,981.02		
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	39,549	132,884.64		
	WASHINGTON REIT	16,211	498,001.92		
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	24,705	758,690.55		
	WELLTOWER INC	85,101	7,399,531.95		
	WHitestone REIT	8,928	122,670.72		
	WP CAREY INC	35,876	3,025,781.84		
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	23,068	454,439.60		
アメリカドル合計		5,341,040	212,789,490.58		
			(23,206,821,842)		
カナダドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12,700	701,294.00	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	14,890	179,871.20	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,610	221,648.80	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16,980	965,822.40	
		CHOICE PROPERTIES REIT	30,587	452,687.60	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	18,770	275,168.20	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,630	155,620.80	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	13,500	221,400.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,400	174,840.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6,110	199,980.30	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	21,700	473,060.00	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,600	399,224.00	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	29,009	633,846.65	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	12,700	214,249.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,600	214,438.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,800	94,620.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,400	83,864.00	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	6,650	207,546.50	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13,900	170,136.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	32,370	888,556.50	
		SLATE OFFICE REIT	5,600	33,096.00	
		SLATE RETAIL REIT - U	5,100	68,901.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,300	460,031.00	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,700	186,543.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	9,600	72,864.00	
カナダドル合計		330,206	7,749,308.95		
			(642,727,684)		
	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	76,111	291,505.13	

オースト
ラリアドル

	APN INDUSTRIAL REIT		23,378	70,367.78
	ARENA REIT		68,655	209,397.75
	BWP TRUST		100,913	412,734.17
	CENTURIA METROPOLITAN REIT		79,052	236,365.48
	CHARTER HALL GROUP		95,850	1,209,627.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT		86,760	489,326.40
	CHARTER HALL RETAIL REIT		77,025	359,706.75
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		52,161	184,649.94
	CROMWELL PROPERTY GROUP		384,696	471,252.60
	DEXUS		225,275	2,854,234.25
	GDI PROPERTY GROUP		104,226	159,986.91
	GOODMAN GROUP		333,740	5,012,774.80
	GPT GROUP		400,353	2,382,100.35
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		55,998	242,471.34
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		24,700	82,251.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP		47,671	225,007.12
	MIRVAC GROUP		835,191	2,906,464.68
	NATIONAL STORAGE REIT		155,173	335,173.68
	RURAL FUNDS GROUP		87,545	167,648.67
	SCENTRE GROUP		1,109,390	4,348,808.80
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		196,782	560,828.70
	STOCKLAND		514,530	2,588,085.90
	VICINITY CENTRES		673,432	1,723,985.92
	VIVA ENERGY REIT		97,039	261,034.91
オーストラリアドル合計		5,905,646	27,785,790.03	
			(2,064,484,199)	
イギリス ポンド	投資証券	AEG UK REIT PLC	65,400	64,615.20
		ASSURA PLC	507,104	398,076.64
		BIG YELLOW GROUP PLC	30,985	365,623.00
		BRITISH LAND CO PLC	195,180	1,151,952.36
		CAPITAL & REGIONAL PLC	7,568	17,936.16
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	130,830	128,867.55
		DERWENT LONDON PLC	22,432	930,030.72
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	131,069	132,117.55
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	55,015	521,872.29
		HAMMERSOM PLC	159,504	415,826.92
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	90,584	105,439.77
		INTU PROPERTIES PLC	201,079	37,993.87
		LAND SECURITIES GROUP PLC	156,827	1,521,221.90
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	172,773	396,341.26
		LXI REIT PLC	99,300	135,246.60
		NEWRIVER REIT PLC	59,083	113,675.69

		PICTON PROPERTY INCOME LTD	117,099	118,269.99
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	244,555	388,353.34
		RDI REIT PLC	61,359	81,852.90
		REGIONAL REIT LTD	78,257	90,621.60
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	43,691	349,091.09
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	99,320	54,725.32
		SEGRO PLC	231,029	2,115,763.58
		SHAFTESBURY PLC	46,783	436,719.30
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	68,500	68,226.00
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	351,156	502,153.08
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	176,393	154,520.26
		UNITE GROUP PLC/THE	77,328	1,009,130.40
		WORKSPACE GROUP PLC	26,723	333,235.81
イギリスポンド合計			3,706,926	12,139,500.15 (1,730,000,166)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	407,000	2,010,580.00
		FORTUNE REIT	295,000	2,711,050.00
		LINK REIT	440,500	35,944,800.00
		PROSPERITY REIT	239,000	726,560.00
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	198,000	1,007,820.00
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	305,000	1,607,350.00
香港ドル合計			1,884,500	44,008,160.00 (617,434,484)
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	92,600	134,270.00
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	619,700	1,952,055.00
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	387,874	511,993.68
		CACHE LOGISTICS TRUST	221,100	160,297.50
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	584,000	1,249,760.00
		CAPITALAND MALL TRUST	605,200	1,585,624.00
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	156,100	254,443.00
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	174,700	286,508.00
		ESR-REIT	458,100	256,536.00
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	189,500	137,387.50
		FIRST REAL ESTATE INV TRUST	119,700	119,700.00
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	150,900	430,065.00
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	128,500	213,310.00
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	139,600	99,814.00
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	306,500	373,930.00
		KEPPEL DC REIT	248,600	561,836.00
		KEPPEL REIT	386,900	491,363.00
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	444,600	100,035.00
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	461,300	1,120,959.00

		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	317,900	896,478.00		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	676,000	1,237,080.00		
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	436,000	540,640.00		
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	504,532	282,537.92		
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	76,200	265,176.00		
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,000	61,845.00		
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	130,000	113,750.00		
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	153,600	79,104.00		
		SPH REIT	167,500	182,575.00		
		STARHILL GLOBAL REIT	272,600	198,998.00		
		SUNTEC REIT	471,400	876,804.00		
シンガポールドル合計			9,214,206	14,774,874.60		
				(1,190,854,892)		
ニュー ジーラン ドドル	投資証券	ARGOSY PROPERTY LTD	160,318	230,857.92		
		GOODMAN PROPERTY TRUST	225,617	523,431.44		
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	320,955	507,108.90		
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	228,790	433,557.05		
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	78,628	222,910.38		
ニュージーランドドル合計			1,014,308	1,917,865.69		
				(137,741,113)		
韓国ウォン	投資証券	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,000	37,550,000.00		
韓国ウォン合計			5,000	37,550,000.00		
				(3,507,170)		
イスラエルシェケル	投資証券	REIT 1 LTD	34,180	724,957.80		
イスラエルシェケル合計			34,180	724,957.80		
				(22,865,169)		
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	5,203	635,806.60		
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	32,204	568,722.64		
		ALTAREA	785	164,065.00		
		BEFIMMO	4,665	253,776.00		
		COFINIMMO	5,101	716,180.40		
		COVIVIO	9,120	984,960.00		
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	8,655	207,893.10		
		GECINA SA	11,584	1,961,171.20		
		HAMBORNER REIT AG	15,414	156,452.10		
		HIBERNIA REIT PLC	149,002	210,986.83		
		ICADE	5,915	588,246.75		
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,678	53,977.16		
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50,033	601,896.99		
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5,222	139,949.60		
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	84,159	140,545.53		

KLEPIERRE	43,173	1,408,734.99
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI	14,866	101,832.10
MERCIALYS	5,633	66,018.76
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	76,761	999,428.22
MONTEA	2,242	190,121.60
NSI NV	3,711	168,293.85
RETAIL ESTATES	2,498	211,830.40
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,639	3,780,348.00
VASTNED RETAIL NV	4,067	100,251.55
WAREHOUSES DE PAUW SCA	26,236	657,211.80
WERELDHAVE NV	7,854	143,021.34
ユーロ合計	611,420	15,211,722.51 (1,829,970,217)
合計		31,446,406,936 (31,446,406,936)

(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 158銘柄	100.00%	73.80%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.00%	2.04%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.00%	6.57%
イギリスポンド	投資証券 29銘柄	100.00%	5.50%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.00%	1.96%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.00%	3.79%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.00%	0.44%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.00%	0.01%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.00%	0.07%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.00%	5.82%

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。

2【ファンドの現況】

【eMAXIS バランス(波乗り型)】

【純資産額計算書】

令和 2年 1月31日現在
(単位:円)

資産総額	4,123,246,881
負債総額	4,584,166
純資産総額(-)	4,118,662,715
発行済口数	2,114,370,393口
1口当たり純資産価額(/)	1.9479
(10,000口当たり)	(19,479)

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 1月31日現在
(単位:円)

資産総額	448,646,213,351
負債総額	81,550,145,175
純資産総額(-)	367,096,068,176
発行済口数	198,008,893,809口
1口当たり純資産価額(/)	1.8539
(10,000口当たり)	(18,539)

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 1月31日現在
(単位:円)

資産総額	612,366,733,429
負債総額	18,181,645,229
純資産総額(-)	594,185,088,200
発行済口数	190,272,633,982口

1口当たり純資産価額(/)	3.1228
(10,000口当たり)	(31,228)

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

令和 2年 1月31日現在

(単位:円)

資産総額	113,997,115,416
負債総額	1,004,375,748
純資産総額(-)	112,992,739,668
発行済口数	44,750,603,673口
1口当たり純資産価額(/)	2.5249
(10,000口当たり)	(25,249)

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 1月31日現在

(単位:円)

資産総額	640,705,916,069
負債総額	7,288,837,982
純資産総額(-)	633,417,078,087
発行済口数	464,771,616,512口
1口当たり純資産価額(/)	1.3629
(10,000口当たり)	(13,629)

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 1月31日現在

(単位:円)

資産総額	148,277,862,765
負債総額	367,254,845
純資産総額(-)	147,910,607,920
発行済口数	68,766,675,373口
1口当たり純資産価額(/)	2.1509

(10,000口当たり)	(21,509)
--------------	----------

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

令和2年1月31日現在

(単位:円)

資産総額	30,678,015,783
負債総額	167,265,510
純資産総額(-)	30,510,750,273
発行済口数	21,344,097,946口
1口当たり純資産価額(/)	1.4295
(10,000口当たり)	(14,295)

東証REIT指数マザーファンド

純資産額計算書

令和2年1月31日現在

(単位:円)

資産総額	45,513,200,971
負債総額	9,947,575,508
純資産総額(-)	35,565,625,463
発行済口数	9,602,958,627口
1口当たり純資産価額(/)	3.7036
(10,000口当たり)	(37,036)

MUAM G-REITマザーファンド

純資産額計算書

令和2年1月31日現在

(単位:円)

資産総額	31,889,214,365
負債総額	215,851,433
純資産総額(-)	31,673,362,932
発行済口数	16,737,983,932口
1口当たり純資産価額(/)	1.8923
(10,000口当たり)	(18,923)

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

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。

上記 の申請のある場合には、上記 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 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。

上記 の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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

2020年1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

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。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、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。

運用計画の決定

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。

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。

投資行動のモニタリング1

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、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、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、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、必要に応じて是正を指示します。

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、リスク管理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。

運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信

託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2020年1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	895	13,937,414
追加型公社債投資信託	16	1,322,460
単位型株式投資信託	68	313,027
単位型公社債投資信託	11	64,880
合計	990	15,637,781

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

3 【委託会社等の経理状況】

（1）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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

（2）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度に係る中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
(資産の部)	

流動資産

現金及び預金	2	54,140,307	2	53,969,686
有価証券		19,967		1,403,513
前払費用		362,886		514,587
未収入金		2,109		2,284
未収委託者報酬		9,770,529		9,995,458
未収収益	2	674,156	2	560,483
金銭の信託	2	30,000	2	100,000
その他		224,645		153,256
流動資産合計		65,224,602		66,699,271

固定資産

有形固定資産				
建物	1	760,010	1	617,032
器具備品	1	724,852	1	665,247
土地		1,356,000		628,433
有形固定資産合計		2,840,863		1,910,713
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		2,654,296		3,670,753
ソフトウェア仮勘定		1,097,970		536,345
無形固定資産合計		3,768,090		4,222,921
投資その他の資産				
投資有価証券		26,361,327		21,408,781
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産		-	1	824,268
長期差入保証金		627,141		593,536
前払年金費用		434,700		415,234
繰延税金資産		1,237,989		1,496,180
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		29,002,925		25,079,767
固定資産合計		35,611,879		31,213,401
資産合計		100,836,481		97,912,673

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	359,176	293,258
未払金		
未払収益分配金	174,333	170,281
未払償還金	456,159	448,695
未払手数料	2	3,905,670
その他未払金	2	4,330,584
未払費用	2	4,388,803
未払消費税等		99,010
未払法人税等		736,829
賞与引当金		906,167

役員賞与引当金	125,343	140,100
その他	842,194	868,992
流動負債合計	16,324,272	15,346,788
固定負債		
長期未払金	-	43,200
退職給付引当金	720,536	860,851
役員退職慰労引当金	187,562	144,303
時効後支払損引当金	254,851	247,767
固定負債合計	1,162,951	1,296,122
負債合計	17,487,223	16,642,910

(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	27,790,911	26,069,594
利益剰余金合計	35,131,500	33,410,184
株主資本合計	81,864,344	80,143,028

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,484,913	1,126,733
評価・換算差額等合計	1,484,913	1,126,733
純資産合計	83,349,257	81,269,762
負債純資産合計	100,836,481	97,912,673

(2)【損益計算書】

	(単位：千円)	
	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	75,423,596	70,375,414
投資顧問料	2,723,458	2,505,299
その他営業収益	48,215	18,844
営業収益合計	78,195,269	72,899,557
営業費用		
支払手数料	2	30,906,879
広告宣伝費		730,784
		2
		28,533,952
		739,643

公告費	1,000	500
調査費		
調査費	1,723,057	1,794,755
委託調査費	13,467,029	12,194,996
事務委託費	864,916	1,016,816
営業雑経費		
通信費	178,652	170,794
印刷費	467,973	427,442
協会費	50,251	48,375
諸会費	15,328	16,175
事務機器関連費	1,635,079	1,841,631
その他営業雑経費	23,250	-
営業費用合計	50,064,204	46,785,083
一般管理費		
給料		
役員報酬	349,359	349,083
給料・手当	6,421,837	6,453,717
賞与引当金繰入	906,167	901,135
役員賞与引当金繰入	125,343	140,100
福利厚生費	1,231,033	1,234,293
交際費	13,012	13,011
旅費交通費	192,192	200,426
租税公課	410,229	373,201
不動産賃借料	678,182	654,886
退職給付費用	423,171	428,912
役員退職慰労引当金繰入	47,889	51,159
固定資産減価償却費	1,115,719	1,252,321
諸経費	450,299	523,213
一般管理費合計	12,364,437	12,575,461
営業利益	15,766,627	13,539,012

(単位：千円)

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	349,402	181,073
受取利息	2 483	2 1,913
投資有価証券償還益	81,580	416,706
収益分配金等時効完成分	91,672	44,392
受取賃貸料	-	2 38,388
その他	9,989	11,871
営業外収益合計	533,128	694,346
営業外費用		
投資有価証券償還損	30,114	118,173
時効後支払損引当金繰入	43,182	1,166
事務過誤費	10,402	420
賃貸関連費用	-	35,994
その他	3,829	1,481
営業外費用合計	87,529	157,235

経常利益		16,212,226		14,076,123
特別利益				
投資有価証券売却益		516,394		501,778
ゴルフ会員権売却益		7,495		
特別利益合計		523,889		501,778
特別損失				
投資有価証券売却損		105,903		135,399
投資有価証券評価損		102,096		62,310
固定資産除却損	1	54	1	4,848
固定資産売却損		-		225
システム関連費		-		322,986
商標使用料		-		90,000
特別損失合計		208,054		615,770
税引前当期純利益		16,528,061		13,962,130
法人税、住民税及び事業税	2	5,252,224	2	4,420,179
法人税等調整額		76,092		100,112
法人税等合計		5,176,132		4,320,066
当期純利益		11,351,928		9,642,064

(3)【株主資本等変動計算書】

第33期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

(単位:千円)

資本金	株主資本							株主資本合計	
	資本剰余金			利益剰余金			その他利益剰余金		
	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147
当期変動額									
剰余金の配当							26,595,731	26,595,731	26,595,731
当期純利益							11,351,928	11,351,928	11,351,928
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計							15,243,802	15,243,802	15,243,802
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344

	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	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
当期純利益			11,351,928
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	9,673	9,673	9,673
当期変動額合計	9,673	9,673	15,253,476
当期末残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本		
	資本剰余金	利益剰余金	その他利益剰余金

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344
当期変動額									
剰余金の配当							11,363,380	11,363,380	11,363,380
当期純利益							9,642,064	9,642,064	9,642,064
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計							1,721,316	1,721,316	1,721,316
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028

	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	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
当期純利益			9,642,064
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	358,179	358,179	358,179
当期変動額合計	358,179	358,179	2,079,495
当期末残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762

[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

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 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、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに平成28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～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 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。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

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。

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。

5.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項**(1)消費税等の会計処理**

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)**「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用**

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」490,903千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,237,989千円に含めて表示しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価

中であります。

(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33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
建物	604,123千円	551,025千円
器具備品	1,215,234千円	1,350,407千円
投資不動産		138,024千円

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33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
預金	41,809,118千円	240,211千円
未収収益	40,621千円	25,307千円
金銭の信託	30,000千円	100,000千円
未払手数料	1,577,059千円	671,568千円
その他未払金	3,850,734千円	3,217,341千円
未払費用	430,491千円	444,754千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
建物		2,547千円
器具備品	54千円	2,301千円
計	54千円	4,848千円

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
支払手数料	11,380,244千円	5,298,064千円
受取利息	380千円	3千円
受取賃貸料		38,388千円
法人税、住民税及び事業税	3,851,536千円	3,216,517千円

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 平成29年4月1日 至 平成30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

平成29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。

配当金の総額	26,595,731千円
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29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
平成30年6月27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。

配当金の総額	11,363,380千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28日

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31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

平成30年6月27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。

配当金の総額	11,363,380千円
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和元年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33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
1年内	678,116千円	675,956千円
1年超	1,351,912千円	675,956千円
合計	2,030,029千円	1,351,912千円

(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、譲渡性預金または投資信託に限定しており、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。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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があります。

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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれてありません(注2)参照)。

第33期(平成30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) 現金及び預金	54,140,307	54,140,307	-
(2) 有価証券	19,967	19,967	-
(3) 未収委託者報酬	9,770,529	9,770,529	-
(4) 投資有価証券	26,224,167	26,224,167	-
資産計	90,154,972	90,154,972	-
(1) 未払手数料	3,905,670	3,905,670	-
負債計	3,905,670	3,905,670	-

第34期(平成31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) 現金及び預金	53,969,686	53,969,686	-
(2) 有価証券	1,403,513	1,403,513	-
(3) 未収委託者報酬	9,995,458	9,995,458	-
(4) 投資有価証券	21,353,421	21,353,421	-
資産計	86,722,080	86,722,080	-
(1) 未払手数料	3,990,054	3,990,054	-
負債計	3,990,054	3,990,054	-

(注1)金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負債

(1)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
非上場株式	137,160	55,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載していません。

(注3)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33期(平成30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	54,140,307	-	-	-
未収委託者報酬	9,770,529	-	-	-
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	19,967	13,110,758	8,593,680	68,714
合計	63,930,804	13,110,758	8,593,680	68,714

第34期(平成31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	53,969,686	-	-	-
未収委託者報酬	9,995,458	-	-	-
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	1,403,513	9,358,708	5,874,634	90,573
合計	65,368,659	9,358,708	5,874,634	90,573

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載していません。

2. その他有価証券

第33期(平成30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	18,599,111	16,040,884	2,558,227
	小計	18,599,111	16,040,884	2,558,227
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	7,645,023	8,062,990	417,966
	小計	7,645,023	8,062,990	417,966
合計		26,244,135	24,103,874	2,140,260

第34期(平成31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	14,744,545	12,559,380	2,185,164
	小計	14,744,545	12,559,380	2,185,164
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	8,012,389	8,573,551	561,161
	小計	8,012,389	8,573,551	561,161
合計		22,756,935	21,132,932	1,624,002

3. 売却したその他有価証券

第33期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	8,169,769	516,394	105,903
合計	8,169,769	516,394	105,903

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31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	140,240	58,440	-
債券	-	-	-
その他	5,222,594	443,338	135,399
合計	5,362,834	501,778	135,399

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102,096千円(その他有価証券のその他102,096千円)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62,310千円(その他有価証券のその他62,310千円)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33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,649,089 千円	3,729,252 千円
勤務費用	184,120	193,531
利息費用	27,829	24,351
数理計算上の差異の発生額	56,895	15,898
退職給付の支払額	188,683	218,947
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,729,252	3,712,289

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
年金資産の期首残高	2,698,738 千円	2,723,393 千円
期待運用収益	48,080	48,664
数理計算上の差異の発生額	47,759	4,606
事業主からの拠出額	102,564	102,564
退職給付の支払額	173,748	203,077
年金資産の期末残高	2,723,393	2,666,937

(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33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,374,562 千円	3,125,760 千円
年金資産	2,723,393	2,666,937
	651,168	458,822
非積立型制度の退職給付債務	354,690	586,529
未積立退職給付債務	1,005,858	1,045,351
未認識数理計算上の差異	169,893	114,968
未認識過去勤務費用	550,128	484,766
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	285,836	445,616
退職給付引当金	720,536	860,851
前払年金費用	434,700	415,234
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	285,836	445,616

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
勤務費用	184,120 千円	193,531 千円
利息費用	27,829	24,351
期待運用収益	48,080	48,664
数理計算上の差異の費用処理額	47,053	43,633
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	4,780	5,986
確定給付制度に係る退職給付費用	281,066	284,199

(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等です。

(5)年金資産に関する事項

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33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
債券	62.2 %	63.9 %
株式	34.7	33.2
その他	3.1	2.9
合計	100	100

長期期待運用收益率の設定方法

年金資産の長期期待運用收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收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33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
割引率	0.069 ~ 0.67%	0.035 ~ 0.49%
長期期待運用收益率	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142,105千円、当事業年度144,712千円であります。

(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33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	445,379千円	436,050千円
投資有価証券評価損	223,512	223,821
未払事業税	135,805	109,109
賞与引当金	277,468	275,927
役員賞与引当金	12,235	19,428
役員退職慰労引当金	57,431	44,185
退職給付引当金	220,628	263,592
減価償却超過額	13,690	157,741
委託者報酬	257,879	264,398
長期差入保証金	23,262	31,721
時効後支払損引当金	78,035	75,866
連結納税適用による時価評価	200,331	148,858
その他	82,168	71,320
繰延税金資産 小計	2,027,829	2,122,023
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,027,829	2,122,023
繰延税金負債		
前払年金費用	133,105	127,144
連結納税適用による時価評価	1,382	1,320
その他有価証券評価差額金	655,348	497,269
その他	4	108
繰延税金負債 合計	789,840	625,842
繰延税金資産の純額	1,237,989	1,496,180

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33期(平成30年3月31日現在)及び第34期(平成31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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第33期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)及び第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31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33期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)及び第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

1.製品及びサービスごとの情報

单一の製品・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33期(自 平成29年4月1日 至 平成30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4)	科目	期末残高(注4)
親会社	株三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,851,587 千円	その他未払金	3,850,734 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	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)	5,528,131 千円	未払手数料	665,262 千円
主要株主	株三菱東京 UFJ銀行 (注5)	東京都 千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	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)	664,152 千円	未払費用	348,142 千円

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31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4)	科目	期末残高(注4)
親会社	株三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,216,517 千円	その他未払金	3,217,341 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)	5,298,064 千円	未払手数料	671,568 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	695,834 千円	未払費用	365,510 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
4. 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。
5. ㈱三菱東京UFJ銀行は、平成30年4月1日付で、㈱三菱UFJ銀行に行名を変更しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第33期(自 平成29年4月1日 至 平成30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4)	科目	期末残高 (注4)
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2)	6,263,571 千円	未払手数料	907,290 千円

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31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4)	科目	期末残高(注 4)
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 (注1)	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)	4,629,670 千円	未払手数料	734,633 千円
						取引銀行	コーラブル預 金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び 預金	20,000,000千 円
							コーラブル預 金に係る受取 利息 (注3)	1,578 千円	未収収益	1,578 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(株)	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2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. (株)三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを(株)三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、(株)三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。
なお、(株)三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行(株)に対して承継させております。
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. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
4. 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33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	393,935.45円	384,107.08円
1株当たり当期純利益金額	53,652.87円	45,571.50円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
当期純利益金額(千円)	11,351,928	9,642,064
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)	11,351,928	9,642,064
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581	211,581

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

第35期中間会計期間

(令和元年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

現金及び預金

46,350,665

有価証券		3,906,355
前払費用		620,446
未収入金		8,561
未収委託者報酬		10,170,592
未収収益		585,312
金銭の信託		100,000
その他		134,705
流動資産合計		61,876,640

固定資産

有形固定資産		
建物	1	603,277
器具備品	1	794,065
土地		628,433
有形固定資産合計		2,025,776
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		3,390,287
ソフトウェア仮勘定		1,024,221
無形固定資産合計		4,430,330
投資その他の資産		
投資有価証券		18,792,024
関係会社株式		320,136
投資不動産	1	822,988
長期差入保証金		579,291
前払年金費用		420,773
繰延税金資産		1,420,372
その他		45,230
貸倒引当金		23,600
投資その他の資産合計		22,377,216
固定資産合計		28,833,324
資産合計		90,709,964

(単位：千円)

第35期中間会計期間

(令和元年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債		
預り金		290,587
未払金		
未払収益分配金		131,632
未払償還金		424,093
未払手数料		4,009,808
その他未払金		2,100,383
未払費用		3,020,441
未払消費税等	2	381,045
未払法人税等		651,051
賞与引当金		924,061
役員賞与引当金		62,295
その他		900,753
流動負債合計		12,896,152

固定負債

長期未払金		32,400
退職給付引当金		940,446
役員退職慰労引当金		107,709

時効後支払損引当金	243,873
固定負債合計	1,324,430
負債合計	14,220,582

(純資産の部)

株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	21,264,872
利益剰余金合計	28,605,462
株主資本合計	75,338,306

(単位：千円)

第35期中間会計期間

(令和元年9月30日現在)

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,151,075
評価・換算差額等合計	1,151,075
純資産合計	76,489,381
負債純資産合計	90,709,964

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第35期中間会計期間

(自 平成31年4月1日

至 令和元年9月30日)

営業収益

委託者報酬	34,073,281
投資顧問料	1,143,410
その他営業収益	8,361
営業収益合計	35,225,053

営業費用

支払手数料	13,714,724
広告宣伝費	252,678
公告費	250
調査費	
調査費	911,961
委託調査費	5,769,907
事務委託費	351,511
営業雑経費	
通信費	78,084
印刷費	218,610
協会費	25,207
諸会費	8,034
事務機器関連費	931,984
営業費用合計	22,262,956
一般管理費	
給料	

役員報酬	177,096
給料・手当	2,873,051
賞与引当金繰入	924,061
役員賞与引当金繰入	62,295
福利厚生費	635,789
交際費	4,597
旅費交通費	97,388
租税公課	193,484
不動産賃借料	327,917
退職給付費用	212,710
役員退職慰労引当金繰入	25,108
固定資産減価償却費	1
諸経費	647,817
一般管理費合計	177,080
営業利益	6,358,399
	6,603,697

(単位：千円)

第35期中間会計期間

(自 平成31年4月1日

至 令和元年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	34,517
受取利息	2,101
投資有価証券償還益	327,868
収益分配金等時効完成分	73,834
受取貸貸料	32,904
その他	15,364
営業外収益合計	486,590
営業外費用	
投資有価証券償還損	46,457
賃貸関連費用	1
その他	12,337
営業外費用合計	175
経常利益	58,970
特別利益	7,031,318
投資有価証券売却益	53,850
特別利益合計	53,850
特別損失	
投資有価証券売却損	36,721
投資有価証券評価損	17,395
固定資産除却損	37
固定資産売却損	435
特別損失合計	54,589
税引前中間純利益	7,030,579
法人税、住民税及び事業税	2,095,061
法人税等調整額	65,064
法人税等合計	2,160,126
中間純利益	4,870,453

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間(自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)

(単位：千円)

株主資本

	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	別途積立金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当中間期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
中間純利益							4,870,453	4,870,453	4,870,453
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計							4,804,722	4,804,722	4,804,722
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	21,264,872	28,605,462	75,338,306

	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	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当中間期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
中間純利益			4,870,453
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	24,341	24,341	24,341
当中間期変動額合計	24,341	24,341	4,780,380
当中間期末残高	1,151,075	1,151,075	76,489,381

[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

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 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、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに平成28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～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 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。

す。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

第35期中間会計期間
(令和元年9月30日現在)

建物	575,110千円
器具備品	1,377,937千円
投資不動産	141,659千円

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

第35期中間会計期間
(自 平成31年4月1日
至 令和元年9月30日)

有形固定資産	85,187千円
無形固定資産	562,630千円
投資不動産	3,634千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和元年6月27日

(リース取引関係)

第35期中間会計期間(令和元年9月30日現在)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	675,956千円
1年超	337,978千円
合 計	1,013,934千円

(金融商品関係)

第35期中間会計期間(令和元年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

令和元年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません((注2)参照)。

	中間貸借対照表計 上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	46,350,665	46,350,665	-
(2) 有価証券	3,906,355	3,906,355	-
(3) 未収委託者報酬	10,170,592	10,170,592	-
(4) 投資有価証券	18,736,664	18,736,664	-
資産計	79,164,277	79,164,277	-
(1) 未払手数料	4,009,808	4,009,808	-
負債計	4,009,808	4,009,808	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 产

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額に

よっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額55,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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があります。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間（令和元年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 (千円)	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	16,466,321	14,354,198	2,112,123
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	小計	16,466,321	14,354,198	2,112,123
	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
その他	その他	6,176,697	6,629,733	453,035
	小計	6,176,697	6,629,733	453,035
合計		22,643,019	20,983,931	1,659,087

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額55,360千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について17,395千円（その他有価証券のその他17,395千円）減損処理を行っております。

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1) 株当たり情報

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (令和元年9月30日現在)
1株当たり純資産額	361,513.47円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	76,489,381
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	76,489,381
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	23,019.33円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	4,870,453
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	4,870,453
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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。)。

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。)。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)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。

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する運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要的取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記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】

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。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（2019年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社山形銀行	12,008 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社武蔵野銀行	45,743 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社横浜銀行	215,628 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社福島銀行	18,127 百万円	銀行業務を営んでいます。
a u カブコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エース証券株式会社	8,831 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	2,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ぐんぎん証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
GMOクリック証券株式会社	4,346 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
東洋証券株式会社	13,494 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

浜銀TT証券株式会社	3,307 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ひろぎん証券株式会社	5,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	9,257 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
FFG証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

- (1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。
- (2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3 【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2020年1月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 4月26日	有価証券届出書
2019年 4月26日	有価証券報告書
2019年10月25日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年10月25日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

令和元年6月26日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 青木裕晃印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 伊藤鉄也印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成31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すべ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。

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)上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和2年2月26日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畠 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

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）の平成31年1月29日から令和2年1月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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）の令和2年1月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

利害関係

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和元年12月3日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 青木 裕晃 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和元年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手續が実施される。中間監査手續は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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續に必要に応じて追加の監査手續が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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續を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関する内部統制を検討する。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の令和元年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成31年4月1日から令和元年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。