

【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5月1日提出
【計算期間】	第3期(自 2019年2月6日至 2020年2月5日)
【ファンド名】	国内株式セレクション（ラップ向け）
【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、主として値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり (フル ヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	(隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX その他 ()	条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式一般))						
資産複合 ()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<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せん。

商品分類の定義

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

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動(一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。)を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型/絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を含む世界の株式を実質的な主要投資対象とし、主として値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色1

投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式に実質的な投資を行います。

- 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2020年5月2日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<TOPIXマザーファンド>

東京証券取引所第一部に上場されている日本の株式への投資を行います。

- ・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。
- ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)をベンチマークとします。
- ・対象インデックスとの連動を維持するため、株式(株価指数先物取引等を含む)の実質投資比率は信託財産の純資産総額を超える場合があります。

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

日本の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)への投資を行います。

- ・JPX日経インデックス400(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・JPX日経インデックス400(配当込み)をベンチマークとします。
- ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。

<日本株インカム・マザーファンド>

日本の株式への投資を行います。

- ・主として東京証券取引所第一部(以下、東証一部)上場株式に投資しますが、東京証券取引所第二部上場株式およびJASDAQ上場株式等に投資する場合があります。
- ・主として、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、「高水準の配当収入」と「中長期的な株価の値上がり益」の獲得をめざして運用を行います。

<JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド>

日本の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)への投資を行います。

- ・iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)をベンチマークとします。
- ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。

<日本株オープン[35]マザーファンド>

日本の株式を主要投資対象とし、「企業の成長性」に着目して厳選した「35銘柄」に主に投資します。

- ・「35銘柄」とは、中長期的な事業の収益性・成長性が見込まれ、かつ十分な投資成果が期待できると判断し選別した銘柄群です。
- ・「35銘柄」に絞り込んで投資することで、全産業に投資するよりも高いパフォーマンスをめざします。また、より綿密な情報分析と継続フォローの徹底を図ります。

<日本・小型株・ファンド・マザーファンド>

日本の小型株式の中から、「成長性が高いと判断される銘柄」を綿密な企業調査により厳選して投資します。

- ・原則、JASDAQ上場株式、東京証券取引所第二部上場株式、および東京証券取引所第一部上場株式を中心に投資します。
- ・目標株価への到達もしくは接近、ファンダメンタルズの変化、新規投資候補銘柄との相対比較等を勘案し、組入銘柄は適宜入れ替えます。
- ・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスをベンチマークとします。

<日本株式最小分散インデックスマザーファンド>

日本の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

- ・MSCI日本株最小分散指数(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・MSCI日本株最小分散指数(配当込み)をベンチマークとします。
- ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。

<ジャパン・アクティブ・マザーファンド>

日本の株式を主要投資対象とします。

- ・日本の株式の中から、「資産・利益等と比較して株価が割安と判断され、かつ、優れたマネジメント力で継続的な利益成長や企業再生・復活が期待できる銘柄」を厳選し投資します。
- ・東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

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

特色
2

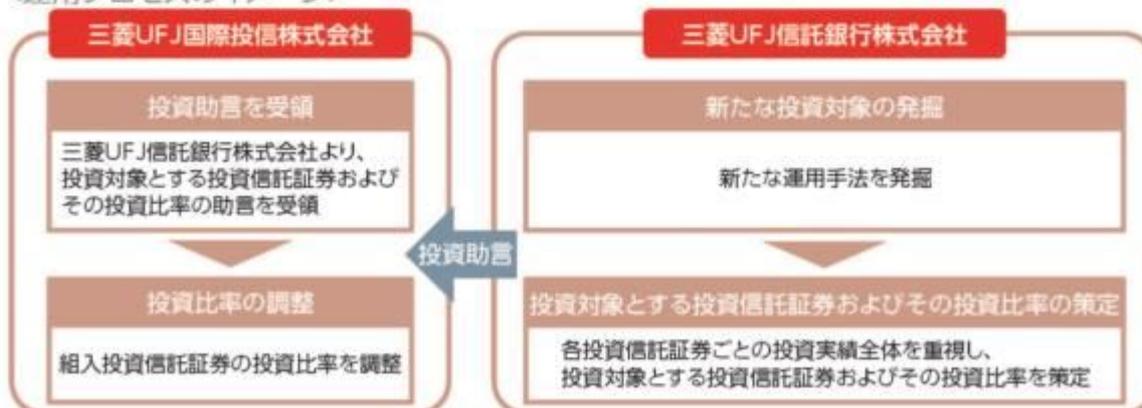
三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

① 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、投資環境の変化等に応じて適宜変更します。

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

<運用プロセスのイメージ>



① 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>)をご覧ください。

特色3

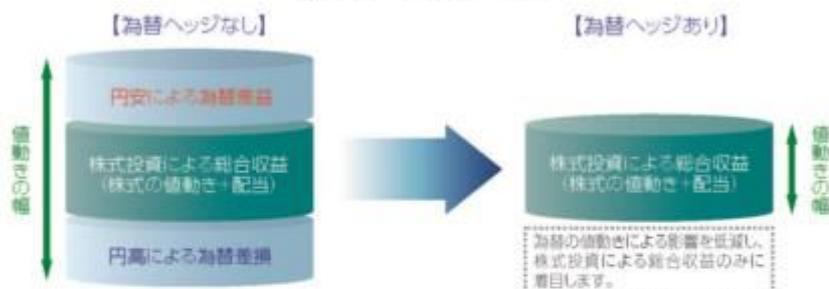
実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。

- 1 為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

<投資リターンのイメージ図>



- 1 上記は為替ヘッジを理解して頂くためのイメージ図であり、ファンドの将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

特色4

年1回の決算時(2月5日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

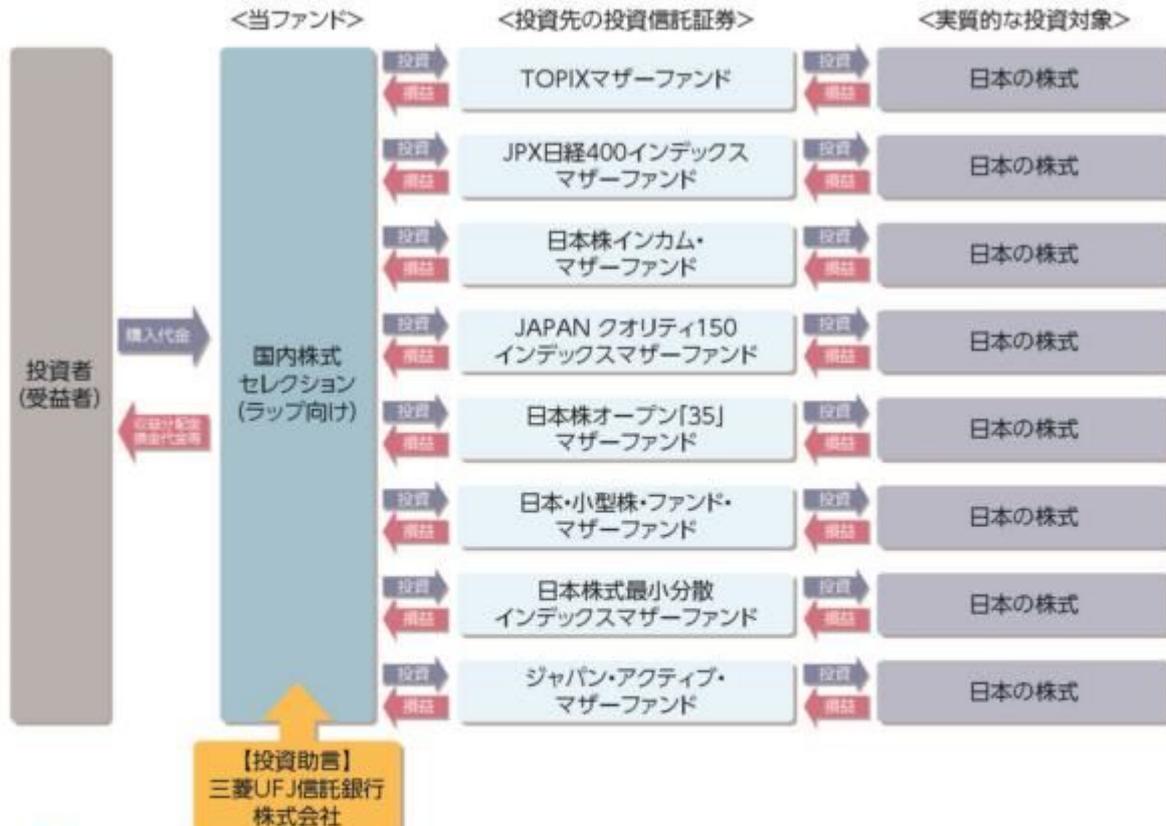
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



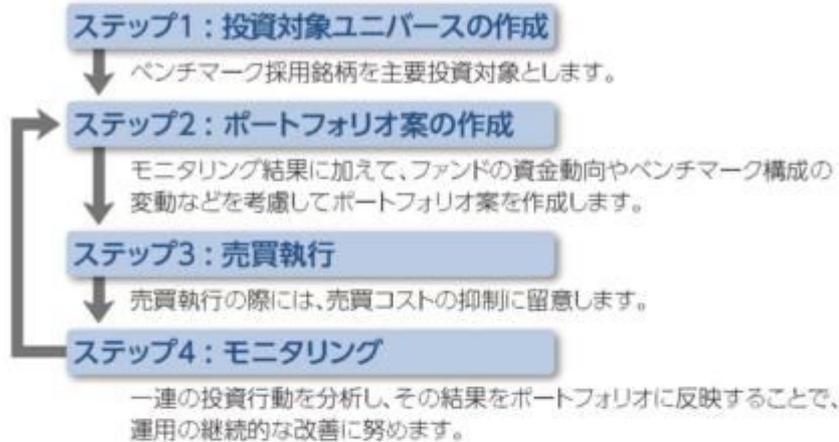
- ❗ 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
- ❗ 上記の投資対象とする投資信託証券は、今後変更される場合があります。

■主な投資制限

株式	株式への直接投資は行いません。
投資信託証券	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	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

■各投資信託証券の運用プロセス

<TOPIXマザーファンド/JPX日経400インデックスマザーファンド/JAPAN クオリティ150
インデックスマザーファンド/日本株式最小分散インデックスマザーファンド>



1 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。

<日本株インカム・マザーファンド>

- ポートフォリオの構築にあたっては、銘柄分散を意識し、適宜組入銘柄の入替を行います。
- 株式の組入比率は原則として高位を維持します。
- 予想配当利回りとは、一株当たりの予想配当金(年間)を株価で割って求められる指標です。
- 予想配当利回りの市場平均とは、時価総額考慮後の東証一部上場銘柄の平均予想配当利回りです。

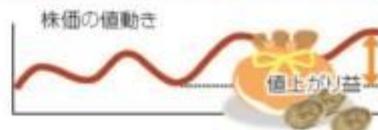
ファンドの主な収益の源泉

I. 高水準の配当収入



予想配当利回りが原則として市場平均以上の銘柄群の中から選別投資し、高水準の配当収入の獲得をめざします。

II. 中長期的な株価の値上がり益



徹底した企業分析を行うことで、割安な銘柄に投資し、中長期的な株価の値上がり益の獲得をめざします。

<組入銘柄選定プロセスについて>



1 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、こうした企業が必ず利益成長を達成し、株価が上昇するわけではなく、環境によっては業績が悪化し、株価が下落することがある点にご留意ください。

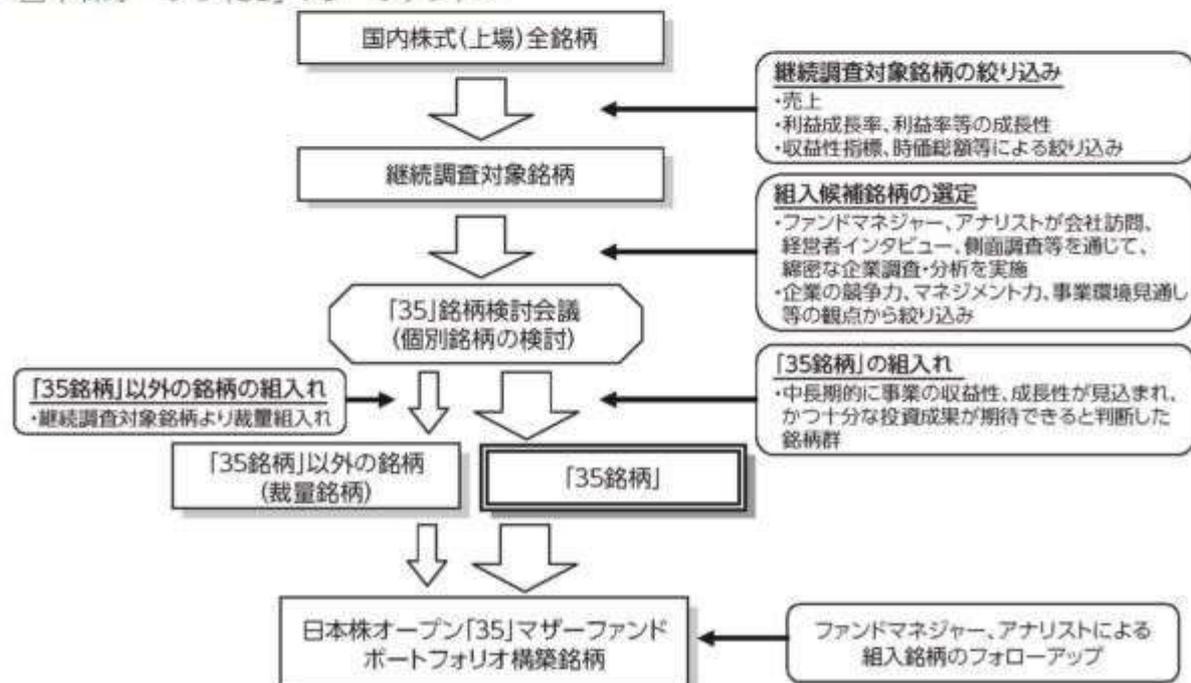
1 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

◆ PBR、PERは株価がどの程度の水準にあるかを評価する指標です。

□ PBR(株価純資産倍率)……PBRとは、Price Book-value Ratioの略で、株価を1株当たり純資産で割って求められる指標です。この数値が低いほど企業の資産価値と比較して株価は割安だと評価されます。

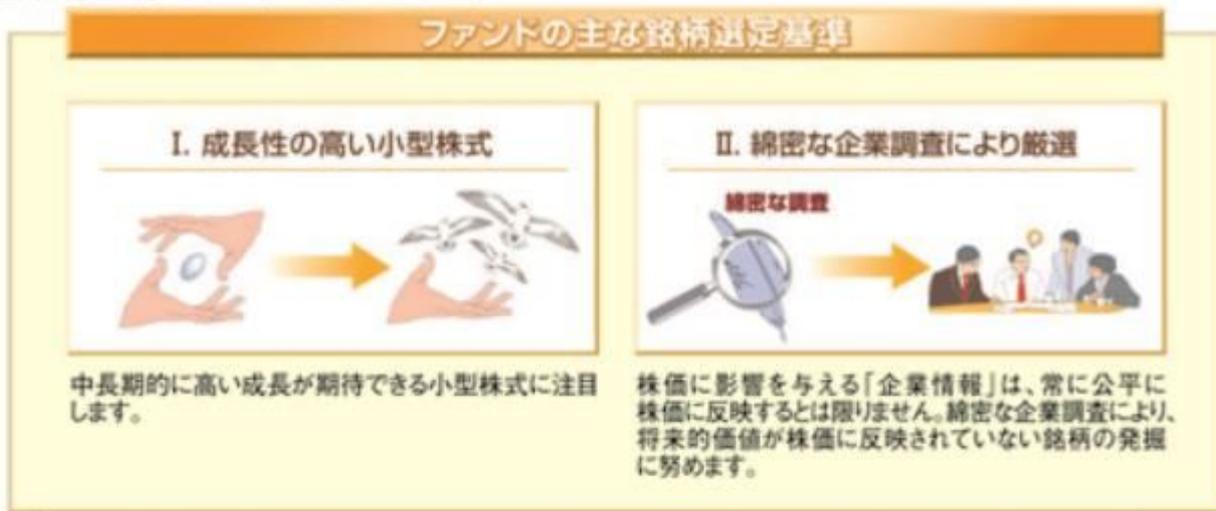
□ PER(株価収益率)……PERとは、Price Earnings Ratioの略で、株価を1株当たり利益で割って求められる指標です。この数値が低いほど収益性と比較して株価は割安だと評価されます。

<日本株オープン「35」マザーファンド>



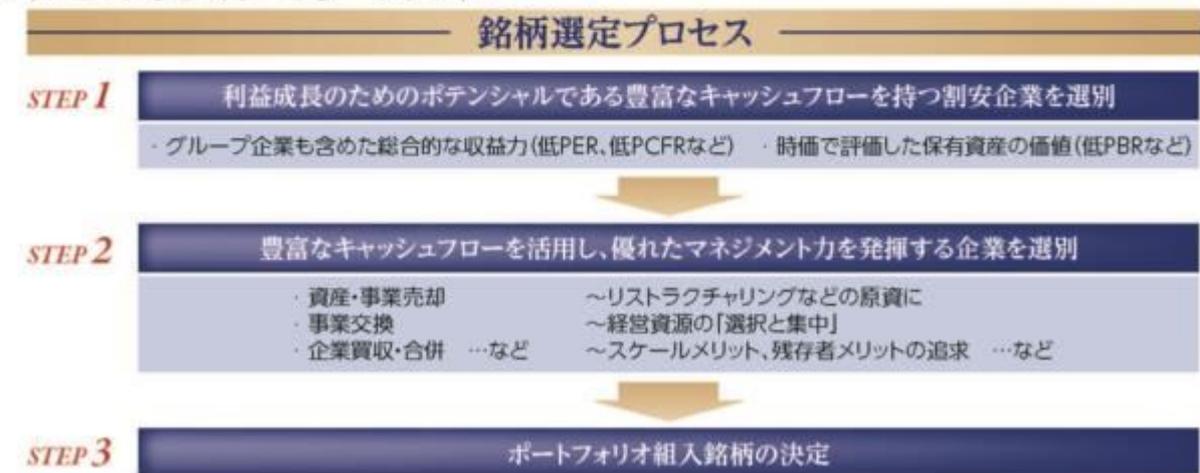
1 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、こうした企業が必ず利益成長を達成し、株価が上昇するわけではなく、環境によっては業績が悪化し、株価が下落することがある点にご留意ください。

<日本・小型株・ファンド・マザーファンド>



❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

<ジャパン・アクティブ・マザーファンド>



❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。



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。同指数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。
- ・JPX日経インデックス400(配当込み)とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。同指数は株式会社日本取引所グループ、株式会社東京証券取引所及び株式会社日本経済新聞社の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、当該3社に帰属します。
- ・iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)とは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、流動性によりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し、高ROEの継続性を評価して150銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)は、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとSTOXXリミテッド(以下「STOXX社」)が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。2001年6月18日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。
- ・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスは、RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスを構成するインデックスの一つです。RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスは、わが国の全金融商品取引所全上場銘柄の全時価総額(時価総額は全て安定持株控除後)の98%超をカバーするRUSSELL/NOMURA Total Marketインデックスのうち、時価総額下位約15%の銘柄により構成されています。RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスは、Frank Russell Companyと野村證券株式会社が作成している株価指数で、当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- ・MSCI日本株最小分散指数(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、J-REITを除いた日本株式を対象に、ボラティリティ(価格変動率)が最も小さくなるように各銘柄の構成比率を決定し算出した指数です。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年3月13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
投資対象ファンド
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いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況（2020年2月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

投資信託証券を主要投資対象とします。

投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式に実質的な投資を行います。

三菱UFJ信託銀行株式会社の助言に基づき、投資先ファンドの投資実績全体を重視し、ファンドを選定します。

投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。

投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【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．約束手形
 - ハ．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、別に定める投資信託証券（投資信託および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。））ならびに投資証券および外国投資証券（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。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。

- 1．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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の新株引受権証券を除きます。）
- 2．コマーシャル・ペーパー
- 3．外国または外国の者の発行する証券または証書で、2．の証券の性質を有するもの
- 4．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）

なお、1．の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

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きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

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

< 投資信託証券の概要 >

ファンド名	TOPIXマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・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。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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。
運用管理費用（信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2001年3月26日
決算日	原則として毎年3月25日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	JPX日経400インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・株式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の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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（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は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・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。
運用管理費用（信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2014年4月1日
決算日	原則として毎年1月26日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本株インカム・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として東京証券取引所第一部上場株式の中から、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。なお、東京証券取引所第二部上場株式およびJASDAQ上場株式等に投資する場合があります。 ・銘柄選定にあたっては、予想配当利回りが原則として市場平均以上の銘柄から流動性等を勘案して調査対象銘柄を選定し、その中から財務の健全性や配当の実現性等を勘案して組入候補銘柄を決定します。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、銘柄分散を意識し、適宜組入銘柄の入替えを行います。 ・原則として株式の組入比率は高位を維持します。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・なお、市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。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	0.3%
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2005年7月15日
決算日	原則として毎年2月3日、8月3日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)に投資を行い、ISTOXX MUT B JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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(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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2015年11月6日
決算日	原則として毎年1月26日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

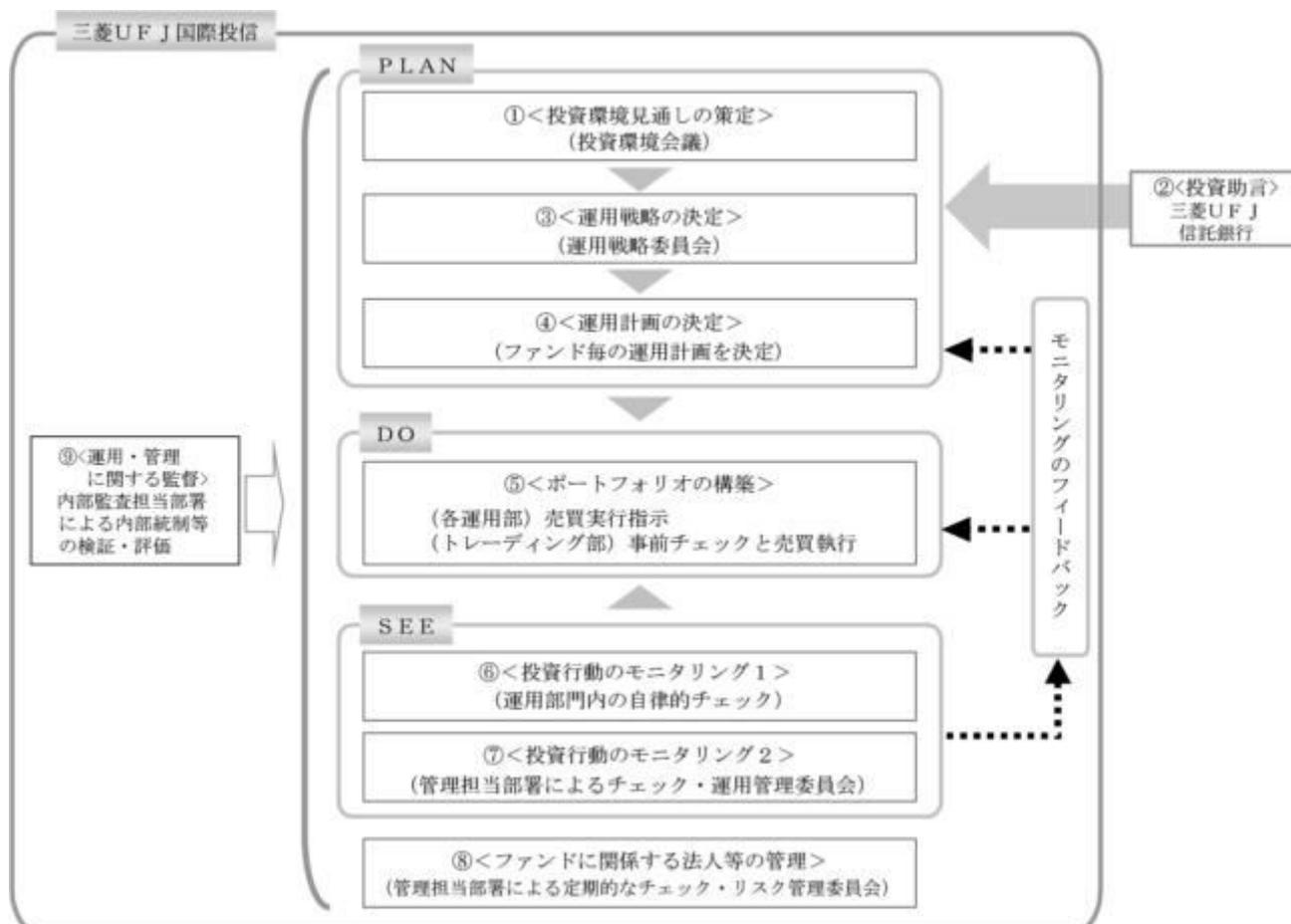
ファンド名	日本株オープン「35」マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・国内の上場株式、店頭登録株式を主たる投資対象とし、個別企業訪問等によるボトム・アップ・アプローチをベースとしたアクティブ運用を行います。 ・東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、これを上回る投資成果をめざします。 ・ファンドマネジャーが自ら企業訪問・調査・分析を行うことにより、企業の成長性とそのリスク、経営理念とその浸透度等を直接判断します。 ・現物株を中心に投資します。 ・主として、委託者が厳選した「35銘柄」に投資します。投資対象を「35銘柄」に絞ることで、銘柄のフォローを徹底し、集中投資効果を図ります。 ・「35銘柄」とは、委託者が独自の調査・分析等に基づき、投資判断・決定を行うなかで中長期的に事業の収益性・成長性が見込まれ、かつ十分な投資成果が期待できると判断した銘柄群をいいます。投資妙味のある銘柄を新規に発掘した場合、既存銘柄との比較を行い入替えの是非を検討します。 ・市場動向等によっては、限定された範囲内で、委託者が継続的にフォローしている銘柄群に投資することがあります。 ・株式組入比率は原則100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 ・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。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2001年10月5日
決算日	原則として毎年3月23日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本・小型株・ファンド・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の小型株式の中から、ボトムアップアプローチにより成長性が高いと判断される銘柄を厳選して投資することを基本とします。 ・※小型株式の分類は「RUSSELL/NOMURA 日本株インデックス」の分類に準ずるものとします。 ・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスをベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 ・組入銘柄については、適宜見直しを行い、必要に応じて入れ替えを行います。 ・株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式(金融商品取引所上場および店頭登録株式)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用(信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2000年3月31日
決算日	原則として毎年6月10日、12月10日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本株式最小分散インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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(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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用(信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2016年11月9日
決算日	原則として毎年10月29日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ジャパン・アクティブ・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・わが国の株式の中から、「資産・利益等と比較して株価が割安と判断され、かつ、優れたマネジメント力で継続的な利益成長や企業再生・復活が期待できる銘柄」を厳選し投資します。 ・東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2003年2月28日
決算日	原則として毎年10月30日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

(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。

投資助言

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

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、およびの投資助言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。

ファンドに関係する法人等の管理

助言元、受託会社等、ファンドの運営に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（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

株式への直接投資は行いません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

信用取引

信用取引の指図は行いません。

外国為替予約取引

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

公社債の借入れ

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

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。

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。

信用リスクの分散規制

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

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。

(主なりスクであり、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するため、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動 リスク	組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。
信用リスク	組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが遅れることがあります。
流動性 リスク	有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

留意事項

- 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。

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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

(2)【換金（解約）手数料】

かかりません。

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0.462%（税抜0.42%）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。

ファンドが投資対象とする投資信託証券では信託報酬はかかりませんので、受益者が負担する実質的な信託報酬は上記と同じです。

各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があること、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、今後実質的な料率は変動する場合があります。

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.34%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.04%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.04%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

< 投資信託証券の信託報酬率 >

投資信託証券の名称	信託報酬率（税込）
TOPIXマザーファンド	-
JPX日経400インデックスマザーファンド	-
日本株インカム・マザーファンド	-
JAPANクオリティ150インデックスマザーファンド	-
日本株オープン「35」マザーファンド	-
日本・小型株・ファンド・マザーファンド	-
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	-
ジャパン・アクティブ・マザーファンド	-

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。上記の他、監査費用等の諸費用が別途か

かります。申込手数料はかかりません。

（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、投資信託証券の売却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、

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。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

個別元本について

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2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

令和 2年 2月28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	5,815,504,401	96.81
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		191,404,266	3.19
純資産総額		6,006,908,667	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 2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	1,310,049,713	1.8732	2,453,985,122	1.6635	2,179,267,697	36.28

日本	親投資信託受益証券	日本株インカム・マザーファンド	459,168,997	2.1174	972,244,434	1.8812	863,788,717	14.38
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	663,887,514	1.3552	899,700,358	1.2031	798,723,068	13.30
日本	親投資信託受益証券	日本株オープン「35」マザーファンド	225,125,458	2.9748	669,703,212	2.6041	586,249,205	9.76
日本	親投資信託受益証券	J P X日経400インデックスマザーファンド	414,354,942	1.5747	652,484,727	1.4033	581,464,290	9.68
日本	親投資信託受益証券	ジャパン・アクティブ・マザーファンド	103,792,502	3.1728	329,312,850	2.7912	289,705,631	4.82
日本	親投資信託受益証券	日本・小型株・ファンド・マザーファンド	51,242,176	6.3125	323,466,236	5.2871	270,922,508	4.51
日本	親投資信託受益証券	J A P A N クオリティ150インデックスマザーファンド	206,603,760	1.3323	275,258,189	1.1877	245,383,285	4.09

(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 2月28日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	96.81
合計	96.81

(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。

(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2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30年 2月 5日)	3,798,197,134	3,798,197,134	11,677	11,677
第2計算期間末日 (平成31年 2月 5日)	6,798,579,101	6,798,579,101	10,048	10,048
第3計算期間末日 (令和 2年 2月 5日)	6,734,611,028	6,734,611,028	11,120	11,120
平成31年 2月末日	6,876,078,998		10,196	
3月末日	6,876,437,837		10,236	
4月末日	6,993,106,988		10,470	

令和 1年 5月末日	6,207,273,676		9,743
6月末日	6,417,185,669		9,986
7月末日	6,495,308,909		10,113
8月末日	6,310,497,299		9,779
9月末日	6,643,919,578		10,323
10月末日	6,798,092,302		10,837
11月末日	6,952,765,458		11,062
12月末日	7,067,709,765		11,232
令和 2年 1月末日	6,662,726,519		10,998
2月末日	6,006,908,667		9,868

【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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	16.77
第2計算期間	13.95
第3計算期間	10.66

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	4,180,718,781	927,957,119	3,252,761,662
第2計算期間	4,337,352,686	824,150,797	6,765,963,551
第3計算期間	1,480,174,624	2,189,987,840	6,056,150,335

（参考）

TOPIXマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	307,988,581,680	98.41
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		4,961,132,499	1.59
純資産総額		312,949,714,179	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2月28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	2,054,315,000	0.66

(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2月28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	1,615,000	7,132.23	11,518,551,450	7,127.00	11,510,105,000	3.68
日本	株式	ソニー	電気機器	915,400	6,021.24	5,511,843,096	6,611.00	6,051,709,400	1.93
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,127,000	5,034.95	5,674,388,650	5,013.00	5,649,651,000	1.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,765,700	557.84	5,447,698,088	531.90	5,194,375,830	1.66
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,898,600	2,577.10	4,892,882,060	2,529.50	4,802,508,700	1.53
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,204,300	4,309.32	5,189,714,076	3,763.00	4,531,780,900	1.45
日本	株式	キーエンス	電気機器	131,200	35,628.88	4,674,509,056	34,410.00	4,514,592,000	1.44
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	990,800	3,597.74	3,564,640,792	3,758.00	3,723,426,400	1.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	987,300	3,893.66	3,844,210,518	3,484.00	3,439,753,200	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,058,500	2,846.46	3,012,977,910	3,058.00	3,236,893,000	1.03
日本	株式	任天堂	その他製品	88,800	37,423.35	3,323,193,480	36,270.00	3,220,776,000	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,139,600	2,952.36	3,364,509,456	2,799.50	3,190,310,200	1.02
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,049,200	2,760.58	2,896,400,536	2,927.50	3,071,533,000	0.98

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	510,500	5,705.00	2,912,402,500	5,801.00	2,961,410,500	0.95
日本	株式	信越化学工業	化学	243,400	10,854.28	2,641,931,752	12,145.00	2,956,093,000	0.94
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,398,800	167.24	3,244,255,312	147.60	2,863,262,880	0.91
日本	株式	HOYA	精密機器	289,000	8,689.93	2,511,389,770	9,609.00	2,777,001,000	0.89
日本	株式	第一三共	医薬品	414,200	5,959.59	2,468,462,178	6,590.00	2,729,578,000	0.87
日本	株式	花王	化学	346,600	8,530.45	2,956,653,970	7,868.00	2,727,048,800	0.87
日本	株式	ダイキン工業	機械	184,400	13,964.50	2,575,053,800	14,725.00	2,715,290,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,000,400	2,973.29	2,974,479,316	2,690.00	2,691,076,000	0.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	695,500	3,957.71	2,752,587,305	3,637.00	2,529,533,500	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	137,500	19,860.21	2,730,778,875	17,970.00	2,470,875,000	0.79
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	997,100	2,242.99	2,236,485,329	2,461.50	2,454,361,650	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	425,200	5,743.11	2,441,970,372	5,721.00	2,432,569,200	0.78
日本	株式	三井物産	卸売業	1,253,000	1,837.05	2,301,823,650	1,783.50	2,234,725,500	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	174,200	14,418.25	2,511,659,150	12,780.00	2,226,276,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,273,200	1,710.50	2,177,808,600	1,699.00	2,163,166,800	0.69
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	96,500	19,804.79	1,911,162,235	22,325.00	2,154,362,500	0.69
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	120,300	22,990.01	2,765,698,203	17,780.00	2,138,934,000	0.68

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 2月28日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.27
	建設業	2.73
	食料品	3.75
	繊維製品	0.56
	パルプ・紙	0.23
	化学	7.06
	医薬品	6.02
	石油・石炭製品	0.48
	ゴム製品	0.66
	ガラス・土石製品	0.80
	鉄鋼	0.67
	非鉄金属	0.69
	金属製品	0.56
	機械	4.96
	電気機器	14.23
	輸送用機器	7.72
	精密機器	2.45
	その他製品	2.17
	電気・ガス業	1.51
陸運業	4.04	

海運業	0.15
空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.18
卸売業	5.05
小売業	4.41
銀行業	5.65
証券、商品先物取引業	0.80
保険業	2.35
その他金融業	1.22
不動産業	2.38
サービス業	4.94
小計	98.41
合計	98.41

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 2年 2月28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	買建	137	円	2,175,490,350	2,054,315,000	0.66

（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。

J P X日経400インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 2月28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	6,052,353,490	98.56
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		88,198,027	1.44
純資産総額		6,140,551,517	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2月28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	87,555,000	1.43

(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2月28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	ソニー	電気機器	15,700	7,788.67	122,282,181	6,611.00	103,792,700	1.69
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	14,000	7,723.45	108,128,398	7,127.00	99,778,000	1.62
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	182,200	564.88	102,921,848	531.90	96,912,180	1.58
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	25,100	4,375.16	109,816,526	3,758.00	94,325,800	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	36,600	2,787.70	102,029,934	2,529.50	92,579,700	1.51
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,600	38,896.13	101,129,955	34,410.00	89,466,000	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	23,400	4,274.01	100,011,881	3,763.00	88,054,200	1.43
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	17,300	4,643.10	80,325,672	5,013.00	86,724,900	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	24,200	3,849.11	93,148,472	3,484.00	84,312,800	1.37
日本	株式	KDDI	情報・通信業	26,800	3,266.62	87,545,434	3,058.00	81,954,400	1.33
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	28,800	2,909.89	83,805,063	2,799.50	80,625,600	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	2,200	42,137.49	92,702,484	36,270.00	79,794,000	1.30
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	26,500	3,110.96	82,440,694	2,927.50	77,578,750	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	6,200	12,458.23	77,241,027	12,145.00	75,299,000	1.23
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	12,900	6,003.90	77,450,411	5,801.00	74,832,900	1.22
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	490,800	161.30	79,169,989	147.60	72,442,080	1.18
日本	株式	HOYA	精密機器	7,300	10,927.37	79,769,871	9,609.00	70,145,700	1.14
日本	株式	花王	化学	8,800	9,008.46	79,274,458	7,868.00	69,238,400	1.13
日本	株式	ダイキン工業	機械	4,700	15,724.01	73,902,863	14,725.00	69,207,500	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	10,500	7,438.31	78,102,358	6,590.00	69,195,000	1.13
日本	株式	三菱商事	卸売業	25,300	2,840.66	71,868,724	2,690.00	68,057,000	1.11
日本	株式	日立製作所	電気機器	17,600	4,395.80	77,366,198	3,637.00	64,011,200	1.04
日本	株式	ファナック	電気機器	3,500	19,923.91	69,733,693	17,970.00	62,895,000	1.02
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	25,200	2,603.16	65,599,834	2,461.50	62,029,800	1.01
日本	株式	村田製作所	電気機器	10,800	6,536.85	70,598,026	5,721.00	61,786,800	1.01

日本	株式	三井物産	卸売業	31,700	1,948.18	61,757,319	1,783.50	56,536,950	0.92
日本	株式	日本電産	電気機器	4,400	14,560.13	64,064,578	12,780.00	56,232,000	0.92
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	32,200	1,882.94	60,630,986	1,699.00	54,707,800	0.89
日本	株式	キヤノン	電気機器	19,700	3,007.70	59,251,764	2,733.50	53,849,950	0.88
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2,400	24,495.42	58,789,008	22,325.00	53,580,000	0.87

(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 2月28日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.07
	鉱業	0.30
	建設業	2.70
	食料品	3.70
	繊維製品	0.42
	パルプ・紙	0.13
	化学	7.19
	医薬品	6.85
	石油・石炭製品	0.60
	ゴム製品	0.74
	ガラス・土石製品	0.76
	鉄鋼	0.58
	非鉄金属	0.61
	金属製品	0.27
	機械	4.83
	電気機器	15.57
	輸送用機器	6.00
	精密機器	2.90
	その他製品	2.01
	電気・ガス業	1.32
	陸運業	4.50
	空運業	0.57
	情報・通信業	8.25
	卸売業	5.33
	小売業	4.37
	銀行業	5.32
	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	2.98
	その他金融業	1.27
	不動産業	2.72
サービス業	4.80	
	小計	98.56

合計	98.56
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 2年 2月28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	J P X日経インデックス400先物 20年03月限	買建	65	円	92,112,150	87,555,000	1.43

（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。

日本株インカム・マザーファンド

投資状況

令和 2年 2月28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	5,592,164,070	95.55
投資証券	日本	201,366,500	3.44
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		59,325,968	1.01
純資産総額		5,852,856,538	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 2月28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	武田薬品工業	医薬品	61,700	4,189.00	258,461,300	3,763.00	232,177,100	3.97
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	159,100	1,500.00	238,650,000	1,412.50	224,728,750	3.84
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	78,200	2,809.50	219,702,900	2,799.50	218,920,900	3.74
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	124,200	1,644.50	204,246,900	1,478.50	183,629,700	3.14

日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	23,400	7,580.00	177,372,000	7,127.00	166,771,800	2.85
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	55,000	3,084.00	169,620,000	2,927.50	161,012,500	2.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	42,400	3,868.00	164,003,200	3,484.00	147,721,600	2.52
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	59,700	2,530.00	151,041,000	2,461.50	146,951,550	2.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	35,600	4,100.00	145,960,000	3,637.00	129,477,200	2.21
日本	株式	中部電力	電気・ガス業	91,000	1,520.00	138,320,000	1,407.50	128,082,500	2.19
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,700	24,070.00	137,199,000	22,325.00	127,252,500	2.17
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	21,700	6,002.00	130,243,400	5,801.00	125,881,700	2.15
日本	株式	日立建機	機械	45,600	2,966.00	135,249,600	2,663.00	121,432,800	2.07
日本	株式	レイズネクスト	建設業	84,200	1,302.00	109,628,400	1,217.00	102,471,400	1.75
日本	株式	TOKAIホールディングス	卸売業	107,000	1,022.00	109,354,000	883.00	94,481,000	1.61
日本	株式	丸紅	卸売業	130,200	785.60	102,285,120	716.80	93,327,360	1.59
日本	株式	ウエストホールディングス	建設業	74,620	1,339.23	99,933,400	1,197.00	89,320,140	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	167,200	564.90	94,451,280	531.90	88,933,680	1.52
日本	株式	SUBARU	輸送用機器	33,300	2,746.00	91,441,800	2,619.50	87,229,350	1.49
日本	株式	リコー	電気機器	86,100	1,253.00	107,883,300	1,005.00	86,530,500	1.48
日本	株式	ライト工業	建設業	65,700	1,534.00	100,783,800	1,311.00	86,132,700	1.47
日本	株式	リソー教育	サービス業	272,600	358.00	97,590,800	306.00	83,415,600	1.43
日本	株式	住友倉庫	倉庫・運輸関連業	64,200	1,442.00	92,576,400	1,263.00	81,084,600	1.39
日本	株式	丹青社	サービス業	82,900	1,225.00	101,552,500	978.00	81,076,200	1.39
日本	株式	SBIホールディングス	証券・商品先物取引業	36,800	2,512.00	92,441,600	2,175.00	80,040,000	1.37
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	61,200	1,458.00	89,229,600	1,290.50	78,978,600	1.35
日本	株式	キョーリン製薬ホールディングス	医薬品	36,000	2,021.00	72,756,000	2,162.00	77,832,000	1.33
日本	株式	ウシオ電機	電気機器	57,500	1,522.00	87,515,000	1,350.00	77,625,000	1.33
日本	株式	メイテック	サービス業	14,800	6,260.00	92,648,000	5,100.00	75,480,000	1.29
日本	株式	ニチアス	ガラス・土石製品	33,200	2,641.00	87,681,200	2,233.00	74,135,600	1.27

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	鉱業	0.99
	建設業	6.61
	繊維製品	0.93
	化学	4.90
	医薬品	5.30
	ガラス・土石製品	1.27
	非鉄金属	3.33

金属製品	1.46
機械	3.21
電気機器	9.84
輸送用機器	9.07
精密機器	2.12
電気・ガス業	2.19
陸運業	1.04
空運業	0.84
倉庫・運輸関連業	1.39
情報・通信業	10.06
卸売業	8.10
小売業	1.49
銀行業	5.48
証券、商品先物取引業	1.37
保険業	5.29
その他金融業	1.62
不動産業	2.79
サービス業	4.88
小計	95.55
投資証券	3.44
合計	98.99

（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。

JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

投資状況

令和2年2月28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	3,167,617,910	99.49
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		16,154,843	0.51
純資産総額		3,183,772,753	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 2月28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	14,995,000	0.47

(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 2月28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	信越化学工業	化学	5,900	12,443.81	73,418,500	12,145.00	71,655,500	2.25
日本	株式	HOYA	精密機器	7,300	10,935.53	79,829,369	9,609.00	70,145,700	2.20
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	28,400	2,603.17	73,930,028	2,461.50	69,906,600	2.20
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	23,400	3,114.65	72,882,810	2,927.50	68,503,500	2.15
日本	株式	中外製薬	医薬品	5,800	10,705.67	62,092,886	11,715.00	67,947,000	2.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	22,200	3,267.74	72,543,828	3,058.00	67,887,600	2.13
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	11,700	5,997.77	70,173,909	5,801.00	67,871,700	2.13
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	3,000	24,491.33	73,474,000	22,325.00	66,975,000	2.10
日本	株式	ダイキン工業	機械	4,500	15,751.95	70,883,775	14,725.00	66,262,500	2.08
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	17,600	4,379.68	77,082,368	3,758.00	66,140,800	2.08
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	38,400	1,899.86	72,954,624	1,699.00	65,241,600	2.05
日本	株式	テルモ	精密機器	18,700	3,945.70	73,784,590	3,478.00	65,038,600	2.04
日本	株式	ソニー	電気機器	9,700	7,835.67	76,005,999	6,611.00	64,126,700	2.01
日本	株式	花王	化学	8,100	9,043.91	73,255,671	7,868.00	63,730,800	2.00
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,800	38,925.55	70,066,000	34,410.00	61,938,000	1.95
日本	株式	村田製作所	電気機器	10,800	6,548.68	70,725,744	5,721.00	61,786,800	1.94
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	28,400	2,316.47	65,787,748	2,144.00	60,889,600	1.91
日本	株式	オリックス	その他金融業	34,500	1,866.92	64,408,740	1,742.00	60,099,000	1.89
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	4,800	14,465.00	69,432,000	12,265.00	58,872,000	1.85
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	1,100	58,620.00	64,482,000	53,440.00	58,784,000	1.85
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	16,300	3,897.10	63,522,730	3,606.00	58,777,800	1.85
日本	株式	任天堂	その他製品	1,600	42,094.37	67,351,000	36,270.00	58,032,000	1.82
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	3,200	21,846.56	69,909,000	17,780.00	56,896,000	1.79
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	31,200	1,654.47	51,619,464	1,478.50	46,129,200	1.45

日本	株式	MS&ADインシュアランスグループホール	保険業	13,100	3,642.07	47,711,117	3,483.00	45,627,300	1.43
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	7,800	6,671.61	52,038,600	5,845.00	45,591,000	1.43
日本	株式	ユニ・チャーム	化学	12,100	3,721.22	45,026,762	3,498.00	42,325,800	1.33
日本	株式	SOMPOホールディングス	保険業	9,700	4,187.02	40,614,094	4,016.00	38,955,200	1.22
日本	株式	ニトリホールディングス	小売業	2,400	17,022.60	40,854,240	14,965.00	35,916,000	1.13
日本	株式	積水ハウス	建設業	16,900	2,419.34	40,886,846	2,117.00	35,777,300	1.12

(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 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	建設業	3.07
	食料品	5.08
	繊維製品	0.19
	化学	10.06
	医薬品	8.63
	ゴム製品	2.06
	金属製品	0.52
	機械	3.96
	電気機器	14.57
	輸送用機器	1.69
	精密機器	5.54
	その他製品	3.90
	陸運業	2.02
	空運業	0.77
	情報・通信業	11.82
	卸売業	3.70
	小売業	5.87
	銀行業	0.17
	保険業	6.51
	その他金融業	2.07
不動産業	0.36	
サービス業	6.95	
	小計	99.49
合計		99.49

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 2年 2月28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	買建	1	円	17,020,550	14,995,000	0.47

（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。

日本株オープン「35」マザーファンド

投資状況

令和 2年 2月28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	5,945,814,490	98.48
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		91,832,799	1.52
純資産総額		6,037,647,289	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 2月28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	レノバ	電気・ガス業	425,200	929.30	395,138,874	956.00	406,491,200	6.73
日本	株式	山一電機	電気機器	176,200	1,116.31	196,694,495	1,592.00	280,510,400	4.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	499,600	556.72	278,137,312	531.90	265,737,240	4.40
日本	株式	トリケミカル研究所	化学	30,700	6,148.76	188,767,222	8,440.00	259,108,000	4.29
日本	株式	第一三共	医薬品	36,700	4,321.57	158,601,619	6,590.00	241,853,000	4.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	78,300	3,180.95	249,068,385	2,799.50	219,200,850	3.63
日本	株式	村田製作所	電気機器	36,000	5,259.28	189,334,080	5,721.00	205,956,000	3.41
日本	株式	そーせいグループ	医薬品	123,100	1,588.43	195,536,637	1,645.00	202,499,500	3.35
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	27,400	6,766.78	185,409,772	7,127.00	195,279,800	3.23
日本	株式	東京応化工業	化学	47,700	3,467.80	165,414,349	3,885.00	185,314,500	3.07
日本	株式	SUMCO	金属製品	108,400	1,781.65	193,131,352	1,641.00	177,884,400	2.95

日本	株式	オプティム	情報・通信業	45,600	3,382.02	154,220,188	3,805.00	173,508,000	2.87
日本	株式	太陽誘電	電気機器	53,100	2,077.92	110,337,552	3,020.00	160,362,000	2.66
日本	株式	トレンダーズ	サービス業	233,600	698.73	163,223,873	680.00	158,848,000	2.63
日本	株式	資生堂	化学	24,700	7,695.89	190,088,691	6,418.00	158,524,600	2.63
日本	株式	キーエンス	電気機器	4,500	34,545.00	155,452,500	34,410.00	154,845,000	2.56
日本	株式	オプトラン	機械	52,000	2,893.31	150,452,226	2,865.00	148,980,000	2.47
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	28,100	5,354.21	150,453,349	5,013.00	140,865,300	2.33
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	6,200	16,974.26	105,240,440	22,325.00	138,415,000	2.29
日本	株式	日本電産	電気機器	9,800	13,360.00	130,928,000	12,780.00	125,244,000	2.07
日本	株式	レーザーテック	電気機器	25,400	2,372.14	60,252,483	4,925.00	125,095,000	2.07
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	23,600	5,607.64	132,340,397	4,915.00	115,994,000	1.92
日本	株式	ダイフク	機械	17,700	6,037.11	106,856,847	6,420.00	113,634,000	1.88
日本	株式	T I S	情報・通信業	17,700	5,814.01	102,907,977	6,390.00	113,103,000	1.87
日本	株式	N I T T O K U	機械	35,000	3,850.99	134,784,662	3,150.00	110,250,000	1.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	40,300	3,182.00	128,234,600	2,690.00	108,407,000	1.80
日本	株式	住友金属鉱山	非鉄金属	38,400	3,478.25	133,564,800	2,685.50	103,123,200	1.71
日本	株式	三井金属鉱業	非鉄金属	38,800	2,721.82	105,606,616	2,589.00	100,453,200	1.66
日本	株式	朝日インテック	精密機器	37,600	2,510.00	94,376,000	2,586.00	97,233,600	1.61
日本	株式	任天堂	その他製品	2,600	41,327.41	107,451,266	36,270.00	94,302,000	1.56

(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 2月28日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	化学	11.51
	医薬品	8.33
	非鉄金属	3.37
	金属製品	2.95
	機械	6.18
	電気機器	26.47
	輸送用機器	6.86
	精密機器	1.61
	その他製品	1.56
	電気・ガス業	6.73
	情報・通信業	11.22
	卸売業	1.80
	小売業	0.97
	銀行業	4.40
	保険業	1.40
	サービス業	3.12
	小計	98.48

合計	98.48
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

投資状況

令和 2年 2月28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	7,116,700,200	98.06
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		140,809,513	1.94
純資産総額		7,257,509,713	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 2月28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	トーカロ	金属製品	211,000	1,102.97	232,726,670	954.00	201,294,000	2.77
日本	株式	ジャパンマテリアル	サービス業	150,000	1,541.00	231,150,000	1,284.00	192,600,000	2.65
日本	株式	レーザーテック	電気機器	36,900	5,006.35	184,734,321	4,925.00	181,732,500	2.50
日本	株式	扶桑化学工業	化学	57,200	3,025.00	173,030,000	2,985.00	170,742,000	2.35
日本	株式	ラクト・ジャパン	卸売業	46,500	3,673.21	170,804,515	3,485.00	162,052,500	2.23
日本	株式	HENNGE	情報・通信業	57,600	2,030.36	116,949,120	2,799.00	161,222,400	2.22
日本	株式	日本エム・ディ・エム	精密機器	95,500	2,129.43	203,361,424	1,608.00	153,564,000	2.12
日本	株式	シップヘルスケアホールディングス	卸売業	35,000	4,625.00	161,875,000	4,380.00	153,300,000	2.11
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	21,000	8,110.00	170,310,000	6,870.00	144,270,000	1.99

日本	株式	バイカレント・コンサルティング	サービス業	21,000	5,510.00	115,710,000	6,440.00	135,240,000	1.86
日本	株式	日本ユニシス	情報・通信業	38,000	3,697.19	140,493,220	3,255.00	123,690,000	1.70
日本	株式	タカラバイオ	化学	64,000	2,098.26	134,288,640	1,868.00	119,552,000	1.65
日本	株式	日東紡績	ガラス・土石製品	28,200	4,471.60	126,099,197	4,160.00	117,312,000	1.62
日本	株式	ローツェ	機械	35,300	3,815.18	134,675,854	3,310.00	116,843,000	1.61
日本	株式	メニコン	精密機器	26,000	4,395.00	114,270,000	4,410.00	114,660,000	1.58
日本	株式	チームスピリット	情報・通信業	59,500	2,245.00	133,577,500	1,919.00	114,180,500	1.57
日本	株式	前田建設工業	建設業	113,500	1,063.78	120,740,067	966.00	109,641,000	1.51
日本	株式	ニチアス	ガラス・土石製品	49,000	2,691.00	131,859,000	2,233.00	109,417,000	1.51
日本	株式	全国保証	その他金融業	27,000	4,633.76	125,111,694	4,045.00	109,215,000	1.50
日本	株式	東京精密	精密機器	31,500	4,080.00	128,520,000	3,380.00	106,470,000	1.47
日本	株式	タクマ	機械	89,900	1,296.00	116,510,400	1,184.00	106,441,600	1.47
日本	株式	フルキャストホールディングス	サービス業	55,000	2,431.00	133,705,000	1,890.00	103,950,000	1.43
日本	株式	技研製作所	機械	28,000	4,849.89	135,796,920	3,600.00	100,800,000	1.39
日本	株式	日東工業	電気機器	53,000	2,591.00	137,323,000	1,894.00	100,382,000	1.38
日本	株式	セブテーニ・ホールディングス	サービス業	411,000	287.40	118,122,829	243.00	99,873,000	1.38
日本	株式	バリューコマース	サービス業	48,500	2,192.00	106,312,000	2,057.00	99,764,500	1.37
日本	株式	そーせいグループ	医薬品	60,500	2,249.00	136,064,500	1,645.00	99,522,500	1.37
日本	株式	デジタルガレージ	情報・通信業	29,000	4,298.93	124,668,993	3,375.00	97,875,000	1.35
日本	株式	GMOペイメントゲートウェイ	情報・通信業	14,500	7,630.00	110,635,000	6,620.00	95,990,000	1.32
日本	株式	キュービーネットホールディングス	サービス業	51,600	2,399.86	123,833,177	1,858.00	95,872,800	1.32

(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 2月28日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	1.04
	建設業	2.41
	食料品	1.48
	化学	8.77
	医薬品	5.41
	ゴム製品	0.89
	ガラス・土石製品	6.09
	金属製品	3.20
	機械	6.78
	電気機器	4.36
	輸送用機器	0.51
	精密機器	5.16

その他製品	1.26
電気・ガス業	0.50
陸運業	0.60
情報・通信業	21.02
卸売業	4.35
小売業	3.66
その他金融業	2.36
不動産業	2.31
サービス業	15.91
小計	98.06
合計	98.06

（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

該当事項はありません。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 2月28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	7,835,153,570	99.43
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		45,038,597	0.57
純資産総額		7,880,192,167	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 2月28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	44,985,000	0.57

（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2月28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	NTTドコモ	情報・通信業	44,800	2,890.12	129,477,386	2,927.50	131,152,000	1.66
日本	株式	中国電力	電気・ガス業	90,700	1,441.85	130,776,281	1,436.00	130,245,200	1.65
日本	株式	KDDI	情報・通信業	41,900	2,997.38	125,590,612	3,058.00	128,130,200	1.63
日本	株式	日本郵政	サービス業	132,800	1,012.19	134,419,690	940.70	124,924,960	1.59
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	88,200	1,496.83	132,020,836	1,412.50	124,582,500	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	49,000	2,683.46	131,489,857	2,529.50	123,945,500	1.57
日本	株式	日本電気	電気機器	30,500	4,637.24	141,435,834	4,040.00	123,220,000	1.56
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	17,100	7,558.06	129,242,882	7,127.00	121,871,700	1.55
日本	株式	キヤノン	電気機器	44,400	2,923.55	129,805,834	2,733.50	121,367,400	1.54
日本	株式	ヤマダ電機	小売業	233,500	532.94	124,441,778	519.00	121,186,500	1.54
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	125,200	1,084.72	135,807,439	964.00	120,692,800	1.53
日本	株式	積水ハウス	建設業	56,900	2,349.63	133,694,384	2,117.00	120,457,300	1.53
日本	株式	中外製薬	医薬品	10,100	9,258.47	93,510,574	11,715.00	118,321,500	1.50
日本	株式	ローソン	小売業	20,600	6,048.50	124,599,300	5,730.00	118,038,000	1.50
日本	株式	セコム	サービス業	13,700	9,810.19	134,399,690	8,575.00	117,477,500	1.49
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	54,200	2,438.31	132,156,556	2,144.00	116,204,800	1.47
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	781,900	169.21	132,307,964	147.60	115,408,440	1.46
日本	株式	九州旅客鉄道	陸運業	35,300	3,585.24	126,559,047	3,245.00	114,548,500	1.45
日本	株式	日本マクドナルドホールディングス	小売業	24,600	5,428.33	133,537,004	4,530.00	111,438,000	1.41
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	13,300	9,905.54	131,743,711	8,319.00	110,642,700	1.40
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	9,000	16,200.70	145,806,381	12,265.00	110,385,000	1.40
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	30,100	4,503.66	135,560,242	3,606.00	108,540,600	1.38
日本	株式	日本航空	空運業	40,000	3,312.22	132,489,134	2,678.00	107,120,000	1.36
日本	株式	名古屋鉄道	陸運業	37,300	3,400.39	126,834,561	2,819.00	105,148,700	1.33
日本	株式	花王	化学	13,300	8,423.84	112,037,154	7,868.00	104,644,400	1.33
日本	株式	ANAホールディングス	空運業	35,900	3,670.92	131,786,260	2,907.50	104,379,250	1.32
日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	13,700	9,244.48	126,649,405	7,618.00	104,366,600	1.32
日本	株式	近鉄グループホールディングス	陸運業	21,700	5,876.39	127,517,708	4,665.00	101,230,500	1.28
日本	株式	富士フィルムホールディングス	化学	19,000	4,850.97	92,168,545	5,277.00	100,263,000	1.27
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	27,100	4,209.36	114,073,658	3,696.00	100,161,600	1.27

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	建設業	2.47
	食料品	7.65
	繊維製品	0.52
	化学	3.98
	医薬品	5.72
	ゴム製品	1.38
	鉄鋼	0.23
	金属製品	0.40
	機械	2.26
	電気機器	6.82
	輸送用機器	3.23
	精密機器	2.10
	その他製品	1.08
	電気・ガス業	6.67
	陸運業	13.35
	空運業	2.68
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	10.20
	卸売業	3.26
	小売業	10.31
	銀行業	4.15
	保険業	1.96
不動産業	3.15	
サービス業	5.71	
	小計	99.43
合計		99.43

（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 2月28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	買建	3	円	51,541,650	44,985,000	0.57
----------	-------	---------------	----	---	---	------------	------------	------

(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。

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

投資状況

令和 2年 2月28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	3,433,784,090	98.93
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		37,090,674	1.07
純資産総額		3,470,874,764	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 2月28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	本田技研工業	輸送用機器	44,100	2,987.90	131,766,390	2,799.50	123,457,950	3.56
日本	株式	第一三共	医薬品	15,300	7,091.13	108,494,289	6,590.00	100,827,000	2.90
日本	株式	ソニー	電気機器	13,900	6,381.62	88,704,639	6,611.00	91,892,900	2.65
日本	株式	日立製作所	電気機器	23,000	4,275.92	98,346,165	3,637.00	83,651,000	2.41
日本	株式	S Gホールディングス	陸運業	38,600	2,618.17	101,061,414	2,128.00	82,140,800	2.37
日本	株式	スシローグローバルホールディングス	小売業	10,600	7,582.79	80,377,665	7,700.00	81,620,000	2.35
日本	株式	三菱商事	卸売業	29,900	2,792.19	83,486,481	2,690.00	80,431,000	2.32
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	32,400	2,397.23	77,670,252	2,461.50	79,752,600	2.30
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	13,700	5,792.70	79,359,990	5,801.00	79,473,700	2.29
日本	株式	ウシオ電機	電気機器	58,800	1,617.62	95,116,549	1,350.00	79,380,000	2.29
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	56,100	1,490.67	83,626,587	1,412.50	79,241,250	2.28
日本	株式	リコー	電気機器	78,400	999.04	78,325,083	1,005.00	78,792,000	2.27
日本	株式	ネクステージ	小売業	86,700	1,059.28	91,840,233	849.00	73,608,300	2.12
日本	株式	中外製薬	医薬品	6,200	12,237.85	75,874,670	11,715.00	72,633,000	2.09
日本	株式	任天堂	その他製品	1,900	39,391.77	74,844,374	36,270.00	68,913,000	1.99
日本	株式	東レ	繊維製品	108,400	769.05	83,365,618	624.70	67,717,480	1.95
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	17,500	4,113.86	71,992,652	3,758.00	65,765,000	1.89
日本	株式	I H I	機械	28,800	2,676.37	77,079,471	2,269.00	65,347,200	1.88

日本	株式	SUMCO	金属製品	39,200	1,838.02	72,050,384	1,641.00	64,327,200	1.85
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	116,800	575.48	67,216,064	531.90	62,125,920	1.79
日本	株式	京成電鉄	陸運業	17,900	4,478.76	80,169,816	3,455.00	61,844,500	1.78
日本	株式	三菱ロジスネクスト	輸送用機器	39,900	1,201.91	47,956,563	1,350.00	53,865,000	1.55
日本	株式	オリンパス	精密機器	27,300	2,091.13	57,088,084	1,962.00	53,562,600	1.54
日本	株式	豊田合成	輸送用機器	23,000	2,626.39	60,406,970	2,306.00	53,038,000	1.53
日本	株式	富士通	電気機器	4,600	9,697.00	44,606,200	11,210.00	51,566,000	1.49
日本	株式	日立建機	機械	19,300	2,987.73	57,663,252	2,663.00	51,395,900	1.48
日本	株式	SCSK	情報・通信業	9,100	5,810.55	52,876,005	5,570.00	50,687,000	1.46
日本	株式	イビデン	電気機器	21,200	2,573.58	54,559,896	2,389.00	50,646,800	1.46
日本	株式	シャープ	電気機器	39,800	1,276.35	50,798,974	1,260.00	50,148,000	1.44
日本	株式	三井不動産	不動産業	19,600	2,757.71	54,051,288	2,477.50	48,559,000	1.40

(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 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	鉱業	0.98
	建設業	4.17
	食料品	3.59
	繊維製品	1.95
	パルプ・紙	0.98
	化学	5.08
	医薬品	5.99
	鉄鋼	1.00
	非鉄金属	1.01
	金属製品	1.85
	機械	3.36
	電気機器	14.00
	輸送用機器	7.89
	精密機器	2.07
	その他製品	1.99
	電気・ガス業	1.01
	陸運業	5.14
	空運業	0.25
	倉庫・運輸関連業	0.49
	情報・通信業	9.62
	卸売業	5.12
	小売業	4.47
	銀行業	3.05
証券、商品先物取引業	2.44	

	保険業	3.27
	その他金融業	1.21
	不動産業	2.86
	サービス業	4.08
	小計	98.93
合計		98.93

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

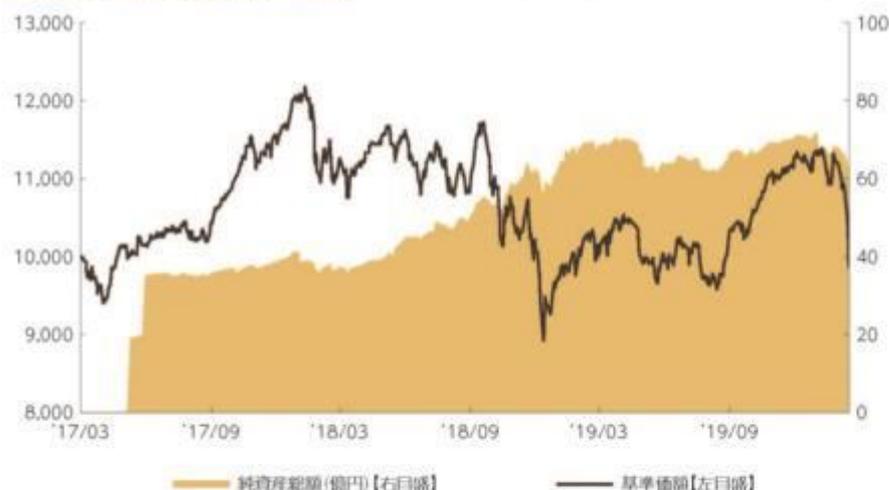
参考情報



運用実績

2020年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年3月13日(設定日)～2020年2月28日



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

■基準価額・純資産

基準価額	9,868円
純資産総額	60.0億円

■分配の推移

2020年2月	0円
2019年2月	0円
2018年2月	0円
設定来累計	0円

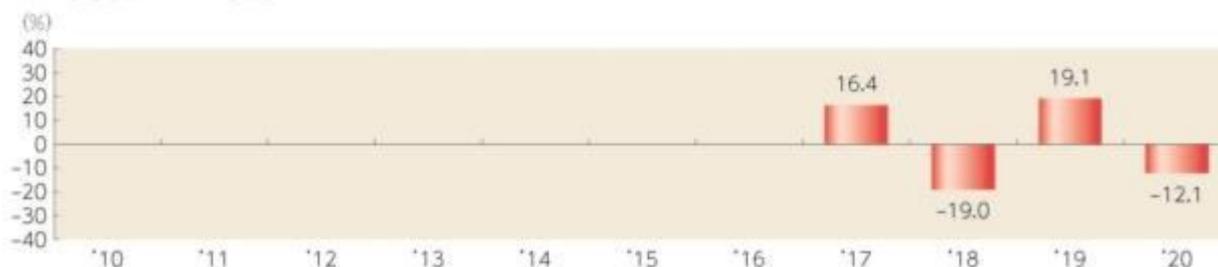
•分配金は1万円当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位銘柄	比率
1 TOPIXマザーファンド	36.3%
2 日本株インカム・マザーファンド	14.4%
3 日本株式最小分散インデックスマザーファンド	13.3%
4 日本株オープン「35」マザーファンド	9.8%
5 JPX日経400インデックスマザーファンド	9.7%
6 ジャパン・アクティブ・マザーファンド	4.8%
7 日本・小型株・ファンド・マザーファンド	4.5%
8 JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	4.1%

•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)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は設定日から年末までの、2020年は年初から2月28日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

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

申込価額

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

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/>

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。

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（投資対象証券の取得の制限等）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。

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

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の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

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

解約価額

解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

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ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

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7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、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。

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（投資対象証券の換金の制限等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして扱います。

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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

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

・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

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/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

2027年2月5日まで（2017年3月13日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年2月6日から翌年2月5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10億口を下回るようになった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

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

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

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（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有

し、これを行行使うことができます。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、議決権を行行使う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をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

関係法人との契約の更改

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

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

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

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してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース(一般コース)

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

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

分配金再投資コース(累積投資コース)

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

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

(3) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金(解約)請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成31年2月6日から令和2年2月5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】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 [平成31年 2月 5日現在]	第3期 [令和 2年 2月 5日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,089,751	194,875,208
親投資信託受益証券	6,703,587,129	6,576,155,128
流動資産合計	6,821,676,880	6,771,030,336
資産合計	6,821,676,880	6,771,030,336
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,119,379	20,695,778
未払受託者報酬	1,226,922	1,486,514
未払委託者報酬	11,655,780	14,121,804
未払利息	216	67
その他未払費用	95,482	115,145
流動負債合計	23,097,779	36,419,308
負債合計	23,097,779	36,419,308
純資産の部		
元本等		
元本	6,765,963,551	6,056,150,335
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	32,615,550	678,460,693
（分配準備積立金）	463,964,939	473,675,494
元本等合計	6,798,579,101	6,734,611,028
純資産合計	6,798,579,101	6,734,611,028
負債純資産合計	6,821,676,880	6,771,030,336

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	平成30年 2月 6日 至 平成31年 2月 5日	自	平成31年 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
営業収益				
受取利息		356		641
有価証券売買等損益		741,465,762		718,067,999
営業収益合計		741,465,406		718,068,640
営業費用				
支払利息		87,014		86,964
受託者報酬		2,098,078		2,914,297
委託者報酬		19,931,729		27,685,719
その他費用		163,976		226,078
営業費用合計		22,280,797		30,913,058
営業利益又は営業損失（ ）		763,746,203		687,155,582
経常利益又は経常損失（ ）		763,746,203		687,155,582
当期純利益又は当期純損失（ ）		763,746,203		687,155,582
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（ ）		69,762,359		96,084,043
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		545,435,472		32,615,550
剰余金増加額又は欠損金減少額		299,006,870		70,152,928
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		299,006,870		70,152,928
剰余金減少額又は欠損金増加額		117,842,948		15,379,324
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		117,842,948		15,379,324
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		32,615,550		678,460,693

(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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 [平成31年 2月 5日現在]	第3期 [令和 2年 2月 5日現在]
1. 期首元本額	3,252,761,662円	6,765,963,551円
期中追加設定元本額	4,337,352,686円	1,480,174,624円
期中一部解約元本額	824,150,797円	2,189,987,840円
2. 受益権の総数	6,765,963,551口	6,056,150,335口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 平成30年 2月 6日 至 平成31年 2月 5日			第3期 自 平成31年 2月 6日 至 令和 2年 2月 5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	78,439,068円	費用控除後の配当等収益額	A	144,155,103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	578,195,311円	収益調整金額	C	604,899,407円
分配準備積立金額	D	385,525,871円	分配準備積立金額	D	329,520,391円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,042,160,250円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,078,574,901円
当ファンドの期末残存口数	F	6,765,963,551口	当ファンドの期末残存口数	F	6,056,150,335口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,540円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,780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2期 自 平成30年 2月 6日 至 平成31年 2月 5日	第3期 自 平成31年 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	<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2期 [平成31年 2月 5日現在]	第3期 [令和 2年 2月 5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 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(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2期	第3期
	[平成31年 2月 5日現在]	[令和 2年 2月 5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た場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	[平成31年 2月 5日現在]	[令和 2年 2月 5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	716,420,451	671,525,163
合計	716,420,451	671,525,163

(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2期	第3期
	[平成31年 2月 5日現在]	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.0048円	1.1120円
(1万口当たり純資産額)	(10,048円)	(11,120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	J P X 日経 4 0 0 インデックスマザーファンド	414,354,942	652,484,727	
	J A P A N クオリティ 1 5 0 インデックスマザーファンド	206,603,760	275,258,189	
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	663,887,514	899,700,358	
	日本・小型株・ファンド・マザーファンド	51,242,176	323,466,236	
	T O P I X マザーファンド	1,310,049,713	2,453,985,122	
	日本株オープン「35」マザーファンド	225,125,458	669,703,212	
	ジャパン・アクティブ・マザーファンド	103,792,502	329,312,850	
	日本株インカム・マザーファンド	459,168,997	972,244,434	
合計		3,434,225,062	6,576,155,128	

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。

T O P I X マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 2月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	82,180,481,029
株式	351,446,643,310
派生商品評価勘定	31,040,200

[令和 2年 2月 5日現在]

未収入金	2,783,626,015
未収配当金	502,611,330
未収利息	1,835,404
その他未収収益	55,274,413
差入委託証拠金	65,760,000
流動資産合計	437,067,271,701
資産合計	437,067,271,701
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	245,550
前受金	3,470,000
未払解約金	16,180,331,510
未払利息	28,369
受入担保金	64,301,557,323
流動負債合計	80,485,632,752
負債合計	80,485,632,752
純資産の部	
元本等	
元本	190,361,763,601
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	166,219,875,348
元本等合計	356,581,638,949
純資産合計	356,581,638,949
負債純資産合計	437,067,271,701

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 2月 5日現在]
1. 期首	平成31年 2月 6日
期首元本額	131,755,867,045円
期中追加設定元本額	218,914,110,721円
期中一部解約元本額	160,308,214,165円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内株式）	27,566,970,666円
eMAXIS TOPIXインデックス	9,562,209,749円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,126,245,991円
eMAXIS バランス（波乗り型）	95,366,863円
コアバランス	433,235円

	[令和 2年 2月 5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)	72,207,220円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	118,767,939円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	83,263,369円
eMAXIS Slim 国内株式(TOPIX)	7,435,216,420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)	3,070,983,792円
つみたて日本株式(TOPIX)	2,603,114,447円
つみたて8資産均等バランス	1,211,336,025円
つみたて4資産均等バランス	323,104,262円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,710,696円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,661,261円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,852,610円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	35,692,088円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	30,637,089円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	22,579,060円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	264,237,176円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	19,786,620円
国内株式インデックス・オープン(ラップ向け)	387,981,223円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	1,746,115,785円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,114,033,758円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	870,922,304円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	504,743,901円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	974,919,847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)	294,998,278円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	88,006,910円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	109,540,213円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	338,071,122円
eMAXIS 最適化バランス(マイフoward)	255,055,684円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	508,078,944円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	39,872,250円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,575,913,991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)	2,464,739,626円

[令和2年2月5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)	31,253,009,118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)	5,215,039円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	4,602,450円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	387,336,680円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	780,250,782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)	3,378,868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)	244,119,795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)	3,213,220,879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)	1,243,896,427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)	664,695,622円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	58,940,056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)	3,736,761,742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)	159,379,025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)	3,077,798,087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	7,573,635,280円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	4,315,323円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	15,953,717円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	13,708,179円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	13,493,670円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	1,296,201,684円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	237,629,330円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	28,219,028円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	234,079,630円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	22,062,429円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	143,471,487円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,725,798,714円

	[令和 2年 2月 5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)	520,190,803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)	1,995,729,618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)	1,723,137,989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)	1,440,556,416円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	50,525,126,583円
合計	190,361,763,601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	62,296,077,930円
3. 受益権の総数	190,361,763,601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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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 2月 5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 2月 5日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		17,199,786,527
合計		17,199,786,527

(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 2月 5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	2,305,665,000		2,336,535,000	30,870,000
合計		2,305,665,000		2,336,535,000	30,870,000

(注) 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.8732円
(1万口当たり純資産額)	(18,732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	7,000	2,872.00	20,104,000	貸付有価証券 4,900株（2,800株）
1332	日本水産	199,000	618.00	122,982,000	
1333	マルハニチロ	28,800	2,596.00	74,764,800	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
1376	カネコ種苗	6,000	1,298.00	7,788,000	
1377	サカタのタネ	23,700	3,450.00	81,765,000	貸付有価証券 16,600株（9,400株）
1379	ホクト	15,200	2,015.00	30,628,000	
1384	ホクリヨウ	3,100	768.00	2,380,800	
1514	住石ホールディングス	40,200	141.00	5,668,200	貸付有価証券 28,200株（16,000株）
1515	日鉄鉱業	4,600	4,440.00	20,424,000	貸付有価証券 300株（300株）
1518	三井松島ホールディングス	7,700	1,154.00	8,885,800	
1605	国際石油開発帝石	798,500	1,047.50	836,428,750	
1662	石油資源開発	26,000	2,735.00	71,110,000	
1663	K & Oエナジーグループ	9,700	1,659.00	16,092,300	貸付有価証券 1,600株
1413	ヒノキヤグループ	4,900	2,022.00	9,907,800	貸付有価証券 1,500株
1414	ショーボンドホールディングス	31,000	4,590.00	142,290,000	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	59,200	1,590.00	94,128,000	貸付有価証券 5,600株（5,600株）

1419	タマホーム	10,700	1,448.00	15,493,600	
1420	サンヨーホームズ	1,700	727.00	1,235,900	貸付有価証券 700株(200株)
1429	日本アクア	7,900	599.00	4,732,100	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	6,100	594.00	3,623,400	貸付有価証券 2,500株(600株)
1433	ベステラ	3,400	1,163.00	3,954,200	貸付有価証券 1,000株
1435	TATERU	41,000	212.00	8,692,000	貸付有価証券 12,200株
1446	キャンディル	1,800	827.00	1,488,600	
1448	スペースバリューホールディングス	24,300	552.00	13,413,600	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	1,084.00	4,119,200	
1716	第一カッター興業	2,500	1,782.00	4,455,000	貸付有価証券 200株(200株)
1717	明豊ファシリティアークス	4,800	799.00	3,835,200	
1719	安藤・間	118,500	908.00	107,598,000	
1720	東急建設	58,300	769.00	44,832,700	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
1721	コムシスホールディングス	70,600	3,120.00	220,272,000	
1726	ピーアールホールディングス	21,700	485.00	10,524,500	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	12,400	2,707.00	33,566,800	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	7,590.00	46,299,000	貸付有価証券 4,200株(2,400株)
1768	ソネック	2,000	803.00	1,606,000	貸付有価証券 600株(200株)
1780	ヤマウラ	8,600	953.00	8,195,800	貸付有価証券 2,500株
1801	大成建設	153,300	4,470.00	685,251,000	貸付有価証券 46,400株
1802	大林組	459,700	1,226.00	563,592,200	貸付有価証券 139,300株
1803	清水建設	466,500	1,135.00	529,477,500	貸付有価証券 327,400株(186,000株)
1805	飛鳥建設	13,200	1,424.00	18,796,800	
1808	長谷工コーポレーション	177,900	1,433.00	254,930,700	貸付有価証券 54,200株
1810	松井建設	18,100	771.00	13,955,100	貸付有価証券 5,500株
1811	銭高組	2,000	4,060.00	8,120,000	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	360,900	1,431.00	516,447,900	貸付有価証券 12,000株
1813	不動テトラ	12,000	1,712.00	20,544,000	
1814	大末建設	5,300	958.00	5,077,400	

1815	鉄建建設	10,000	2,812.00	28,120,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
1820	西松建設	35,400	2,477.00	87,685,800	
1821	三井住友建設	111,000	627.00	69,597,000	貸付有価証券 33,700株
1822	大豊建設	10,300	2,767.00	28,500,100	貸付有価証券 2,800株
1824	前田建設工業	115,100	1,063.00	122,351,300	貸付有価証券 45,800株(11,000株)
1826	佐田建設	9,900	426.00	4,217,400	
1827	ナカノフドー建設	12,600	488.00	6,148,800	貸付有価証券 8,100株(4,900株)
1833	奥村組	24,900	2,930.00	72,957,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
1835	東鉄工業	19,700	3,270.00	64,419,000	貸付有価証券 13,800株(7,800株)
1847	イチケン	3,300	1,786.00	5,893,800	貸付有価証券 200株(200株)
1848	富士ピー・エス	6,800	564.00	3,835,200	貸付有価証券 2,600株(600株)
1852	浅沼組	5,100	4,805.00	24,505,500	貸付有価証券 500株(500株)
1860	戸田建設	190,900	732.00	139,738,800	貸付有価証券 75,800株(18,200株)
1861	熊谷組	21,300	3,215.00	68,479,500	
1866	北野建設	2,800	2,526.00	7,072,800	貸付有価証券 800株
1867	植木組	2,000	2,483.00	4,966,000	
1870	矢作建設工業	20,300	837.00	16,991,100	貸付有価証券 8,200株(2,000株)
1871	ピーエス三菱	15,100	726.00	10,962,600	
1873	日本ハウスホールディングス	31,400	473.00	14,852,200	貸付有価証券 9,500株
1878	大東建託	55,100	12,770.00	703,627,000	貸付有価証券 21,900株(21,900株)
1879	新日本建設	19,500	912.00	17,784,000	貸付有価証券 5,900株
1881	N I P P O	38,000	2,700.00	102,600,000	貸付有価証券 11,600株
1882	東亜道路工業	2,900	3,440.00	9,976,000	
1883	前田道路	48,700	3,700.00	180,190,000	貸付有価証券 19,300株(4,600株)
1884	日本道路	4,400	7,910.00	34,804,000	貸付有価証券 1,500株(100株)
1885	東亜建設工業	14,300	1,650.00	23,595,000	
1887	日本国土開発	33,500	603.00	20,200,500	貸付有価証券 10,700株(2,600株)
1888	若築建設	8,300	1,651.00	13,703,300	
1890	東洋建設	51,500	521.00	26,831,500	

1893	五洋建設	182,200	676.00	123,167,200	貸付有価証券 127,800株(72,600株)
1898	世紀東急工業	22,100	920.00	20,332,000	
1899	福田組	5,300	4,930.00	26,129,000	貸付有価証券 2,100株(500株)
1911	住友林業	116,400	1,624.00	189,033,600	貸付有価証券 35,200株
1914	日本基礎技術	15,400	401.00	6,175,400	貸付有価証券 4,700株
1921	巴コーポレーション	20,400	418.00	8,527,200	貸付有価証券 14,300株(8,100株)
1925	大和ハウス工業	454,800	3,535.00	1,607,718,000	
1926	ライト工業	26,300	1,552.00	40,817,600	貸付有価証券 18,500株(10,500株)
1928	積水ハウス	502,900	2,375.00	1,194,387,500	
1929	日特建設	12,000	858.00	10,296,000	
1930	北陸電気工事	8,000	1,134.00	9,072,000	貸付有価証券 3,000株(600株)
1934	ユアテック	26,300	667.00	17,542,100	貸付有価証券 6,300株
1939	四電工	2,500	2,753.00	6,882,500	
1941	中電工	18,500	2,582.00	47,767,000	貸付有価証券 2,600株
1942	関電工	65,400	1,056.00	69,062,400	
1944	きんでん	109,200	1,853.00	202,347,600	貸付有価証券 10,400株(10,400株)
1945	東京エネシス	15,300	927.00	14,183,100	貸付有価証券 4,700株
1946	トーエネック	4,600	3,710.00	17,066,000	
1949	住友電設	13,000	2,582.00	33,566,000	貸付有価証券 5,100株(1,200株)
1950	日本電設工業	25,200	2,350.00	59,220,000	貸付有価証券 17,800株(10,100株)
1951	協和エクシオ	69,700	2,735.00	190,629,500	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
1952	新日本空調	12,200	2,117.00	25,827,400	貸付有価証券 8,500株(4,800株)
1959	九電工	32,200	3,255.00	104,811,000	
1961	三機工業	33,100	1,473.00	48,756,300	貸付有価証券 10,100株
1963	日揮ホールディングス	141,500	1,535.00	217,202,500	貸付有価証券 56,200株(56,200株)
1964	中外炉工業	5,000	1,792.00	8,960,000	貸付有価証券 500株(500株)
1967	ヤマト	14,700	830.00	12,201,000	貸付有価証券 8,900株(4,500株)
1968	太平電業	11,100	2,453.00	27,228,300	貸付有価証券 4,400株(1,100株)
1969	高砂熱学工業	39,900	1,936.00	77,246,400	貸付有価証券 12,000株

1972	三晃金属工業	2,000	2,683.00	5,366,000	
1975	朝日工業社	3,100	3,415.00	10,586,500	
1976	明星工業	29,700	833.00	24,740,100	貸付有価証券 9,000株
1979	大気社	22,400	3,850.00	86,240,000	貸付有価証券 8,900株(2,100株)
1980	ダイダン	11,000	2,695.00	29,645,000	貸付有価証券 4,300株(1,000株)
1982	日比谷総合設備	14,800	1,943.00	28,756,400	貸付有価証券 5,800株(1,400株)
3267	フィル・カンパニー	2,000	4,085.00	8,170,000	
5912	OSJBホールディングス	72,500	286.00	20,735,000	
6330	東洋エンジニアリング	19,300	574.00	11,078,200	貸付有価証券 7,600株(7,600株)
6379	レイズネクスト	24,700	1,315.00	32,480,500	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
2001	日本製粉	43,000	1,660.00	71,380,000	貸付有価証券 13,100株
2002	日清製粉グループ本社	166,200	1,927.00	320,267,400	貸付有価証券 50,200株
2003	日東富士製粉	1,100	6,330.00	6,963,000	
2004	昭和産業	13,500	3,065.00	41,377,500	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
2009	鳥越製粉	13,000	837.00	10,881,000	貸付有価証券 4,000株
2053	中部飼料	18,000	1,694.00	30,492,000	貸付有価証券 7,100株(1,700株)
2060	フィード・ワン	98,800	188.00	18,574,400	貸付有価証券 29,800株
2107	東洋精糖	2,500	1,188.00	2,970,000	
2108	日本甜菜製糖	7,700	1,921.00	14,791,700	
2109	三井製糖	12,900	2,207.00	28,470,300	貸付有価証券 3,900株
2112	塩水港精糖	15,900	232.00	3,688,800	
2117	日新製糖	7,000	2,005.00	14,035,000	
2201	森永製菓	34,500	5,280.00	182,160,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
2204	中村屋	3,800	4,035.00	15,333,000	貸付有価証券 700株
2206	江崎グリコ	43,600	4,880.00	212,768,000	
2207	名糖産業	7,100	1,405.00	9,975,500	
2209	井村屋グループ	6,300	1,943.00	12,240,900	貸付有価証券 1,900株
2211	不二家	8,200	2,231.00	18,294,200	貸付有価証券 5,700株(3,200株)
2212	山崎製パン	110,300	2,114.00	233,174,200	貸付有価証券 43,800株(43,800株)
2215	第一屋製パン	2,500	934.00	2,335,000	

2217	モロゾフ	2,500	5,030.00	12,575,000	貸付有価証券 800株
2220	亀田製菓	8,400	5,060.00	42,504,000	
2222	寿スピリッツ	14,200	7,150.00	101,530,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
2229	カルビー	67,000	3,685.00	246,895,000	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
2264	森永乳業	27,200	4,270.00	116,144,000	
2266	六甲バター	9,800	1,637.00	16,042,600	貸付有価証券 3,900株（900株）
2267	ヤクルト本社	101,200	5,750.00	581,900,000	貸付有価証券 9,700株（9,700株）
2269	明治ホールディングス	97,300	7,790.00	757,967,000	貸付有価証券 10,400株
2270	雪印メグミルク	35,400	2,665.00	94,341,000	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
2281	プリマハム	23,000	2,584.00	59,432,000	貸付有価証券 15,900株（9,000株）
2282	日本ハム	56,200	4,860.00	273,132,000	
2286	林兼産業	4,900	723.00	3,542,700	
2288	丸大食品	15,700	2,159.00	33,896,300	貸付有価証券 6,300株（1,500株）
2292	S Foods	11,700	2,694.00	31,519,800	貸付有価証券 8,300株（4,700株）
2294	柿安本店	5,100	3,230.00	16,473,000	
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	94,700	718.00	67,994,600	貸付有価証券 37,100株（8,500株）
2501	サッポロホールディングス	50,200	2,706.00	135,841,200	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	308,100	5,061.00	1,559,294,100	貸付有価証券 121,900株（29,400株）
2503	キリンホールディングス	623,900	2,463.00	1,536,665,700	
2531	宝ホールディングス	110,100	969.00	106,686,900	貸付有価証券 33,300株
2533	オエノンホールディングス	38,800	407.00	15,791,600	
2540	養命酒製造	4,500	1,986.00	8,937,000	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	103,300	3,010.00	310,933,000	貸付有価証券 9,900株（9,900株）
2587	サントリー食品インターナショナル	98,400	4,750.00	467,400,000	
2590	ダイドーグループホールディングス	7,500	4,185.00	31,387,500	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
2593	伊藤園	44,700	5,480.00	244,956,000	貸付有価証券 17,800株（4,300株）
2594	キーコーヒー	14,500	2,335.00	33,857,500	
2597	ユニカフェ	3,800	964.00	3,663,200	
2599	ジャパンフーズ	2,100	1,243.00	2,610,300	
2602	日清オイリオグループ	18,900	3,735.00	70,591,500	

2607	不二製油グループ本社	35,900	2,886.00	103,607,400	貸付有価証券 25,000株(14,200株)
2612	かどや製油	1,600	3,860.00	6,176,000	貸付有価証券 500株
2613	J - オイルミルズ	7,600	4,105.00	31,198,000	貸付有価証券 1,600株
2801	キッコーマン	105,900	5,670.00	600,453,000	貸付有価証券 31,800株
2802	味の素	324,900	1,947.00	632,580,300	
2809	キューピー	81,900	2,241.00	183,537,900	貸付有価証券 24,700株
2810	ハウス食品グループ本社	55,000	3,630.00	199,650,000	
2811	カゴメ	55,800	2,815.00	157,077,000	貸付有価証券 22,200株(22,200株)
2812	焼津水産化学工業	7,100	1,029.00	7,305,900	
2815	アリアケジャパン	13,400	7,420.00	99,428,000	
2818	ピエトロ	1,900	1,641.00	3,117,900	
2819	エバラ食品工業	3,600	2,182.00	7,855,200	
2820	やまみ	900	2,150.00	1,935,000	
2871	ニチレイ	70,100	2,831.00	198,453,100	
2875	東洋水産	75,700	4,725.00	357,682,500	貸付有価証券 7,200株(7,200株)
2882	イトアンド	5,100	1,901.00	9,695,100	
2883	大冷	1,900	1,965.00	3,733,500	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	1,173.00	9,501,300	貸付有価証券 3,100株(700株)
2897	日清食品ホールディングス	62,500	8,830.00	551,875,000	貸付有価証券 18,900株
2899	永谷園ホールディングス	7,200	2,171.00	15,631,200	
2904	一正蒲鉾	5,700	982.00	5,597,400	貸付有価証券 1,700株
2908	フジッコ	15,900	1,994.00	31,704,600	貸付有価証券 6,300株(6,300株)
2910	ロック・フィールド	15,800	1,472.00	23,257,600	貸付有価証券 11,100株(6,300株)
2914	日本たばこ産業	849,500	2,298.00	1,952,151,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	8,200	2,486.00	20,385,200	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	9,600	1,924.00	18,470,400	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
2922	なとり	8,200	1,726.00	14,153,200	
2924	イフジ産業	2,600	763.00	1,983,800	
2925	ピックルスコーポレーション	3,200	2,778.00	8,889,600	貸付有価証券 300株(300株)
2930	北の達人コーポレーション	51,400	657.00	33,769,800	貸付有価証券 20,500株(4,900株)
2931	ユーグレナ	62,700	1,012.00	63,452,400	貸付有価証券 24,900株(24,900株)
4404	ミヨシ油脂	5,600	1,216.00	6,809,600	

4526	理研ビタミン	6,900	4,000.00	27,600,000	貸付有価証券 2,100株
3001	片倉工業	20,800	1,288.00	26,790,400	
3002	グンゼ	10,500	4,490.00	47,145,000	
3101	東洋紡	56,700	1,529.00	86,694,300	貸付有価証券 4,900株
3103	ユニチカ	42,100	367.00	15,450,700	貸付有価証券 12,700株
3104	富士紡ホールディングス	6,900	3,565.00	24,598,500	貸付有価証券 2,100株
3106	倉敷紡績	14,200	2,359.00	33,497,800	貸付有価証券 10,400株（5,900株）
3109	シキボウ	7,500	1,324.00	9,930,000	貸付有価証券 3,000株（700株）
3201	日本毛織	47,200	1,071.00	50,551,200	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
3202	ダイトウボウ	23,400	221.00	5,171,400	貸付有価証券 7,000株
3204	トーア紡コーポレーション	5,700	543.00	3,095,100	
3205	ガイドーリミテッド	18,900	272.00	5,140,800	
3302	帝国繊維	16,100	2,518.00	40,539,800	貸付有価証券 6,400株（1,500株）
3401	帝人	117,100	2,026.00	237,244,600	貸付有価証券 12,300株
3402	東レ	1,039,400	724.10	752,629,540	
3408	サカイオーベックス	3,800	1,761.00	6,691,800	
3501	住江織物	3,100	2,499.00	7,746,900	貸付有価証券 1,100株
3512	日本フェルト	8,100	499.00	4,041,900	
3513	イチカワ	2,000	1,458.00	2,916,000	貸付有価証券 200株
3524	日東製網	1,700	1,661.00	2,823,700	
3529	アツギ	11,800	767.00	9,050,600	
3551	ダイニック	5,400	773.00	4,174,200	貸付有価証券 1,600株
3569	セーレン	35,300	1,600.00	56,480,000	
3571	ソトー	5,700	974.00	5,551,800	
3577	東海染工	2,000	1,140.00	2,280,000	
3580	小松マテーレ	23,600	813.00	19,186,800	貸付有価証券 9,300株（2,200株）
3591	ワコールホールディングス	37,500	3,060.00	114,750,000	
3593	ホギメディカル	16,400	3,565.00	58,466,000	貸付有価証券 5,000株
3606	レナウン	36,900	108.00	3,985,200	
3607	クラウドシアホールディングス	3,500	483.00	1,690,500	
3608	T S Iホールディングス	48,100	528.00	25,396,800	
3611	マツオカコーポレーション	4,100	1,910.00	7,831,000	貸付有価証券 1,200株

3612	ワールド	20,300	2,619.00	53,165,700	
8011	三陽商会	7,500	1,265.00	9,487,500	貸付有価証券 4,600株（2,300株）
8013	ナイガイ	5,200	440.00	2,288,000	
8016	オンワードホールディングス	86,200	632.00	54,478,400	貸付有価証券 34,300株（34,300株）
8029	ルックホールディングス	4,900	1,077.00	5,277,300	
8107	キムラタン	74,900	28.00	2,097,200	貸付有価証券 29,600株（7,100株）
8111	ゴールドウイン	26,000	6,650.00	172,900,000	貸付有価証券 10,300株（10,300株）
8114	デサント	28,000	1,812.00	50,736,000	貸付有価証券 8,600株
8118	キング	6,800	575.00	3,910,000	
8127	ヤマトインターナショナル	8,700	411.00	3,575,700	
3708	特種東海製紙	9,100	4,055.00	36,900,500	貸付有価証券 6,400株（3,600株）
3861	王子ホールディングス	600,100	591.00	354,659,100	
3863	日本製紙	63,500	1,840.00	116,840,000	貸付有価証券 25,300株（25,300株）
3864	三菱製紙	16,300	468.00	7,628,400	
3865	北越コーポレーション	95,200	524.00	49,884,800	
3877	中越パルプ工業	6,100	1,616.00	9,857,600	
3878	巴川製紙所	4,300	891.00	3,831,300	
3880	大王製紙	63,000	1,490.00	93,870,000	貸付有価証券 44,200株（25,100株）
3896	阿波製紙	3,700	577.00	2,134,900	貸付有価証券 1,500株（400株）
3941	レンゴー	135,700	871.00	118,194,700	
3946	トーモク	8,800	1,848.00	16,262,400	貸付有価証券 2,000株
3950	ザ・バック	10,900	4,095.00	44,635,500	貸付有価証券 7,600株（4,300株）
3405	クラレ	226,100	1,337.00	302,295,700	貸付有価証券 17,200株（17,200株）
3407	旭化成	951,500	1,151.00	1,095,176,500	貸付有価証券 91,600株（91,600株）
3553	共和レザー	7,800	787.00	6,138,600	貸付有価証券 1,900株
4004	昭和電工	102,200	2,682.00	274,100,400	貸付有価証券 40,600株（9,700株）
4005	住友化学	1,054,700	454.00	478,833,800	貸付有価証券 100,900株（100,900株）
4008	住友精化	6,400	3,055.00	19,552,000	
4021	日産化学	80,300	4,660.00	374,198,000	
4022	ラサ工業	5,100	1,483.00	7,563,300	貸付有価証券 3,200株（1,900株）

4023	クレハ	12,300	6,160.00	75,768,000	貸付有価証券 8,600株(4,900株)
4025	多木化学	4,200	4,430.00	18,606,000	貸付有価証券 1,700株(400株)
4027	テイカ	10,500	1,921.00	20,170,500	貸付有価証券 7,400株(4,200株)
4028	石原産業	25,700	939.00	24,132,300	
4031	片倉コープアグリ	3,700	1,235.00	4,569,500	
4041	日本曹達	21,200	3,400.00	72,080,000	貸付有価証券 6,400株
4042	東ソー	221,900	1,659.00	368,132,100	貸付有価証券 1,900株
4043	トクヤマ	41,400	2,784.00	115,257,600	貸付有価証券 12,500株
4044	セントラル硝子	29,300	2,405.00	70,466,500	貸付有価証券 8,900株
4045	東亜合成	90,100	1,273.00	114,697,300	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
4046	大阪ソーダ	14,600	2,942.00	42,953,200	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
4047	関東電化工業	34,000	1,026.00	34,884,000	
4061	デンカ	52,400	3,010.00	157,724,000	
4063	信越化学工業	246,500	13,095.00	3,227,917,500	
4064	日本カーバイド工業	4,900	1,366.00	6,693,400	
4078	堺化学工業	9,300	2,314.00	21,520,200	貸付有価証券 900株(900株)
4082	第一稀元素化学工業	15,500	923.00	14,306,500	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
4088	エア・ウォーター	133,500	1,551.00	207,058,500	
4091	大陽日酸	138,000	2,453.00	338,514,000	
4092	日本化学工業	4,500	3,345.00	15,052,500	貸付有価証券 3,200株(1,800株)
4093	東邦アセチレン	2,200	1,363.00	2,998,600	貸付有価証券 100株(100株)
4095	日本パーカライジング	72,400	1,167.00	84,490,800	貸付有価証券 6,900株(6,900株)
4097	高圧ガス工業	22,800	810.00	18,468,000	貸付有価証券 5,900株
4098	チタン工業	1,800	2,439.00	4,390,200	貸付有価証券 1,200株(700株)
4099	四国化成工業	22,100	1,275.00	28,177,500	貸付有価証券 8,800株(2,100株)
4100	戸田工業	3,300	2,126.00	7,015,800	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
4109	ステラ ケミファ	7,800	3,140.00	24,492,000	
4112	保土谷化学工業	5,400	4,455.00	24,057,000	貸付有価証券 1,600株
4114	日本触媒	22,300	6,040.00	134,692,000	貸付有価証券 8,900株(2,100株)

4116	大日精化工業	12,700	2,968.00	37,693,600	貸付有価証券 3,800株
4118	カネカ	37,100	3,440.00	127,624,000	
4182	三菱瓦斯化学	135,500	1,665.00	225,607,500	貸付有価証券 41,100株
4183	三井化学	130,300	2,561.00	333,698,300	
4185	J S R	133,800	2,053.00	274,691,400	
4186	東京応化工業	24,600	4,680.00	115,128,000	貸付有価証券 17,100株(9,700株)
4187	大阪有機化学工業	13,300	1,834.00	24,392,200	貸付有価証券 4,000株
4188	三菱ケミカルホールディングス	959,700	806.60	774,094,020	貸付有価証券 91,500株(91,500株)
4189	K Hネオケム	25,300	2,483.00	62,819,900	貸付有価証券 17,600株(10,000株)
4202	ダイセル	196,400	1,012.00	198,756,800	貸付有価証券 78,100株(18,800株)
4203	住友ベークライト	22,600	4,100.00	92,660,000	
4204	積水化学工業	308,700	1,841.00	568,316,700	
4205	日本ゼオン	129,500	1,220.00	157,990,000	貸付有価証券 8,100株
4206	アイカ工業	43,100	3,465.00	149,341,500	貸付有価証券 17,100株(4,100株)
4208	宇部興産	72,500	2,190.00	158,775,000	貸付有価証券 6,900株(6,900株)
4212	積水樹脂	25,800	2,493.00	64,319,400	
4215	タキロンシーアイ	31,100	676.00	21,023,600	
4216	旭有機材	8,100	1,644.00	13,316,400	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
4217	日立化成	64,000	4,600.00	294,400,000	貸付有価証券 20,000株
4218	ニチバン	7,500	1,767.00	13,252,500	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
4220	リケンテクノス	36,100	473.00	17,075,300	貸付有価証券 500株(500株)
4221	大倉工業	6,800	1,747.00	11,879,600	貸付有価証券 2,000株
4228	積水化成品工業	19,200	704.00	13,516,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
4229	群栄化学工業	3,300	2,414.00	7,966,200	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
4231	タイガースポリマー	7,600	569.00	4,324,400	貸付有価証券 1,000株
4238	ミライアル	5,100	1,217.00	6,206,700	貸付有価証券 500株(500株)
4245	ダイキアクシス	5,100	864.00	4,406,400	貸付有価証券 2,000株(500株)
4246	ダイキョーニシカワ	30,300	778.00	23,573,400	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
4248	竹本容器	5,100	886.00	4,518,600	貸付有価証券 2,100株(500株)

4249	森六ホールディングス	7,700	2,234.00	17,201,800	貸付有価証券 2,300株
4272	日本化薬	88,900	1,292.00	114,858,800	貸付有価証券 26,900株
4275	カーリットホールディングス	15,300	588.00	8,996,400	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
4362	日本精化	11,500	1,399.00	16,088,500	貸付有価証券 4,600株(1,100株)
4368	扶桑化学工業	14,500	3,540.00	51,330,000	貸付有価証券 5,800株(1,400株)
4369	トリケミカル研究所	3,200	11,870.00	37,984,000	貸付有価証券 1,300株(300株)
4401	A D E K A	66,100	1,620.00	107,082,000	貸付有価証券 20,000株
4403	日油	54,100	3,595.00	194,489,500	貸付有価証券 16,300株
4406	新日本理化	23,800	214.00	5,093,200	貸付有価証券 16,700株(9,500株)
4410	ハリマ化成グループ	11,900	1,124.00	13,375,600	貸付有価証券 4,700株(1,100株)
4452	花王	350,900	8,581.00	3,011,072,900	
4461	第一工業製薬	5,300	4,475.00	23,717,500	貸付有価証券 1,600株
4462	石原ケミカル	3,900	1,766.00	6,887,400	貸付有価証券 1,400株(300株)
4463	日華化学	4,800	850.00	4,080,000	貸付有価証券 3,400株(1,900株)
4465	ニイタカ	2,200	2,408.00	5,297,600	貸付有価証券 700株
4471	三洋化成工業	8,600	4,820.00	41,452,000	
4531	有機合成薬品工業	11,000	269.00	2,959,000	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	16,200	1,122.00	18,176,400	
4612	日本ペイントホールディングス	118,500	5,500.00	651,750,000	貸付有価証券 47,000株(47,000株)
4613	関西ペイント	161,300	2,588.00	417,444,400	貸付有価証券 64,100株(15,400株)
4615	神東塗料	11,300	207.00	2,339,100	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	40,900	978.00	40,000,200	
4619	日本特殊塗料	10,700	1,348.00	14,423,600	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
4620	藤倉化成	19,400	557.00	10,805,800	
4626	太陽ホールディングス	10,500	4,755.00	49,927,500	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
4631	D I C	60,600	2,922.00	177,073,200	
4633	サカタインクス	31,300	1,204.00	37,685,200	貸付有価証券 6,400株
4634	東洋インキS Cホールディングス	30,300	2,503.00	75,840,900	貸付有価証券 12,100株(2,900株)

4636	T & K T O K A	11,100	987.00	10,955,700	貸付有価証券 1,700株
4901	富士フイルムホールディングス	281,000	5,536.00	1,555,616,000	
4911	資生堂	291,200	7,035.00	2,048,592,000	貸付有価証券 27,800株（27,800株）
4912	ライオン	190,600	2,067.00	393,970,200	貸付有価証券 18,200株（18,200株）
4914	高砂香料工業	9,200	2,398.00	22,061,600	貸付有価証券 2,800株
4917	マンダム	32,900	2,620.00	86,198,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
4919	ミルボン	19,600	5,640.00	110,544,000	貸付有価証券 7,800株（7,800株）
4921	ファンケル	59,300	3,000.00	177,900,000	貸付有価証券 18,000株
4922	コーセー	27,600	14,550.00	401,580,000	貸付有価証券 10,900株（2,600株）
4923	コタ	7,700	1,511.00	11,634,700	貸付有価証券 700株（700株）
4926	シーボン	1,900	2,468.00	4,689,200	貸付有価証券 600株
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	62,600	2,394.00	149,864,400	
4928	ノエビアホールディングス	14,000	5,230.00	73,220,000	
4929	アジュバンコスメジャパン	3,300	980.00	3,234,000	
4951	エステー	9,400	1,672.00	15,716,800	貸付有価証券 2,900株
4955	アグロ カネショウ	4,600	1,445.00	6,647,000	貸付有価証券 1,800株（400株）
4956	コニシ	24,100	1,574.00	37,933,400	貸付有価証券 9,600株（2,300株）
4958	長谷川香料	19,400	2,267.00	43,979,800	貸付有価証券 5,900株
4963	星光PMC	8,400	961.00	8,072,400	
4967	小林製薬	41,100	8,810.00	362,091,000	貸付有価証券 16,300株（16,300株）
4968	荒川化学工業	13,200	1,514.00	19,984,800	貸付有価証券 9,200株（5,200株）
4971	メック	10,000	1,667.00	16,670,000	貸付有価証券 3,000株
4973	日本高純度化学	4,000	2,653.00	10,612,000	
4974	タカラバイオ	38,400	2,132.00	81,868,800	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
4975	J C U	17,700	3,075.00	54,427,500	貸付有価証券 5,400株
4977	新田ゼラチン	9,200	664.00	6,108,800	貸付有価証券 6,500株（3,700株）
4979	O A T アグリオ	2,500	1,473.00	3,682,500	貸付有価証券 200株（200株）
4980	デクセリアルズ	37,800	927.00	35,040,600	
4985	アース製薬	11,100	5,970.00	66,267,000	

4992	北興化学工業	15,000	634.00	9,510,000	
4994	大成ラミック	4,800	2,817.00	13,521,600	
4996	クミアイ化学工業	60,600	873.00	52,903,800	貸付有価証券 42,400株（24,100株）
4997	日本農薬	26,100	573.00	14,955,300	貸付有価証券 10,400株（2,500株）
5142	アキレス	10,100	1,719.00	17,361,900	貸付有価証券 1,000株
5208	有沢製作所	23,200	1,007.00	23,362,400	貸付有価証券 9,200株（9,200株）
6988	日東電工	101,100	6,210.00	627,831,000	
7874	レック	15,600	1,258.00	19,624,800	貸付有価証券 10,900株（6,200株）
7888	三光合成	16,800	354.00	5,947,200	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
7908	きもと	24,900	176.00	4,382,400	
7917	藤森工業	13,200	3,425.00	45,210,000	
7925	前澤化成工業	9,300	1,170.00	10,881,000	貸付有価証券 2,800株
7931	未来工業	7,900	2,103.00	16,613,700	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	5,100	727.00	3,707,700	
7942	J S P	8,600	1,922.00	16,529,200	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
7947	エフピコ	16,100	6,680.00	107,548,000	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
7958	天馬	9,800	2,006.00	19,658,800	貸付有価証券 900株（900株）
7970	信越ポリマー	26,300	989.00	26,010,700	貸付有価証券 7,900株
7971	東リ	36,500	300.00	10,950,000	
7988	ニフコ	53,800	2,881.00	154,997,800	貸付有価証券 5,100株（5,100株）
7995	バルカー	11,900	2,421.00	28,809,900	貸付有価証券 3,600株
8113	ユニ・チャーム	282,500	3,700.00	1,045,250,000	貸付有価証券 85,300株
9385	ショーエイコーポレーション	1,600	835.00	1,336,000	貸付有価証券 600株（100株）
4151	協和キリン	147,400	2,638.00	388,841,200	
4502	武田薬品工業	1,219,500	4,328.00	5,277,996,000	
4503	アステラス製薬	1,289,300	1,884.00	2,429,041,200	貸付有価証券 244,800株
4506	大日本住友製薬	108,600	1,836.00	199,389,600	貸付有価証券 26,500株
4507	塩野義製薬	187,400	6,465.00	1,211,541,000	
4512	わかもと製薬	17,400	252.00	4,384,800	貸付有価証券 5,200株
4514	あすか製薬	16,700	1,181.00	19,722,700	

4516	日本新薬	38,400	9,840.00	377,856,000	貸付有価証券 8,300株
4517	ビオフェルミン製薬	2,500	2,410.00	6,025,000	
4519	中外製薬	152,800	11,690.00	1,786,232,000	
4521	科研製薬	25,100	5,950.00	149,345,000	
4523	エーザイ	175,400	9,042.00	1,585,966,800	
4527	ロート製薬	75,200	3,205.00	241,016,000	貸付有価証券 22,800株
4528	小野薬品工業	336,600	2,626.50	884,079,900	
4530	久光製薬	38,800	5,640.00	218,832,000	貸付有価証券 29,800株（16,700株）
4534	持田製薬	20,300	4,210.00	85,463,000	貸付有価証券 4,900株
4536	参天製薬	272,900	2,069.00	564,630,100	
4538	扶桑薬品工業	5,200	1,953.00	10,155,600	
4539	日本ケミファ	1,900	2,611.00	4,960,900	貸付有価証券 300株
4540	ツムラ	45,400	2,998.00	136,109,200	貸付有価証券 4,300株（4,300株）
4541	日医工	41,500	1,305.00	54,157,500	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
4547	キッセイ薬品工業	25,900	3,055.00	79,124,500	
4548	生化学工業	28,400	1,245.00	35,358,000	
4549	栄研化学	25,800	2,309.00	59,572,200	貸付有価証券 10,300株（2,500株）
4550	日水製薬	6,200	1,331.00	8,252,200	
4551	鳥居薬品	9,200	3,750.00	34,500,000	
4552	JCRファーマ	10,300	9,970.00	102,691,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
4553	東和薬品	18,800	2,548.00	47,902,400	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
4554	富士製薬工業	10,000	1,399.00	13,990,000	貸付有価証券 3,000株
4555	沢井製薬	30,100	7,300.00	219,730,000	
4559	ゼリア新薬工業	26,600	2,070.00	55,062,000	貸付有価証券 14,800株（10,600株）
4568	第一三共	419,400	7,900.00	3,313,260,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	32,300	2,125.00	68,637,500	
4574	大幸薬品	5,900	3,725.00	21,977,500	貸付有価証券 600株（600株）
4577	ダイト	8,700	3,665.00	31,885,500	
4578	大塚ホールディングス	279,200	4,948.00	1,381,481,600	
4581	大正製薬ホールディングス	31,000	8,020.00	248,620,000	
4587	ペプチドリーム	74,100	5,360.00	397,176,000	貸付有価証券 51,800株（29,400株）
3315	日本コークス工業	123,800	79.00	9,780,200	貸付有価証券 37,400株
5011	ニチレキ	17,300	1,355.00	23,441,500	

5013	ユシロ化学工業	8,200	1,394.00	11,430,800	
5015	ビーピー・カストロール	5,200	1,441.00	7,493,200	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
5017	富士石油	39,100	224.00	8,758,400	貸付有価証券 15,500株（15,500株）
5018	MORESCO	5,300	1,404.00	7,441,200	
5019	出光興産	164,900	2,767.00	456,278,300	
5020	JXTGホールディングス	2,205,000	467.90	1,031,719,500	
5021	コスモエネルギーホールディングス	42,400	2,126.00	90,142,400	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
5101	横浜ゴム	84,900	1,886.00	160,121,400	貸付有価証券 25,600株
5105	TOYO TIRE	84,200	1,402.00	118,048,400	
5108	ブリヂストン	450,500	3,941.00	1,775,420,500	
5110	住友ゴム工業	131,700	1,233.00	162,386,100	貸付有価証券 12,600株（12,600株）
5121	藤倉コンポジット	12,800	438.00	5,606,400	
5122	オカモト	8,900	3,965.00	35,288,500	
5185	フコク	6,400	710.00	4,544,000	
5186	ニッタ	16,500	3,200.00	52,800,000	貸付有価証券 6,500株（6,500株）
5191	住友理工	28,400	861.00	24,452,400	貸付有価証券 8,300株（2,800株）
5192	三ツ星ベルト	19,300	1,975.00	38,117,500	貸付有価証券 4,200株
5195	バンドー化学	25,800	822.00	21,207,600	
3110	日東紡績	21,800	4,620.00	100,716,000	貸付有価証券 8,700株（2,100株）
5201	A G C	144,900	3,725.00	539,752,500	
5202	日本板硝子	70,100	596.00	41,779,600	貸付有価証券 49,000株（27,800株）
5204	石塚硝子	2,700	2,615.00	7,060,500	
5210	日本山村硝子	6,100	1,210.00	7,381,000	貸付有価証券 600株（600株）
5214	日本電気硝子	58,900	2,203.00	129,756,700	
5218	オハラ	5,800	1,237.00	7,174,600	貸付有価証券 2,300株（600株）
5232	住友大阪セメント	27,700	4,500.00	124,650,000	
5233	太平洋セメント	92,600	3,000.00	277,800,000	貸付有価証券 28,000株
5262	日本ヒューム	14,700	815.00	11,980,500	
5269	日本コンクリート工業	31,600	286.00	9,037,600	貸付有価証券 12,500株（3,000株）
5273	三谷セキサン	6,800	3,910.00	26,588,000	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	20,800	571.00	11,876,800	
5301	東海カーボン	153,500	1,020.00	156,570,000	貸付有価証券 107,400株（61,000株）

5302	日本カーボン	7,500	3,860.00	28,950,000	貸付有価証券 5,300株(3,000株)
5310	東洋炭素	8,600	2,108.00	18,128,800	貸付有価証券 2,600株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	8,100	4,355.00	35,275,500	
5332	TOTO	104,700	4,870.00	509,889,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
5333	日本碍子	178,900	1,853.00	331,501,700	貸付有価証券 17,100株(17,100株)
5334	日本特殊陶業	114,100	1,917.00	218,729,700	
5337	ダントーホールディングス	10,900	114.00	1,242,600	貸付有価証券 3,300株
5344	MARUWA	5,600	8,100.00	45,360,000	貸付有価証券 3,900株(2,200株)
5351	品川リフラクトリーズ	3,900	3,005.00	11,719,500	貸付有価証券 1,200株
5352	黒崎播磨	2,900	6,350.00	18,415,000	貸付有価証券 2,000株(1,100株)
5357	ヨータイ	11,600	706.00	8,189,600	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
5358	イソライト工業	7,500	603.00	4,522,500	
5363	東京窯業	18,600	319.00	5,933,400	貸付有価証券 13,000株(7,400株)
5367	ニッカトー	6,600	664.00	4,382,400	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
5384	フジインコーポレーテッド	13,100	3,015.00	39,496,500	貸付有価証券 9,200株(5,200株)
5388	クニミネ工業	5,900	1,319.00	7,782,100	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,500	1,543.00	3,857,500	
5393	ニチアス	40,100	2,647.00	106,144,700	貸付有価証券 12,100株
7943	ニチハ	20,400	2,747.00	56,038,800	
5401	日本製鉄	648,700	1,525.00	989,267,500	貸付有価証券 155,100株(155,100株)
5406	神戸製鋼所	265,300	499.00	132,384,700	貸付有価証券 105,400株(25,300株)
5408	中山製鋼所	20,100	493.00	9,909,300	貸付有価証券 6,100株
5410	合同製鐵	7,800	2,973.00	23,189,400	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	391,500	1,313.00	514,039,500	貸付有価証券 37,300株(37,300株)
5423	東京製鐵	70,600	826.00	58,315,600	貸付有価証券 21,400株
5440	共英製鋼	16,300	1,886.00	30,741,800	貸付有価証券 4,900株
5444	大和工業	30,800	2,596.00	79,956,800	貸付有価証券 9,300株
5445	東京鐵鋼	6,000	1,500.00	9,000,000	貸付有価証券 600株(600株)

5449	大阪製鐵	7,700	1,601.00	12,327,700	貸付有価証券 2,400株
5451	淀川製鋼所	19,600	1,999.00	39,180,400	貸付有価証券 4,300株(1,900株)
5463	丸一鋼管	47,100	3,070.00	144,597,000	貸付有価証券 33,000株(18,700株)
5464	モリ工業	4,300	2,919.00	12,551,700	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
5471	大同特殊鋼	23,700	4,360.00	103,332,000	貸付有価証券 16,600株(9,400株)
5476	日本高周波鋼業	5,300	426.00	2,257,800	貸付有価証券 800株
5480	日本冶金工業	12,000	2,106.00	25,272,000	
5481	山陽特殊製鋼	9,900	1,401.00	13,869,900	
5482	愛知製鋼	8,100	3,525.00	28,552,500	
5486	日立金属	156,100	1,773.00	276,765,300	貸付有価証券 47,200株
5491	日本金属	3,400	856.00	2,910,400	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
5541	大平洋金属	9,800	2,201.00	21,569,800	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
5563	新日本電工	93,400	170.00	15,878,000	貸付有価証券 65,300株(37,100株)
5602	栗本鐵工所	7,200	2,169.00	15,616,800	
5603	虹技	2,100	1,339.00	2,811,900	
5612	日本鑄鉄管	1,500	1,482.00	2,223,000	貸付有価証券 500株
5632	三菱製鋼	10,700	999.00	10,689,300	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
5658	日亜鋼業	21,200	331.00	7,017,200	貸付有価証券 14,800株(8,400株)
5659	日本精線	2,400	3,745.00	8,988,000	
5698	エンビプロ・ホールディングス	6,200	753.00	4,668,600	貸付有価証券 1,600株
6319	シンニッタン	22,500	462.00	10,395,000	貸付有価証券 8,900株(8,900株)
7305	新家工業	3,300	1,436.00	4,738,800	
5702	大紀アルミニウム工業所	23,800	685.00	16,303,000	貸付有価証券 5,600株(2,300株)
5703	日本軽金属ホールディングス	366,700	212.00	77,740,400	貸付有価証券 35,100株(35,100株)
5706	三井金属鉱業	39,100	2,652.00	103,693,200	貸付有価証券 11,800株
5707	東邦亜鉛	7,400	1,921.00	14,215,400	貸付有価証券 2,200株
5711	三菱マテリアル	95,700	2,828.00	270,639,600	貸付有価証券 9,100株(9,100株)
5713	住友金属鉱山	185,300	3,193.00	591,662,900	
5714	DOWAホールディングス	36,700	3,985.00	146,249,500	貸付有価証券 14,600株(3,500株)

5715	古河機械金属	25,800	1,346.00	34,726,800	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
5721	エス・サイエンス	64,100	45.00	2,884,500	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	15,100	1,321.00	19,947,100	貸付有価証券 10,600株(6,000株)
5727	東邦チタニウム	25,900	827.00	21,419,300	貸付有価証券 18,000株(10,200株)
5741	U A C J	22,000	2,294.00	50,468,000	
5757	C K サンエツ	3,000	3,235.00	9,705,000	
5801	古河電気工業	45,000	2,632.00	118,440,000	貸付有価証券 17,800株(17,800株)
5802	住友電気工業	541,900	1,475.50	799,573,450	
5803	フジクラ	175,000	429.00	75,075,000	
5805	昭和電線ホールディングス	16,800	1,323.00	22,226,400	
5807	東京特殊電線	2,200	2,550.00	5,610,000	
5809	タツタ電線	28,700	588.00	16,875,600	
5819	カナレ電気	2,400	1,843.00	4,423,200	
5821	平河ヒューテック	5,400	1,423.00	7,684,200	貸付有価証券 1,600株
5851	リョービ	17,800	1,769.00	31,488,200	貸付有価証券 7,100株(7,100株)
5852	アーレスティ	19,000	527.00	10,013,000	
5857	アサヒホールディングス	25,400	2,615.00	66,421,000	
3421	稲葉製作所	8,200	1,387.00	11,373,400	
3431	宮地エンジニアリンググループ	4,400	2,059.00	9,059,600	
3433	トーカロ	40,300	1,181.00	47,594,300	貸付有価証券 12,100株
3434	アルファC o	5,100	1,298.00	6,619,800	
3436	S U M C O	173,500	1,728.00	299,808,000	貸付有価証券 68,900株(16,500株)
3443	川田テクノロジーズ	3,000	6,490.00	19,470,000	
3445	R S Technologies	4,100	2,879.00	11,803,900	貸付有価証券 1,300株
3447	信和	6,200	1,072.00	6,646,400	
5901	東洋製罐グループホールディングス	92,300	1,908.00	176,108,400	貸付有価証券 27,900株
5902	ホッカンホールディングス	8,000	1,911.00	15,288,000	
5909	コロナ	8,000	1,025.00	8,200,000	貸付有価証券 1,100株
5911	横河ブリッジホールディングス	27,000	2,240.00	60,480,000	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	2,711.00	3,524,300	
5929	三和ホールディングス	139,000	1,196.00	166,244,000	
5930	文化シャッター	42,700	875.00	37,362,500	貸付有価証券 12,900株
5932	三協立山	18,700	1,500.00	28,050,000	

5933	アルインコ	10,500	1,184.00	12,432,000	貸付有価証券 3,200株
5936	東洋シャッター	3,500	666.00	2,331,000	
5938	L I X I Lグループ	213,900	1,855.00	396,784,500	貸付有価証券 85,000株(20,400株)
5942	日本ファイルコン	11,100	539.00	5,982,900	貸付有価証券 3,300株
5943	ノーリツ	30,100	1,388.00	41,778,800	
5946	長府製作所	14,700	2,363.00	34,736,100	貸付有価証券 9,900株(5,400株)
5947	リンナイ	28,200	7,830.00	220,806,000	
5951	ダイニチ工業	7,800	698.00	5,444,400	
5957	日東精工	20,000	593.00	11,860,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
5958	三洋工業	1,900	1,937.00	3,680,300	
5959	岡部	29,400	882.00	25,930,800	
5970	ジーテクト	18,000	1,588.00	28,584,000	貸付有価証券 7,000株(1,700株)
5975	東プレ	27,000	1,709.00	46,143,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
5976	高周波熱錬	27,900	896.00	24,998,400	貸付有価証券 5,300株
5981	東京製綱	10,400	1,122.00	11,668,800	
5985	サンコール	8,100	538.00	4,357,800	
5986	モリテック スチール	11,300	365.00	4,124,500	貸付有価証券 4,500株(1,100株)
5988	パイオラックス	21,400	1,977.00	42,307,800	貸付有価証券 12,000株(8,500株)
5989	エイチワン	14,200	715.00	10,153,000	貸付有価証券 1,500株
5991	日本発條	155,500	890.00	138,395,000	貸付有価証券 46,800株
5992	中央発條	1,700	2,992.00	5,086,400	
5998	アドバネクス	2,100	1,703.00	3,576,300	貸付有価証券 800株(200株)
7989	立川ブラインド工業	6,400	1,290.00	8,256,000	貸付有価証券 1,900株
8155	三益半導体工業	11,300	2,440.00	27,572,000	貸付有価証券 3,900株
1909	日本ドライケミカル	3,600	1,745.00	6,282,000	
5631	日本製鋼所	44,000	2,015.00	88,660,000	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
6005	三浦工業	62,700	4,220.00	264,594,000	貸付有価証券 32,400株(19,900株)
6013	タクマ	49,100	1,227.00	60,245,700	貸付有価証券 14,900株
6101	ツガミ	30,000	1,044.00	31,320,000	貸付有価証券 21,000株(11,900株)
6103	オークマ	16,900	5,160.00	87,204,000	貸付有価証券 5,100株

6104	東芝機械	16,400	3,390.00	55,596,000	貸付有価証券 6,500株(1,600株)
6113	アマダホールディングス	184,300	1,172.00	215,999,600	
6118	アイダエンジニアリング	37,900	900.00	34,110,000	貸付有価証券 9,500株
6121	滝澤鉄工所	4,500	1,343.00	6,043,500	
6134	F U J I	62,300	1,810.00	112,763,000	
6135	牧野フライス製作所	17,000	4,170.00	70,890,000	貸付有価証券 5,200株
6136	オーエスジー	67,000	1,866.00	125,022,000	貸付有価証券 20,200株
6138	ダイジェット工業	1,600	1,399.00	2,238,400	
6140	旭ダイヤモンド工業	38,000	603.00	22,914,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
6141	D M G 森精機	91,700	1,592.00	145,986,400	貸付有価証券 36,400株(8,700株)
6143	ソディック	34,100	868.00	29,598,800	
6146	ディスコ	19,600	26,010.00	509,796,000	貸付有価証券 6,000株
6151	日東工器	7,900	2,478.00	19,576,200	
6157	日進工具	4,300	2,795.00	12,018,500	貸付有価証券 1,700株(400株)
6165	パンチ工業	13,100	483.00	6,327,300	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6167	富士ダイス	6,400	726.00	4,646,400	貸付有価証券 2,500株(600株)
6203	豊和工業	8,000	815.00	6,520,000	貸付有価証券 2,400株
6205	O K K	5,900	620.00	3,658,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
6208	石川製作所	3,500	1,617.00	5,659,500	貸付有価証券 2,300株(1,300株)
6210	東洋機械金属	10,400	517.00	5,376,800	
6217	津田駒工業	2,800	1,136.00	3,180,800	貸付有価証券 1,100株(300株)
6218	エンシュウ	3,500	1,254.00	4,389,000	貸付有価証券 500株
6222	島精機製作所	23,300	2,138.00	49,815,400	貸付有価証券 16,200株(9,200株)
6235	オプトラン	16,100	2,925.00	47,092,500	
6236	N C ホールディングス	4,400	662.00	2,912,800	貸付有価証券 100株(100株)
6237	イワキポンプ	6,900	1,192.00	8,224,800	貸付有価証券 2,100株
6238	フリュー	14,200	1,204.00	17,096,800	
6240	ヤマシンフィルタ	31,500	755.00	23,782,500	貸付有価証券 9,400株
6247	日阪製作所	17,900	930.00	16,647,000	貸付有価証券 6,400株(1,600株)
6250	やまびこ	28,100	1,093.00	30,713,300	

6258	平田機工	6,900	6,570.00	45,333,000	貸付有価証券 2,100株
6262	ペガサスミシン製造	14,700	476.00	6,997,200	
6264	マルマエ	5,900	1,038.00	6,124,200	貸付有価証券 1,800株
6266	タツモ	6,800	1,226.00	8,336,800	貸付有価証券 2,600株(600株)
6268	ナブテスコ	85,400	3,140.00	268,156,000	貸付有価証券 33,900株(8,100株)
6269	三井海洋開発	15,400	2,532.00	38,992,800	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
6272	レオン自動機	14,200	1,451.00	20,604,200	貸付有価証券 10,000株(5,700株)
6273	S M C	46,000	48,990.00	2,253,540,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
6274	ヤマハモーターロボティクスホールディング	12,600	514.00	6,476,400	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
6277	ホソカワミクロン	5,100	4,985.00	25,423,500	
6278	ユニオンツール	5,400	3,020.00	16,308,000	
6282	オイレス工業	18,700	1,544.00	28,872,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
6284	日精エー・エス・ビー機械	4,900	3,850.00	18,865,000	
6287	サトーホールディングス	20,700	3,105.00	64,273,500	貸付有価証券 14,300株(8,100株)
6289	技研製作所	12,700	4,920.00	62,484,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6291	日本エアーテック	4,600	900.00	4,140,000	貸付有価証券 3,000株(1,700株)
6292	カワタ	4,300	988.00	4,248,400	貸付有価証券 400株(400株)
6293	日精樹脂工業	12,200	955.00	11,651,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6294	オカダアイヨン	4,600	1,234.00	5,676,400	貸付有価証券 400株(400株)
6298	ワイエイシイホールディングス	6,200	645.00	3,999,000	
6301	小松製作所	663,900	2,413.00	1,601,990,700	貸付有価証券 263,800株(63,300株)
6302	住友重機械工業	83,900	2,863.00	240,205,700	
6305	日立建機	58,700	2,997.00	175,923,900	貸付有価証券 17,800株
6306	日工	20,000	804.00	16,080,000	
6309	巴工業	6,200	2,207.00	13,683,400	貸付有価証券 1,900株
6310	井関農機	14,600	1,503.00	21,943,800	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
6315	T O W A	14,800	1,010.00	14,948,000	
6316	丸山製作所	3,200	1,549.00	4,956,800	貸付有価証券 1,000株
6317	北川鉄工所	6,600	2,177.00	14,368,200	貸付有価証券 1,800株

6323	ローツェ	6,400	4,160.00	26,624,000	貸付有価証券 2,500株(600株)
6325	タカキタ	5,100	562.00	2,866,200	貸付有価証券 2,100株(500株)
6326	クボタ	777,600	1,776.00	1,381,017,600	貸付有価証券 309,200株(74,200株)
6328	荏原実業	3,700	2,124.00	7,858,800	
6331	三菱化工機	5,000	2,061.00	10,305,000	
6332	月島機械	27,000	1,456.00	39,312,000	貸付有価証券 10,800株(2,600株)
6333	帝国電機製作所	12,100	1,388.00	16,794,800	
6335	東京機械製作所	6,000	359.00	2,154,000	貸付有価証券 1,800株
6339	新東工業	34,800	938.00	32,642,400	貸付有価証券 13,800株(3,300株)
6340	澁谷工業	12,800	3,055.00	39,104,000	貸付有価証券 5,000株(1,200株)
6345	アイチ コーポレーション	25,300	721.00	18,241,300	貸付有価証券 7,600株
6349	小森コーポレーション	37,100	989.00	36,691,900	貸付有価証券 14,700株(3,500株)
6351	鶴見製作所	11,400	1,842.00	20,998,800	貸付有価証券 3,400株
6355	住友精密工業	2,200	3,110.00	6,842,000	
6356	日本ギア工業	4,400	398.00	1,751,200	
6358	酒井重工業	2,700	2,699.00	7,287,300	
6361	荏原製作所	60,600	3,370.00	204,222,000	
6362	石井鐵工所	1,900	2,743.00	5,211,700	
6363	西島製作所	14,800	886.00	13,112,800	
6364	北越工業	15,100	1,312.00	19,811,200	貸付有価証券 1,800株
6367	ダイキン工業	186,700	15,780.00	2,946,126,000	貸付有価証券 31,600株
6368	オルガノ	5,300	7,160.00	37,948,000	
6369	トーヨーカネツ	6,400	2,197.00	14,060,800	
6370	栗田工業	79,300	3,335.00	264,465,500	貸付有価証券 23,900株
6371	椿本チエイン	20,900	3,370.00	70,433,000	
6373	大同工業	7,000	818.00	5,726,000	貸付有価証券 1,700株
6378	木村化工機	12,200	613.00	7,478,600	貸付有価証券 8,400株(4,800株)
6381	アネスト岩田	22,800	1,023.00	23,324,400	貸付有価証券 9,100株(2,200株)
6383	ダイフク	74,900	6,710.00	502,579,000	貸付有価証券 29,900株(7,200株)
6387	サムコ	4,000	2,014.00	8,056,000	貸付有価証券 1,600株(400株)

6390	加藤製作所	8,000	1,627.00	13,016,000	貸付有価証券 3,200株（3,200株）
6393	油研工業	2,500	1,720.00	4,300,000	
6395	タダノ	70,700	1,032.00	72,962,400	貸付有価証券 49,300株（28,000株）
6406	フジテック	53,300	1,792.00	95,513,600	貸付有価証券 16,100株
6407	C K D	40,800	1,850.00	75,480,000	貸付有価証券 16,200株（16,200株）
6409	キトー	11,100	1,681.00	18,659,100	貸付有価証券 4,400株（4,400株）
6412	平和	40,900	2,253.00	92,147,700	
6413	理想科学工業	12,900	1,839.00	23,723,100	貸付有価証券 2,500株（1,200株）
6417	S A N K Y O	32,600	3,735.00	121,761,000	
6418	日本金銭機械	16,200	838.00	13,575,600	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	9,300	1,954.00	18,172,200	
6420	フクシマガリレイ	9,000	4,045.00	36,405,000	貸付有価証券 6,200株（3,500株）
6428	オーイズミ	6,100	557.00	3,397,700	
6430	ダイコク電機	6,700	1,565.00	10,485,500	
6432	竹内製作所	24,500	1,916.00	46,942,000	貸付有価証券 7,400株
6436	アマノ	38,400	3,060.00	117,504,000	
6440	J U K I	20,400	776.00	15,830,400	
6444	サンデンホールディングス	19,200	676.00	12,979,200	
6445	蛇の目ミシン工業	13,300	409.00	5,439,700	
6454	マックス	22,400	2,042.00	45,740,800	貸付有価証券 8,900株（2,100株）
6457	グローリー	37,600	3,215.00	120,884,000	
6458	新晃工業	13,600	1,727.00	23,487,200	
6459	大和冷機工業	21,200	1,154.00	24,464,800	
6460	セガサミーホールディングス	145,400	1,530.00	222,462,000	
6461	日本ピストンリング	5,300	1,428.00	7,568,400	貸付有価証券 500株（500株）
6462	リケン	6,800	3,610.00	24,548,000	貸付有価証券 2,600株（600株）
6463	T P R	19,700	1,815.00	35,755,500	
6464	ツバキ・ナカシマ	29,900	1,320.00	39,468,000	
6465	ホシザキ	42,800	10,330.00	442,124,000	
6470	大豊工業	11,900	725.00	8,627,500	
6471	日本精工	276,000	939.00	259,164,000	貸付有価証券 21,700株
6472	N T N	339,200	293.00	99,385,600	貸付有価証券 32,200株（32,200株）
6473	ジェイテクト	140,600	1,181.00	166,048,600	

6474	不二越	13,600	4,170.00	56,712,000	貸付有価証券 6,600株(5,400株)
6480	日本トムソン	43,500	462.00	20,097,000	貸付有価証券 12,900株
6481	T H K	85,300	2,840.00	242,252,000	貸付有価証券 33,900株(8,100株)
6482	ユーシン精機	11,400	920.00	10,488,000	貸付有価証券 1,800株(1,100株)
6485	前澤給装工業	5,300	2,295.00	12,163,500	
6486	イーグル工業	18,100	974.00	17,629,400	
6489	前澤工業	9,800	386.00	3,782,800	貸付有価証券 3,000株
6490	日本ビラー工業	14,800	1,473.00	21,800,400	
6498	キッツ	59,400	761.00	45,203,400	貸付有価証券 18,000株
6586	マキタ	191,100	4,175.00	797,842,500	貸付有価証券 75,800株(18,200株)
7004	日立造船	116,200	421.00	48,920,200	
7011	三菱重工業	245,600	4,038.00	991,732,800	貸付有価証券 171,800株(97,600株)
7013	I H I	105,600	2,647.00	279,523,200	貸付有価証券 32,000株
7718	スター精密	22,600	1,415.00	31,979,000	
3105	日清紡ホールディングス	97,700	989.00	96,625,300	
4062	イビデン	89,700	2,580.00	231,426,000	貸付有価証券 27,100株
4902	コニカミノルタ	320,200	679.00	217,415,800	貸付有価証券 96,700株
6448	ブラザー工業	179,000	2,256.00	403,824,000	
6479	ミネベアミツミ	272,100	2,276.00	619,299,600	貸付有価証券 65,900株
6501	日立製作所	704,300	4,105.00	2,891,151,500	
6503	三菱電機	1,465,700	1,598.00	2,342,188,600	
6504	富士電機	88,300	3,470.00	306,401,000	貸付有価証券 26,800株
6505	東洋電機製造	5,300	1,483.00	7,859,900	貸付有価証券 3,800株(2,100株)
6506	安川電機	157,800	3,890.00	613,842,000	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	19,000	1,248.00	23,712,000	
6508	明電舎	26,900	2,022.00	54,391,800	貸付有価証券 8,200株
6513	オリジン	4,000	1,546.00	6,184,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
6516	山洋電気	7,100	5,410.00	38,411,000	
6517	デンヨー	12,500	2,097.00	26,212,500	
6588	東芝テック	18,400	4,440.00	81,696,000	
6590	芝浦メカトロニクス	2,600	3,730.00	9,698,000	

6592	マブチモーター	40,600	3,975.00	161,385,000	
6594	日本電産	176,400	14,175.00	2,500,470,000	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	8,800	423.00	3,722,400	貸付有価証券 800株(800株)
6616	トレックス・セミコンダクター	8,400	1,494.00	12,549,600	貸付有価証券 2,200株
6617	東光高岳	8,100	1,189.00	9,630,900	貸付有価証券 1,700株
6619	ダブル・スコープ	23,200	798.00	18,513,600	貸付有価証券 7,900株(7,900株)
6620	宮越ホールディングス	5,500	900.00	4,950,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
6622	ダイヘン	16,000	3,535.00	56,560,000	
6630	ヤーマン	23,900	692.00	16,538,800	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	119,400	249.00	29,730,600	貸付有価証券 35,900株
6638	ミマキエンジニアリング	13,100	513.00	6,720,300	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6640	第一精工	6,000	2,440.00	14,640,000	貸付有価証券 1,600株
6641	日新電機	34,300	1,185.00	40,645,500	貸付有価証券 24,000株(13,600株)
6644	大崎電気工業	29,100	615.00	17,896,500	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
6645	オムロン	131,400	6,650.00	873,810,000	貸付有価証券 41,500株
6651	日東工業	21,500	2,314.00	49,751,000	
6652	I D E C	21,200	1,964.00	41,636,800	貸付有価証券 7,200株(900株)
6653	正興電機製作所	3,400	1,068.00	3,631,200	
6654	不二電機工業	1,800	1,249.00	2,248,200	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,900	2,221.00	108,606,900	
6675	サクサホールディングス	3,400	2,000.00	6,800,000	
6676	メルコホールディングス	5,100	2,704.00	13,790,400	
6678	テクノメディカ	3,300	2,042.00	6,738,600	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	2,400	997.00	2,392,800	貸付有価証券 700株
6701	日本電気	177,800	5,040.00	896,112,000	貸付有価証券 53,900株
6702	富士通	141,300	12,705.00	1,795,216,500	
6703	沖電気工業	59,500	1,380.00	82,110,000	
6704	岩崎通信機	6,400	826.00	5,286,400	
6706	電気興業	7,100	3,725.00	26,447,500	
6707	サンケン電気	16,000	2,805.00	44,880,000	
6715	ナカヨ	2,800	1,665.00	4,662,000	
6718	アイホン	8,300	1,736.00	14,408,800	

6723	ルネサスエレクトロニクス	700,500	721.00	505,060,500	貸付有価証券 227,300株(16,400株)
6724	セイコーエプソン	181,900	1,708.00	310,685,200	貸付有価証券 72,300株(72,300株)
6727	ワコム	98,500	391.00	38,513,500	貸付有価証券 39,300株(39,300株)
6728	アルバック	27,000	4,190.00	113,130,000	
6730	アクセル	6,100	824.00	5,026,400	貸付有価証券 1,800株
6737	E I Z O	11,400	3,890.00	44,346,000	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
6740	ジャパンディスプレイ	423,600	76.00	32,193,600	貸付有価証券 284,700株(157,900株)
6741	日本信号	37,300	1,411.00	52,630,300	貸付有価証券 14,800株(14,800株)
6742	京三製作所	34,300	567.00	19,448,100	貸付有価証券 13,600株(13,600株)
6744	能美防災	19,400	2,576.00	49,974,400	
6745	ホーチキ	10,600	1,484.00	15,730,400	
6748	星和電機	7,200	564.00	4,060,800	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	16,100	4,470.00	71,967,000	
6752	パナソニック	1,674,700	1,235.00	2,068,254,500	貸付有価証券 159,700株(159,700株)
6753	シャープ	169,600	1,559.00	264,406,400	貸付有価証券 67,000株(16,100株)
6754	アンリツ	94,400	2,174.00	205,225,600	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
6755	富士通ゼネラル	39,800	2,478.00	98,624,400	貸付有価証券 12,100株
6758	ソニー	926,900	7,659.00	7,099,127,100	貸付有価証券 271,700株(88,600株)
6762	T D K	70,800	11,820.00	836,856,000	貸付有価証券 21,500株
6763	帝国通信工業	6,500	1,234.00	8,021,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
6768	タムラ製作所	49,000	660.00	32,340,000	貸付有価証券 19,600株(4,700株)
6770	アルプスアルパイン	129,700	1,915.00	248,375,500	
6771	池上通信機	4,600	1,182.00	5,437,200	貸付有価証券 3,200株(1,800株)
6779	日本電波工業	13,200	491.00	6,481,200	
6785	鈴木	7,200	765.00	5,508,000	貸付有価証券 700株(700株)
6788	日本トリム	2,000	4,405.00	8,810,000	
6789	ローランド ディー . ジー .	8,100	1,981.00	16,046,100	
6794	フォスター電機	15,400	1,634.00	25,163,600	

6798	S M K	3,800	3,080.00	11,704,000	貸付有価証券 1,200株(800株)
6800	ヨコオ	9,500	2,991.00	28,414,500	貸付有価証券 2,900株
6803	ティアック	10,500	200.00	2,100,000	貸付有価証券 700株
6804	ホシデン	40,100	1,224.00	49,082,400	貸付有価証券 12,100株
6806	ヒロセ電機	22,700	14,010.00	318,027,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6807	日本航空電子工業	33,600	1,984.00	66,662,400	
6809	T O A	15,700	1,044.00	16,390,800	
6810	マクセルホールディングス	31,600	1,459.00	46,104,400	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
6814	古野電気	18,900	1,080.00	20,412,000	貸付有価証券 5,700株
6815	ユニデンホールディングス	4,000	2,035.00	8,140,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
6817	スミダコーポレーション	11,200	1,076.00	12,051,200	
6820	アイコム	8,100	2,571.00	20,825,100	
6823	リオン	6,200	3,045.00	18,879,000	
6826	本多通信工業	12,500	535.00	6,687,500	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6839	船井電機	14,800	695.00	10,286,000	
6841	横河電機	134,500	1,985.00	266,982,500	貸付有価証券 9,500株
6844	新電元工業	5,200	3,485.00	18,122,000	
6845	アズビル	92,500	3,020.00	279,350,000	
6848	東亜ディーケーケー	7,200	985.00	7,092,000	貸付有価証券 2,900株(700株)
6849	日本光電工業	60,600	3,350.00	203,010,000	
6850	チノー	5,100	1,396.00	7,119,600	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
6853	共和電業	15,300	426.00	6,517,800	
6855	日本電子材料	5,800	944.00	5,475,200	貸付有価証券 1,700株
6856	堀場製作所	29,000	7,040.00	204,160,000	貸付有価証券 2,800株(2,300株)
6857	アドバンテスト	109,000	5,730.00	624,570,000	貸付有価証券 32,800株
6858	小野測器	6,100	577.00	3,519,700	
6859	エスベック	13,000	2,210.00	28,730,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6861	キーエンス	132,800	37,710.00	5,007,888,000	貸付有価証券 53,000株(12,800株)
6866	日置電機	7,700	3,990.00	30,723,000	貸付有価証券 2,700株(700株)
6869	シスメックス	104,700	8,039.00	841,683,300	
6871	日本マイクロニクス	25,500	1,303.00	33,226,500	

6875	メガチップス	13,600	1,771.00	24,085,600	
6877	O B A R A G R O U P	7,600	3,545.00	26,942,000	貸付有価証券 1,100株
6901	澤藤電機	1,800	2,184.00	3,931,200	貸付有価証券 200株(200株)
6904	原田工業	6,900	985.00	6,796,500	貸付有価証券 2,800株(700株)
6905	コーセル	19,500	1,144.00	22,308,000	貸付有価証券 12,500株(7,100株)
6908	イリソ電子工業	12,300	4,065.00	49,999,500	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
6914	オプテックスグループ	24,000	1,483.00	35,592,000	貸付有価証券 16,800株(9,500株)
6915	千代田インテグレ	6,800	2,046.00	13,912,800	
6916	アイ・オー・データ機器	4,700	1,031.00	4,845,700	
6920	レーザーテック	64,400	5,180.00	333,592,000	貸付有価証券 18,000株
6923	スタンレー電気	103,100	2,932.00	302,289,200	
6924	岩崎電気	5,700	1,631.00	9,296,700	
6925	ウシオ電機	85,100	1,551.00	131,990,100	貸付有価証券 8,100株(8,100株)
6926	岡谷電機産業	11,500	370.00	4,255,000	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	13,500	434.00	5,859,000	貸付有価証券 9,400株(5,300株)
6928	エノモト	4,400	1,339.00	5,891,600	
6929	日本セラミック	14,900	2,467.00	36,758,300	
6932	遠藤照明	7,400	699.00	5,172,600	
6937	古河電池	10,400	758.00	7,883,200	貸付有価証券 4,200株(1,000株)
6938	双信電機	7,100	434.00	3,081,400	貸付有価証券 5,000株(2,800株)
6941	山一電機	10,600	1,916.00	20,309,600	貸付有価証券 3,200株
6947	図研	9,500	2,600.00	24,700,000	貸付有価証券 2,900株
6951	日本電子	28,900	3,690.00	106,641,000	貸付有価証券 11,500株(11,500株)
6952	カシオ計算機	129,700	2,021.00	262,123,700	
6954	ファナック	139,300	20,355.00	2,835,451,500	貸付有価証券 42,100株
6958	日本シイエムケイ	34,400	536.00	18,438,400	
6961	エンプラス	7,500	3,000.00	22,500,000	
6962	大真空	5,400	1,732.00	9,352,800	
6963	ローム	65,100	8,420.00	548,142,000	
6965	浜松ホトニクス	105,100	4,715.00	495,546,500	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
6966	三井ハイテック	16,200	1,705.00	27,621,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)

6967	新光電気工業	49,200	1,318.00	64,845,600	貸付有価証券 8,200株
6971	京セラ	206,200	7,199.00	1,484,433,800	貸付有価証券 62,500株
6976	太陽誘電	65,200	3,375.00	220,050,000	
6981	村田製作所	430,600	6,446.00	2,775,647,600	貸付有価証券 130,500株
6986	双葉電子工業	23,200	1,343.00	31,157,600	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
6989	北陸電気工業	5,900	1,227.00	7,239,300	貸付有価証券 4,100株(2,300株)
6996	ニチコン	49,700	1,001.00	49,749,700	
6997	日本ケミコン	11,100	1,729.00	19,191,900	貸付有価証券 3,300株
6999	K O A	22,100	1,228.00	27,138,800	貸付有価証券 6,700株
7244	市光工業	21,900	703.00	15,395,700	貸付有価証券 6,600株
7276	小糸製作所	87,800	4,905.00	430,659,000	貸付有価証券 26,500株
7280	ミツバ	27,000	641.00	17,307,000	貸付有価証券 18,900株(10,700株)
7735	S C R E E Nホールディングス	25,400	6,410.00	162,814,000	貸付有価証券 17,600株(10,000株)
7739	キヤノン電子	15,400	2,034.00	31,323,600	
7751	キヤノン	789,000	2,875.50	2,268,769,500	貸付有価証券 313,500株(313,500株)
7752	リコー	372,900	1,231.00	459,039,900	貸付有価証券 151,400株(37,800株)
7965	象印マホービン	42,900	2,224.00	95,409,600	貸付有価証券 17,100株(4,100株)
7999	M U T O Hホールディングス	2,000	1,739.00	3,478,000	
8035	東京エレクトロン	97,700	24,590.00	2,402,443,000	貸付有価証券 29,500株
3116	トヨタ紡織	42,700	1,650.00	70,455,000	貸付有価証券 13,000株
3526	芦森工業	3,000	1,364.00	4,092,000	貸付有価証券 2,100株(1,200株)
5949	ユニプレス	28,400	1,413.00	40,129,200	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
6201	豊田自動織機	118,600	6,080.00	721,088,000	貸付有価証券 47,100株(11,300株)
6455	モリタホールディングス	25,600	1,749.00	44,774,400	貸付有価証券 18,000株(10,200株)
6584	三櫻工業	18,600	1,050.00	19,530,000	貸付有価証券 13,000株(7,400株)
6902	デンソー	322,700	4,500.00	1,452,150,000	
6995	東海理化電機製作所	38,600	1,881.00	72,606,600	貸付有価証券 11,700株

7003	三井E & Sホールディングス	52,900	934.00	49,408,600	
7012	川崎重工業	114,000	2,166.00	246,924,000	貸付有価証券 35,800株(10,900株)
7014	名村造船所	47,200	239.00	11,280,800	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	17,800	179.00	3,186,200	
7102	日本車輛製造	5,300	3,005.00	15,926,500	貸付有価証券 3,700株(2,100株)
7105	三菱ロジスネクスト	19,400	1,655.00	32,107,000	貸付有価証券 7,800株(1,900株)
7122	近畿車輛	2,200	1,682.00	3,700,400	貸付有価証券 1,600株(900株)
7201	日産自動車	1,728,600	592.60	1,024,368,360	
7202	いすゞ自動車	424,700	1,090.50	463,135,350	
7203	トヨタ自動車	1,635,500	7,715.00	12,617,882,500	
7205	日野自動車	183,000	1,017.00	186,111,000	
7211	三菱自動車工業	542,500	408.00	221,340,000	貸付有価証券 379,500株(215,600株)
7212	エフテック	10,200	758.00	7,731,600	
7213	レシップホールディングス	5,700	674.00	3,841,800	貸付有価証券 1,600株
7214	G M B	2,600	807.00	2,098,200	
7215	ファルテック	2,600	1,080.00	2,808,000	
7220	武蔵精密工業	32,600	1,325.00	43,195,000	貸付有価証券 12,500株(3,100株)
7222	日産車体	28,600	1,066.00	30,487,600	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
7224	新明和工業	39,500	1,346.00	53,167,000	
7226	極東開発工業	27,200	1,422.00	38,678,400	貸付有価証券 19,000株(10,800株)
7230	日信工業	24,900	2,239.00	55,751,100	
7231	トピー工業	12,100	1,807.00	21,864,700	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
7236	ティラド	5,300	1,818.00	9,635,400	貸付有価証券 500株(500株)
7238	曙ブレーキ工業	80,500	235.00	18,917,500	貸付有価証券 56,200株(31,900株)
7239	タチエス	24,100	1,325.00	31,932,500	貸付有価証券 16,800株(9,500株)
7240	N O K	78,800	1,569.00	123,637,200	貸付有価証券 9,200株
7241	フタバ産業	40,800	658.00	26,846,400	
7242	K Y B	16,400	3,015.00	49,446,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
7245	大同メタル工業	28,100	686.00	19,276,600	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
7246	プレス工業	72,600	365.00	26,499,000	
7247	ミクニ	18,600	332.00	6,175,200	

7250	太平洋工業	30,700	1,320.00	40,524,000	貸付有価証券 9,200株
7251	ケーヒン	28,100	2,580.00	72,498,000	貸付有価証券 10,200株
7256	河西工業	19,800	815.00	16,137,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
7259	アイシン精機	120,700	3,720.00	449,004,000	
7261	マツダ	431,300	941.00	405,853,300	貸付有価証券 171,900株(41,300株)
7266	今仙電機製作所	13,600	892.00	12,131,200	貸付有価証券 5,400株(1,300株)
7267	本田技研工業	1,154,100	2,849.00	3,288,030,900	
7269	スズキ	290,500	5,003.00	1,453,371,500	貸付有価証券 115,000株(27,600株)
7270	S U B A R U	455,000	2,688.00	1,223,040,000	
7271	安永	7,100	1,171.00	8,314,100	貸付有価証券 2,800株(700株)
7272	ヤマハ発動機	191,100	2,063.00	394,239,300	
7274	ショーワ	28,900	2,284.00	66,007,600	
7277	T B K	17,400	461.00	8,021,400	貸付有価証券 5,200株
7278	エクセディ	19,900	2,293.00	45,630,700	
7282	豊田合成	47,300	2,378.00	112,479,400	貸付有価証券 14,300株
7283	愛三工業	22,900	712.00	16,304,800	
7284	盟和産業	2,200	1,091.00	2,400,200	貸付有価証券 100株(100株)
7291	日本プラスト	11,500	674.00	7,751,000	貸付有価証券 2,700株
7294	ヨロズ	13,700	1,449.00	19,851,300	貸付有価証券 5,400株(5,400株)
7296	エフ・シー・シー	24,000	2,235.00	53,640,000	
7309	シマノ	54,900	17,300.00	949,770,000	貸付有価証券 21,800株(21,800株)
7313	テイ・エス テック	34,000	3,080.00	104,720,000	
7408	ジャムコ	7,300	1,418.00	10,351,400	貸付有価証券 700株(700株)
4543	テルモ	414,800	3,941.00	1,634,726,800	貸付有価証券 125,300株
5187	クリエートメディック	4,800	1,062.00	5,097,600	
6376	日機装	43,900	1,330.00	58,387,000	貸付有価証券 17,400株(17,400株)
7600	日本エム・ディ・エム	8,400	2,011.00	16,892,400	貸付有価証券 2,500株
7701	島津製作所	175,200	3,120.00	546,624,000	貸付有価証券 41,800株
7702	J M S	12,400	917.00	11,370,800	

7709	クボテック	3,800	418.00	1,588,400	貸付有価証券 1,100株
7715	長野計器	10,600	930.00	9,858,000	貸付有価証券 4,900株(1,700株)
7717	ブイ・テクノロジー	6,900	5,030.00	34,707,000	貸付有価証券 4,800株(2,700株)
7721	東京計器	9,300	1,010.00	9,393,000	
7723	愛知時計電機	1,900	4,260.00	8,094,000	
7725	インターアクション	7,900	2,648.00	20,919,200	
7727	オーバル	13,100	246.00	3,222,600	貸付有価証券 4,000株
7729	東京精密	26,600	3,985.00	106,001,000	貸付有価証券 10,500株(2,500株)
7730	マニー	58,400	2,791.00	162,994,400	貸付有価証券 6,800株(5,600株)
7731	ニコン	237,200	1,332.00	315,950,400	貸付有価証券 94,600株(22,700株)
7732	トプコン	73,800	1,245.00	91,881,000	貸付有価証券 29,500株(7,100株)
7733	オリンパス	811,000	1,830.00	1,484,130,000	貸付有価証券 245,800株
7734	理研計器	12,900	2,248.00	28,999,200	貸付有価証券 3,900株
7740	タムロン	11,800	2,376.00	28,036,800	
7741	HOYA	292,700	10,120.00	2,962,124,000	
7743	シード	6,200	1,024.00	6,348,800	
7744	ノーリツ鋼機	9,900	1,552.00	15,364,800	貸付有価証券 3,000株
7745	エー・アンド・デイ	13,400	932.00	12,488,800	
7747	朝日インテック	124,400	3,005.00	373,822,000	貸付有価証券 11,900株(11,900株)
7762	シチズン時計	171,700	535.00	91,859,500	貸付有価証券 67,900株(16,300株)
7769	リズム時計工業	4,600	912.00	4,195,200	
7775	大研医器	10,100	690.00	6,969,000	
7780	メニコン	20,100	5,270.00	105,927,000	貸付有価証券 8,000株(1,900株)
7782	シンシア	1,600	688.00	1,100,800	貸付有価証券 100株(100株)
7979	松風	6,600	1,846.00	12,183,600	
8050	セイコーホールディングス	20,700	2,679.00	55,455,300	貸付有価証券 8,300株(8,300株)
8086	ニプロ	101,400	1,258.00	127,561,200	
7811	中本パックス	3,700	1,649.00	6,101,300	
7816	スノーピーク	7,200	1,032.00	7,430,400	
7817	パラマウントベッドホールディングス	15,500	4,595.00	71,222,500	貸付有価証券 4,700株
7818	トランザクション	9,400	1,155.00	10,857,000	
7819	粧美堂	4,300	395.00	1,698,500	

7820	ニホンフラッシュ	6,800	2,671.00	18,162,800	貸付有価証券 600株(600株)
7821	前田工織	16,100	2,243.00	36,112,300	貸付有価証券 6,400株(1,500株)
7822	永大産業	19,200	340.00	6,528,000	
7823	アートネイチャー	15,700	828.00	12,999,600	
7832	バンダイナムコホールディングス	151,500	6,584.00	997,476,000	貸付有価証券 44,200株
7833	アイフィスジャパン	3,700	711.00	2,630,700	貸付有価証券 1,500株(400株)
7838	共立印刷	24,400	167.00	4,074,800	
7839	SHOEI	7,100	5,410.00	38,411,000	貸付有価証券 2,800株(700株)
7840	フランスベッドホールディングス	20,700	934.00	19,333,800	
7846	パイロットコーポレーション	23,900	4,465.00	106,713,500	
7856	萩原工業	8,100	1,627.00	13,178,700	
7862	トッパン・フォームズ	31,400	1,196.00	37,554,400	貸付有価証券 9,500株
7864	フジシールインターナショナル	32,900	2,364.00	77,775,600	
7867	タカラトミー	65,700	1,185.00	77,854,500	
7868	廣済堂	10,200	1,046.00	10,669,200	貸付有価証券 3,100株
7872	エステールホールディングス	3,900	697.00	2,718,300	
7873	アーク	55,900	92.00	5,142,800	貸付有価証券 16,900株
7885	タカノ	5,700	803.00	4,577,100	
7893	プロネクサス	12,600	1,180.00	14,868,000	貸付有価証券 5,000株(1,200株)
7897	ホクシン	9,000	157.00	1,413,000	貸付有価証券 2,700株
7898	ウッドワン	4,900	1,145.00	5,610,500	
7905	大建工業	9,900	1,894.00	18,750,600	
7911	凸版印刷	206,900	2,218.00	458,904,200	
7912	大日本印刷	191,800	3,090.00	592,662,000	
7914	共同印刷	4,500	2,988.00	13,446,000	
7915	NISSHA	30,100	1,030.00	31,003,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
7916	光村印刷	1,300	1,747.00	2,271,100	
7921	TAKARA & COMPANY	7,100	1,726.00	12,254,600	
7936	アシックス	121,000	1,606.00	194,326,000	貸付有価証券 48,000株(48,000株)
7937	ツツミ	4,600	2,155.00	9,913,000	貸付有価証券 200株
7949	小松ウオール工業	4,500	2,138.00	9,621,000	
7951	ヤマハ	87,200	5,730.00	499,656,000	
7952	河合楽器製作所	4,500	3,715.00	16,717,500	
7955	クリナップ	13,600	706.00	9,601,600	貸付有価証券 4,100株

7956	ビジョン	88,600	3,920.00	347,312,000	貸付有価証券 35,200株(8,400株)
7959	オリバー	3,100	3,365.00	10,431,500	
7961	兼松サステック	900	1,840.00	1,656,000	
7962	キングジム	12,200	874.00	10,662,800	貸付有価証券 3,600株
7966	リンテック	34,900	2,445.00	85,330,500	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
7972	イトーキ	31,200	481.00	15,007,200	
7974	任天堂	89,900	40,430.00	3,634,657,000	貸付有価証券 35,600株(8,500株)
7976	三菱鉛筆	24,100	1,657.00	39,933,700	
7981	タカラスタンダード	30,300	1,833.00	55,539,900	貸付有価証券 21,100株(12,000株)
7984	コクヨ	70,300	1,652.00	116,135,600	貸付有価証券 6,700株(6,700株)
7987	ナカバヤシ	14,400	623.00	8,971,200	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
7990	グローブライド	6,600	2,374.00	15,668,400	
7994	オカムラ	51,100	1,069.00	54,625,900	貸付有価証券 20,300株(4,900株)
8022	美津濃	13,300	2,724.00	36,229,200	
9501	東京電力ホールディングス	1,170,100	452.00	528,885,200	貸付有価証券 353,400株
9502	中部電力	448,400	1,557.00	698,158,800	貸付有価証券 42,800株(42,800株)
9503	関西電力	555,300	1,289.00	715,781,700	貸付有価証券 53,200株(53,200株)
9504	中国電力	202,600	1,498.00	303,494,800	
9505	北陸電力	134,000	892.00	119,528,000	貸付有価証券 53,400株(53,400株)
9506	東北電力	366,200	1,044.00	382,312,800	貸付有価証券 110,300株
9507	四国電力	132,000	942.00	124,344,000	貸付有価証券 46,000株(12,600株)
9508	九州電力	302,100	921.00	278,234,100	貸付有価証券 120,000株(28,800株)
9509	北海道電力	137,200	511.00	70,109,200	貸付有価証券 41,400株
9511	沖縄電力	27,100	2,086.00	56,530,600	貸付有価証券 10,800株(2,600株)
9513	電源開発	116,600	2,502.00	291,733,200	
9514	エフオン	7,900	767.00	6,059,300	貸付有価証券 700株(700株)
9517	イーレックス	20,900	1,674.00	34,986,600	
9519	レノバ	24,300	1,355.00	32,926,500	
9531	東京瓦斯	281,900	2,414.50	680,647,550	貸付有価証券 197,200株(112,000株)

9532	大阪瓦斯	284,400	1,870.00	531,828,000	
9533	東邦瓦斯	72,100	4,235.00	305,343,500	貸付有価証券 28,800株(6,900株)
9534	北海道瓦斯	7,900	1,661.00	13,121,900	
9535	広島ガス	30,200	358.00	10,811,600	貸付有価証券 7,500株
9536	西部瓦斯	16,500	2,396.00	39,534,000	貸付有価証券 6,600株(1,600株)
9543	静岡ガス	41,600	936.00	38,937,600	貸付有価証券 7,200株(4,000株)
9551	メタウォーター	7,100	4,225.00	29,997,500	
2384	SBSホールディングス	12,700	1,883.00	23,914,100	貸付有価証券 2,600株
9001	東武鉄道	154,600	3,735.00	577,431,000	
9003	相鉄ホールディングス	46,900	2,903.00	136,150,700	貸付有価証券 18,700株(4,500株)
9005	東急	369,700	1,953.00	722,024,100	
9006	京浜急行電鉄	188,200	2,089.00	393,149,800	貸付有価証券 75,000株(18,000株)
9007	小田急電鉄	218,000	2,440.00	531,920,000	貸付有価証券 20,900株(20,900株)
9008	京王電鉄	76,000	6,260.00	475,760,000	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
9009	京成電鉄	102,000	4,005.00	408,510,000	
9010	富士急行	20,000	3,815.00	76,300,000	貸付有価証券 13,900株(7,900株)
9014	新京成電鉄	3,800	2,434.00	9,249,200	
9020	東日本旅客鉄道	258,000	9,733.00	2,511,114,000	貸付有価証券 24,600株(24,600株)
9021	西日本旅客鉄道	130,600	9,164.00	1,196,818,400	貸付有価証券 39,400株
9022	東海旅客鉄道	121,900	22,145.00	2,699,475,500	貸付有価証券 39,000株(2,100株)
9024	西武ホールディングス	196,700	1,726.00	339,504,200	
9025	鴻池運輸	23,300	1,571.00	36,604,300	貸付有価証券 7,400株(2,200株)
9031	西日本鉄道	40,600	2,594.00	105,316,400	貸付有価証券 28,400株(16,100株)
9037	ハマキョウレックス	11,200	3,420.00	38,304,000	
9039	サカイ引越センター	7,700	6,210.00	47,817,000	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	138,800	5,820.00	807,816,000	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	185,100	4,325.00	800,557,500	
9044	南海電気鉄道	65,800	2,779.00	182,858,200	
9045	京阪ホールディングス	61,800	4,950.00	305,910,000	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
9046	神戸電鉄	3,300	3,960.00	13,068,000	

9048	名古屋鉄道	114,100	3,275.00	373,677,500	貸付有価証券 45,400株(10,900株)
9052	山陽電気鉄道	9,900	2,144.00	21,225,600	貸付有価証券 2,800株
9062	日本通運	49,100	5,930.00	291,163,000	
9064	ヤマトホールディングス	243,300	1,905.00	463,486,500	
9065	山九	38,600	5,510.00	212,686,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
9067	丸運	7,900	333.00	2,630,700	貸付有価証券 2,600株(200株)
9068	丸全昭和運輸	11,300	2,945.00	33,278,500	貸付有価証券 3,400株
9069	センコーグループホールディングス	76,500	887.00	67,855,500	貸付有価証券 7,300株(7,300株)
9070	トナミホールディングス	3,300	5,040.00	16,632,000	貸付有価証券 1,300株(300株)
9072	ニッコンホールディングス	49,700	2,594.00	128,921,800	貸付有価証券 19,800株(4,800株)
9074	日本石油輸送	1,500	2,955.00	4,432,500	
9075	福山通運	17,800	3,765.00	67,017,000	貸付有価証券 7,100株(1,700株)
9076	セイノーホールディングス	104,000	1,451.00	150,904,000	
9078	エスライン	4,200	1,030.00	4,326,000	貸付有価証券 1,300株
9081	神奈川中央交通	3,400	4,020.00	13,668,000	
9086	日立物流	25,400	3,240.00	82,296,000	
9090	丸和運輸機関	14,600	2,294.00	33,492,400	貸付有価証券 5,800株(1,400株)
9099	C & F ロジホールディングス	14,000	1,262.00	17,668,000	貸付有価証券 5,500株(1,300株)
9142	九州旅客鉄道	123,800	3,625.00	448,775,000	
9143	S Gホールディングス	145,700	2,435.00	354,779,500	
9101	日本郵船	116,100	1,759.00	204,219,900	貸付有価証券 46,100株(46,100株)
9104	商船三井	87,800	2,568.00	225,470,400	
9107	川崎汽船	42,700	1,479.00	63,153,300	貸付有価証券 15,600株(15,600株)
9110	N S ユナイテッド海運	7,600	1,981.00	15,055,600	貸付有価証券 5,300株(3,000株)
9115	明治海運	14,700	359.00	5,277,300	貸付有価証券 4,500株
9119	飯野海運	65,700	367.00	24,111,900	貸付有価証券 26,000株(26,000株)
9130	共栄タンカー	2,400	970.00	2,328,000	
9308	乾汽船	8,000	1,162.00	9,296,000	貸付有価証券 5,800株(3,300株)
9201	日本航空	249,900	3,127.00	781,437,300	
9202	A N Aホールディングス	253,700	3,466.00	879,324,200	貸付有価証券 177,400株(100,800株)

9232	パスコ	2,700	1,907.00	5,148,900	貸付有価証券 800株
9058	トランコム	3,900	7,690.00	29,991,000	貸付有価証券 400株(400株)
9066	日新	12,000	1,630.00	19,560,000	
9301	三菱倉庫	44,000	2,755.00	121,220,000	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	15,900	1,805.00	28,699,500	
9303	住友倉庫	51,100	1,502.00	76,752,200	貸付有価証券 20,400株(4,900株)
9304	澁澤倉庫	7,600	2,135.00	16,226,000	貸付有価証券 1,700株
9306	東陽倉庫	25,100	327.00	8,207,700	貸付有価証券 8,500株(900株)
9310	日本トランスシティ	30,600	481.00	14,718,600	貸付有価証券 11,600株(2,900株)
9312	ケイヒン	2,700	1,310.00	3,537,000	
9319	中央倉庫	8,500	1,139.00	9,681,500	貸付有価証券 2,600株
9322	川西倉庫	2,500	1,044.00	2,610,000	
9324	安田倉庫	11,400	1,109.00	12,642,600	
9325	ファイズホールディングス	3,000	426.00	1,278,000	貸付有価証券 300株(300株)
9351	東洋埠頭	4,200	1,400.00	5,880,000	貸付有価証券 1,300株
9358	宇徳	11,900	543.00	6,461,700	貸付有価証券 3,900株(300株)
9364	上組	79,500	2,411.00	191,674,500	
9366	サンリツ	3,300	691.00	2,280,300	
9368	キムラユニティー	3,700	1,109.00	4,103,300	
9369	キューソー流通システム	3,500	2,004.00	7,014,000	
9375	近鉄エクスプレス	29,500	1,813.00	53,483,500	貸付有価証券 8,900株
9380	東海運	7,900	283.00	2,235,700	
9381	エーアイティー	9,800	997.00	9,770,600	貸付有価証券 3,000株
9384	内外トランスライン	4,900	1,288.00	6,311,200	
9386	日本コンセプト	4,400	1,534.00	6,749,600	
1973	NECネットエスアイ	13,600	4,205.00	57,188,000	貸付有価証券 4,100株
2307	クロスキャット	3,800	1,249.00	4,746,200	貸付有価証券 1,500株(400株)
2317	システナ	51,300	1,741.00	89,313,300	
2326	デジタルアーツ	7,100	5,680.00	40,328,000	貸付有価証券 2,900株(700株)
2327	日鉄ソリューションズ	21,500	3,415.00	73,422,500	
2335	キューブシステム	7,600	777.00	5,905,200	貸付有価証券 3,000株(700株)

2352	エイジア	2,600	1,485.00	3,861,000	貸付有価証券 300株(300株)
2359	コア	6,100	1,408.00	8,588,800	貸付有価証券 600株(600株)
3040	ソリトンシステムズ	6,300	1,271.00	8,007,300	貸付有価証券 1,900株
3371	ソフトクリエイティブホールディングス	6,300	1,780.00	11,214,000	貸付有価証券 1,000株
3626	T I S	47,900	6,910.00	330,989,000	
3627	ネオス	5,700	730.00	4,161,000	貸付有価証券 1,700株
3630	電算システム	5,500	2,859.00	15,724,500	貸付有価証券 1,700株
3632	グリー	88,200	478.00	42,159,600	貸付有価証券 29,900株
3635	コーエーテクモホールディングス	29,400	3,105.00	91,287,000	貸付有価証券 20,600株(11,700株)
3636	三菱総合研究所	6,200	4,505.00	27,931,000	
3639	ボルテージ	3,000	542.00	1,626,000	貸付有価証券 1,100株(300株)
3640	電算	1,600	2,232.00	3,571,200	貸付有価証券 200株
3648	A G S	8,100	847.00	6,860,700	貸付有価証券 800株
3649	ファインデックス	12,100	1,196.00	14,471,600	
3655	ブレインパッド	3,600	5,780.00	20,808,000	貸付有価証券 1,100株(300株)
3656	K L a b	27,800	837.00	23,268,600	貸付有価証券 11,000株(2,600株)
3657	ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,300	970.00	16,781,000	
3658	イーブックイニシアティブジャパン	2,100	1,754.00	3,683,400	貸付有価証券 600株
3659	ネクソン	409,600	1,605.00	657,408,000	貸付有価証券 123,300株
3660	アイスタイル	40,300	465.00	18,739,500	
3661	エムアップ	4,100	2,998.00	12,291,800	貸付有価証券 2,900株(1,600株)
3662	エイチーム	9,900	971.00	9,612,900	貸付有価証券 3,900株(900株)
3665	エニグモ	10,200	902.00	9,200,400	貸付有価証券 4,000株(1,000株)
3666	テクノスジャパン	11,100	519.00	5,760,900	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
3667	e n i s h	6,400	562.00	3,596,800	貸付有価証券 4,400株(2,500株)
3668	コロプラ	47,100	1,188.00	55,954,800	貸付有価証券 18,700株(4,500株)
3672	オルトプラス	10,700	899.00	9,619,300	貸付有価証券 6,600株(3,700株)
3673	ブロードリーフ	71,300	623.00	44,419,900	

3675	クロス・マーケティンググループ	6,400	353.00	2,259,200	貸付有価証券 1,900株(600株)
3676	デジタルハーツホールディングス	7,600	955.00	7,258,000	貸付有価証券 700株(700株)
3677	システム情報	7,300	1,001.00	7,307,300	
3678	メディアドゥホールディングス	4,500	3,190.00	14,355,000	
3679	じげん	35,600	515.00	18,334,000	貸付有価証券 10,500株
3681	ブイキューブ	8,800	657.00	5,781,600	
3682	エンカレッジ・テクノロジー	2,400	880.00	2,112,000	
3683	サイバーリンクス	2,200	1,150.00	2,530,000	
3686	ディー・エル・イー	11,600	184.00	2,134,400	貸付有価証券 4,000株(1,000株)
3687	フィックスターズ	15,300	1,521.00	23,271,300	貸付有価証券 6,100株(1,500株)
3688	CARTA HOLDINGS	6,900	1,092.00	7,534,800	貸付有価証券 2,100株
3694	オブティム	3,800	4,505.00	17,119,000	貸付有価証券 1,100株
3696	セレス	4,700	1,203.00	5,654,100	貸付有価証券 500株(500株)
3697	SHIFT	3,800	7,830.00	29,754,000	
3738	ティーガイア	12,800	2,731.00	34,956,800	
3741	セック	2,100	3,880.00	8,148,000	
3751	日本アジアグループ	15,200	375.00	5,700,000	貸付有価証券 4,600株
3756	豆蔵ホールディングス	9,800	1,883.00	18,453,400	貸付有価証券 900株(900株)
3762	テクマトリックス	10,100	2,778.00	28,057,800	
3763	プロシップ	4,200	1,345.00	5,649,000	貸付有価証券 1,200株
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,700	2,081.00	72,210,700	貸付有価証券 10,500株
3769	GMOペイメントゲートウェイ	23,700	7,280.00	172,536,000	貸付有価証券 16,500株(9,400株)
3770	ザッパラス	6,200	386.00	2,393,200	貸付有価証券 1,500株(1,000株)
3771	システムリサーチ	3,800	1,912.00	7,265,600	貸付有価証券 1,500株(400株)
3774	インターネットイニシアティブ	21,300	2,999.00	63,878,700	貸付有価証券 6,500株
3778	さくらインターネット	15,400	658.00	10,133,200	貸付有価証券 4,700株
3784	ヴィンクス	4,000	1,119.00	4,476,000	貸付有価証券 1,600株(400株)
3788	GMOクラウド	2,700	2,546.00	6,874,200	貸付有価証券 1,800株(1,000株)
3817	SRAホールディングス	7,600	2,642.00	20,079,200	
3826	システムインテグレータ	4,500	907.00	4,081,500	貸付有価証券 1,300株

3834	朝日ネット	10,200	746.00	7,609,200	
3835	e B A S E	8,600	1,678.00	14,430,800	貸付有価証券 2,600株
3836	アバント	10,300	1,082.00	11,144,600	
3837	アドソル日進	5,100	2,415.00	12,316,500	貸付有価証券 500株（500株）
3843	フリービット	7,500	874.00	6,555,000	貸付有価証券 3,400株（800株）
3844	コムチュア	16,100	2,281.00	36,724,100	
3852	サイバーコム	2,600	2,106.00	5,475,600	
3853	アステリア	8,800	574.00	5,051,200	貸付有価証券 3,400株（800株）
3854	アイル	5,100	1,848.00	9,424,800	
3901	マークライズ	7,200	2,017.00	14,522,400	
3902	メディカル・データ・ビジョン	10,900	835.00	9,101,500	貸付有価証券 3,300株
3903	g u m i	18,400	758.00	13,947,200	貸付有価証券 12,800株（7,300株）
3909	ショーケース	3,400	710.00	2,414,000	貸付有価証券 300株（300株）
3912	モバイルファクトリー	3,200	1,743.00	5,577,600	貸付有価証券 1,300株（300株）
3915	テラスカイ	5,200	3,105.00	16,146,000	
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,600	1,803.00	10,096,800	貸付有価証券 2,500株（600株）
3918	P C Iホールディングス	2,900	2,269.00	6,580,100	貸付有価証券 300株（300株）
3919	パイブドHD	1,800	1,892.00	3,405,600	
3920	アイビーシー	2,600	1,534.00	3,988,400	貸付有価証券 300株（300株）
3921	ネオジャパン	2,700	1,222.00	3,299,400	貸付有価証券 300株（300株）
3922	P R T I M E S	1,200	2,506.00	3,007,200	貸付有価証券 500株（100株）
3924	ランドコンピュータ	2,200	1,155.00	2,541,000	
3925	ダブルスタンダード	1,800	4,305.00	7,749,000	貸付有価証券 200株（200株）
3926	オープンドア	7,100	1,335.00	9,478,500	貸付有価証券 2,200株
3928	マイネット	4,600	679.00	3,123,400	貸付有価証券 1,800株（400株）
3932	アカツキ	5,100	5,500.00	28,050,000	貸付有価証券 2,000株（500株）
3934	ベネフィットジャパン	1,100	1,751.00	1,926,100	貸付有価証券 100株（100株）
3937	U b i c o mホールディングス	3,200	1,386.00	4,435,200	貸付有価証券 300株（300株）
3938	L I N E	31,800	5,380.00	171,084,000	
3939	カナミックネットワーク	8,800	774.00	6,811,200	

3940	ノムラシステムコーポレーション	3,100	513.00	1,590,300	貸付有価証券 1,300株(300株)
3962	チェンジ	2,900	3,635.00	10,541,500	貸付有価証券 1,200株(300株)
3963	シンクロ・フード	6,100	550.00	3,355,000	貸付有価証券 1,800株
3964	オークネット	8,800	1,214.00	10,683,200	貸付有価証券 3,600株(900株)
3968	セグエグループ	2,400	885.00	2,124,000	貸付有価証券 600株
3969	エイトレッド	1,800	1,383.00	2,489,400	貸付有価証券 200株(200株)
3975	AOI TYO Holdings	14,500	701.00	10,164,500	
3978	マクロミル	29,300	1,006.00	29,475,800	
3981	ビーグリー	2,800	1,180.00	3,304,000	
3983	オロ	3,800	3,595.00	13,661,000	
3984	ユーザーローカル	1,100	3,055.00	3,360,500	
3985	テモナ	1,900	550.00	1,045,000	貸付有価証券 800株(200株)
3992	ニーズウェル	1,700	786.00	1,336,200	
3996	サインポスト	2,200	1,979.00	4,353,800	貸付有価証券 900株(200株)
4284	ソルクシーズ	6,100	908.00	5,538,800	
4295	フェイス	5,000	807.00	4,035,000	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	12,900	1,353.00	17,453,700	
4299	ハイマックス	1,700	1,963.00	3,337,100	
4307	野村総合研究所	203,900	2,698.00	550,122,200	
4312	サイバネットシステム	10,200	923.00	9,414,600	
4320	CEホールディングス	8,200	502.00	4,116,400	貸付有価証券 2,500株
4323	日本システム技術	2,300	1,386.00	3,187,800	
4326	インテージホールディングス	17,900	906.00	16,217,400	
4333	東邦システムサイエンス	3,800	881.00	3,347,800	
4344	ソースネクスト	68,200	502.00	34,236,400	貸付有価証券 26,800株(6,400株)
4348	インフォコム	15,700	3,085.00	48,434,500	
4382	HEROZ	1,500	4,960.00	7,440,000	
4384	ラクスル	7,600	3,635.00	27,626,000	貸付有価証券 2,300株
4392	FIG	15,600	299.00	4,664,400	貸付有価証券 6,200株(1,500株)
4396	システムサポート	1,200	2,648.00	3,177,600	
4420	イーソル	5,100	2,335.00	11,908,500	
4423	アルテリア・ネットワークス	15,900	1,932.00	30,718,800	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,300	1,785.00	5,890,500	貸付有価証券 2,300株(1,300株)
4662	フォーカスシステムズ	8,900	1,001.00	8,908,900	

4674	クレスコ	8,700	1,900.00	16,530,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	138,500	1,485.00	205,672,500	
4684	オービック	49,900	15,570.00	776,943,000	貸付有価証券 19,800株(4,800株)
4686	ジャストシステム	23,400	5,870.00	137,358,000	
4687	TDCソフト	12,600	1,001.00	12,612,600	貸付有価証券 3,800株
4689	Zホールディングス	1,975,100	420.00	829,542,000	貸付有価証券 581,600株
4704	トレンドマイクロ	63,900	5,850.00	373,815,000	
4709	IDホールディングス	5,500	1,545.00	8,497,500	貸付有価証券 1,600株
4716	日本オラクル	29,200	9,680.00	282,656,000	
4719	アルファシステムズ	4,500	2,858.00	12,861,000	貸付有価証券 1,800株(400株)
4722	フューチャー	17,400	1,966.00	34,208,400	貸付有価証券 4,700株
4725	CAC Holdings	9,300	1,472.00	13,689,600	
4726	SBテクノロジー	5,200	2,418.00	12,573,600	
4728	トーセ	3,900	928.00	3,619,200	貸付有価証券 2,600株(1,500株)
4733	オービックビジネスコンサルタント	14,700	4,350.00	63,945,000	貸付有価証券 10,200株(5,800株)
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	65,500	3,270.00	214,185,000	
4743	アイティフォー	17,400	776.00	13,502,400	貸付有価証券 6,900株(1,700株)
4746	東計電算	2,100	3,970.00	8,337,000	
4762	エクスネット	2,300	959.00	2,205,700	
4768	大塚商会	77,800	5,070.00	394,446,000	
4776	サイボウズ	16,800	2,168.00	36,422,400	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
4779	ソフトブレーン	8,500	571.00	4,853,500	貸付有価証券 3,400株(800株)
4812	電通国際情報サービス	8,900	4,795.00	42,675,500	貸付有価証券 2,700株
4819	デジタルガレージ	25,900	4,230.00	109,557,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
4820	EMシステムズ	20,200	903.00	18,240,600	
4825	ウェザーニューズ	4,900	3,880.00	19,012,000	
4826	CIJ	9,800	866.00	8,486,800	
4828	ビジネスエンジニアリング	1,600	3,505.00	5,608,000	貸付有価証券 500株
4829	日本エンタープライズ	14,600	266.00	3,883,600	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	6,900	2,657.00	18,333,300	
4845	スカラ	9,600	749.00	7,190,400	
4847	インテリジェント ウェイブ	6,300	812.00	5,115,600	貸付有価証券 2,100株(500株)

6879	I M A G I C A G R O U P	12,200	530.00	6,466,000	貸付有価証券 3,600株
7518	ネットワンシステムズ	54,800	1,929.00	105,709,200	
7527	システムソフト	34,100	99.00	3,375,900	貸付有価証券 13,500株(13,500株)
7595	アルゴグラフィックス	12,200	3,855.00	47,031,000	
7844	マーベラス	21,900	700.00	15,330,000	
7860	エイベックス	24,700	1,227.00	30,306,900	
8056	日本ユニシス	44,900	3,810.00	171,069,000	
8096	兼松エレクトロニクス	7,800	3,575.00	27,885,000	貸付有価証券 2,400株
9401	東京放送ホールディングス	87,500	1,913.00	167,387,500	貸付有価証券 61,400株(34,900株)
9404	日本テレビホールディングス	120,100	1,486.00	178,468,600	貸付有価証券 11,500株(11,500株)
9405	朝日放送グループホールディングス	14,300	745.00	10,653,500	
9409	テレビ朝日ホールディングス	39,500	2,074.00	81,923,000	貸付有価証券 15,700株(3,800株)
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	94,600	468.00	44,272,800	
9413	テレビ東京ホールディングス	11,800	2,354.00	27,777,200	貸付有価証券 8,100株(4,600株)
9414	日本BS放送	4,900	1,232.00	6,036,800	貸付有価証券 100株(100株)
9416	ビジョン	13,400	1,447.00	19,389,800	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
9417	スマートバリュー	3,700	811.00	3,000,700	貸付有価証券 1,700株(400株)
9418	USEN-NEXT HOLDING S	5,500	1,711.00	9,410,500	貸付有価証券 1,600株
9419	ワイヤレスゲート	6,800	777.00	5,283,600	貸付有価証券 2,000株
9422	コネクシオ	8,100	1,555.00	12,595,500	貸付有価証券 2,500株
9424	日本通信	112,100	239.00	26,791,900	貸付有価証券 44,500株(10,700株)
9428	クロップス	2,600	867.00	2,254,200	貸付有価証券 800株
9432	日本電信電話	1,922,600	2,818.50	5,418,848,100	
9433	K D D I	1,071,900	3,330.00	3,569,427,000	貸付有価証券 246,800株
9434	ソフトバンク	1,307,100	1,499.50	1,959,996,450	貸付有価証券 125,700株(125,700 株)
9435	光通信	14,800	26,960.00	399,008,000	
9437	N T T ドコモ	1,062,400	3,089.00	3,281,753,600	貸付有価証券 419,300株(100,600 株)
9438	エムティーアイ	13,900	708.00	9,841,200	貸付有価証券 4,200株
9449	G M O インターネット	56,700	2,110.00	119,637,000	

9450	ファイバークラウド	3,400	1,305.00	4,437,000	
9466	アイドママーケティングコミュニケーション	4,300	611.00	2,627,300	
9468	K A D O K A W A	38,700	1,846.00	71,440,200	
9470	学研ホールディングス	4,800	7,160.00	34,368,000	
9474	ゼンリン	28,700	1,554.00	44,599,800	貸付有価証券 8,600株
9475	昭文社	6,600	377.00	2,488,200	貸付有価証券 2,000株
9479	インプレスホールディングス	11,900	177.00	2,106,300	
9600	アイネット	7,400	1,598.00	11,825,200	貸付有価証券 2,600株(400株)
9601	松竹	9,500	14,930.00	141,835,000	貸付有価証券 5,300株(3,800株)
9602	東宝	86,000	4,105.00	353,030,000	貸付有価証券 60,400株(34,300株)
9605	東映	5,400	15,170.00	81,918,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	382,900	1,462.00	559,799,800	貸付有価証券 115,700株
9629	ピー・シー・エー	1,800	4,440.00	7,992,000	貸付有価証券 600株
9658	ビジネスブレイン太田昭和	2,500	2,811.00	7,027,500	貸付有価証券 200株(200株)
9682	D T S	32,100	2,248.00	72,160,800	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	61,300	5,610.00	343,893,000	貸付有価証券 24,500株(5,900株)
9692	シーイーシー	15,400	2,086.00	32,124,400	
9697	カブコン	67,800	3,355.00	227,469,000	貸付有価証券 21,900株(6,400株)
9702	アイ・エス・ピー	2,800	1,945.00	5,446,000	
9717	ジャステック	9,200	1,084.00	9,972,800	貸付有価証券 2,700株
9719	S C S K	33,200	5,930.00	196,876,000	
9739	日本システムウエア	4,700	2,383.00	11,200,100	
9742	アイネス	14,100	1,726.00	24,336,600	
9746	T K C	12,200	5,660.00	69,052,000	
9749	富士ソフト	18,400	4,565.00	83,996,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
9759	N S D	46,200	1,810.00	83,622,000	貸付有価証券 12,000株
9766	コナミホールディングス	52,200	4,300.00	224,460,000	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	5,700	3,400.00	19,380,000	貸付有価証券 1,700株
9889	J B C C ホールディングス	9,700	2,014.00	19,535,800	貸付有価証券 900株(900株)
9928	ミロク情報サービス	12,700	3,075.00	39,052,500	貸付有価証券 3,800株

9984	ソフトバンクグループ	1,141,200	4,577.00	5,223,272,400	
1352	ハウスイ	1,100	929.00	1,021,900	
2676	高千穂交易	5,600	1,161.00	6,501,600	貸付有価証券 2,000株（500株）
2692	伊藤忠食品	3,600	5,050.00	18,180,000	貸付有価証券 1,100株
2715	エレマテック	13,500	1,049.00	14,161,500	貸付有価証券 4,100株
2729	JALUX	4,100	2,346.00	9,618,600	貸付有価証券 1,300株
2733	あらた	11,500	4,570.00	52,555,000	貸付有価証券 4,600株（1,100株）
2737	トーメンデバイス	2,200	3,945.00	8,679,000	貸付有価証券 1,200株（600株）
2760	東京エレクトロン デバイス	5,200	2,541.00	13,213,200	
2767	フィールズ	11,100	564.00	6,260,400	
2768	双日	797,300	348.00	277,460,400	
2784	アルフレッサ ホールディングス	160,400	2,274.00	364,749,600	貸付有価証券 63,800株（15,300株）
2874	横浜冷凍	40,500	971.00	39,325,500	貸付有価証券 28,200株（16,000株）
3004	神栄	2,000	790.00	1,580,000	貸付有価証券 100株（100株）
3023	ラサ商事	7,600	930.00	7,068,000	
3031	ラクーンホールディングス	6,100	815.00	4,971,500	
3036	アルコニックス	15,300	1,333.00	20,394,900	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
3038	神戸物産	49,800	4,365.00	217,377,000	
3076	あい ホールディングス	20,600	1,896.00	39,057,600	貸付有価証券 6,200株
3079	ディーブイエックス	5,100	950.00	4,845,000	貸付有価証券 1,600株
3107	ダイワボウホールディングス	12,300	6,300.00	77,490,000	貸付有価証券 3,700株
3132	マクニカ・富士エレホールディングス	34,400	1,749.00	60,165,600	
3139	ラクト・ジャパン	5,400	4,210.00	22,734,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,200	1,038.00	28,233,600	
3153	八洲電機	11,200	906.00	10,147,200	
3154	メディアスホールディングス	8,200	856.00	7,019,200	貸付有価証券 2,500株
3156	レスターホールディングス	15,100	1,857.00	28,040,700	貸付有価証券 6,000株（6,000株）
3157	ジュートックホールディングス	3,300	1,162.00	3,834,600	
3160	大光	6,100	678.00	4,135,800	
3166	OCHIホールディングス	4,200	1,442.00	6,056,400	貸付有価証券 1,200株

3167	TOKAIホールディングス	76,300	1,013.00	77,291,900	貸付有価証券 23,000株
3168	黒谷	3,300	498.00	1,643,400	貸付有価証券 1,000株
3173	Cominix	2,500	824.00	2,060,000	貸付有価証券 200株（200株）
3176	三洋貿易	14,500	1,325.00	19,212,500	
3180	ビューティガレージ	2,300	2,255.00	5,186,500	
3183	ウイン・パートナーズ	10,400	1,145.00	11,908,000	貸付有価証券 3,200株
3321	ミタチ産業	4,300	715.00	3,074,500	貸付有価証券 2,500株（1,700株）
3360	シップヘルスケアホールディングス	23,100	4,975.00	114,922,500	
3388	明治電機工業	4,500	1,500.00	6,750,000	貸付有価証券 1,200株（400株）
3392	デリカフーズホールディングス	5,100	717.00	3,656,700	
3393	スターティアホールディングス	3,300	803.00	2,649,900	貸付有価証券 1,300株（300株）
3543	コメダホールディングス	31,400	2,198.00	69,017,200	
3559	ピーバンドットコム	1,100	1,168.00	1,284,800	
3565	アセンテック	1,200	2,589.00	3,106,800	
5009	富士興産	4,400	658.00	2,895,200	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	1,600	1,399.00	2,238,400	貸付有価証券 300株（300株）
7414	小野建	12,900	1,376.00	17,750,400	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
7417	南陽	3,200	1,817.00	5,814,400	貸付有価証券 1,000株
7420	佐鳥電機	9,800	865.00	8,477,000	貸付有価証券 4,200株（1,000株）
7427	エコトレーディング	3,300	576.00	1,900,800	貸付有価証券 100株（100株）
7433	伯東	8,800	1,296.00	11,404,800	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	11,200	1,165.00	13,048,000	
7442	中山福	8,300	512.00	4,249,600	
7447	ナガイレーベン	20,900	2,370.00	49,533,000	貸付有価証券 14,600株（8,300株）
7451	三菱食品	15,900	3,170.00	50,403,000	貸付有価証券 11,100株（6,300株）
7456	松田産業	10,500	1,571.00	16,495,500	貸付有価証券 3,200株
7458	第一興商	21,500	5,310.00	114,165,000	貸付有価証券 6,500株
7459	メディパルホールディングス	155,800	2,326.00	362,390,800	
7466	S P K	3,100	2,628.00	8,146,800	
7467	萩原電気ホールディングス	5,300	2,544.00	13,483,200	貸付有価証券 2,100株（500株）

7476	アズワン	9,400	9,320.00	87,608,000	貸付有価証券 900株（900株）
7480	スズデン	5,000	1,406.00	7,030,000	
7481	尾家産業	4,200	1,327.00	5,573,400	貸付有価証券 1,000株
7482	シモジマ	8,800	1,123.00	9,882,400	貸付有価証券 2,700株
7483	ドウシシャ	13,600	1,703.00	23,160,800	
7487	小津産業	3,200	1,857.00	5,942,400	貸付有価証券 1,000株
7504	高速	8,600	1,219.00	10,483,400	貸付有価証券 2,200株
7510	たけびし	5,100	1,468.00	7,486,800	貸付有価証券 1,500株
7525	リックス	3,200	1,710.00	5,472,000	貸付有価証券 900株（300株）
7537	丸文	12,800	631.00	8,076,800	貸付有価証券 3,900株
7552	ハピネット	12,000	1,351.00	16,212,000	
7570	橋本総業ホールディングス	2,900	1,821.00	5,280,900	貸付有価証券 900株
7575	日本ライフライン	42,800	1,460.00	62,488,000	貸付有価証券 12,900株
7590	タカショー	7,000	468.00	3,276,000	
7591	エクセル	4,000	1,596.00	6,384,000	
7594	マルカ	5,100	2,112.00	10,771,200	貸付有価証券 2,100株（500株）
7599	I D O M	38,900	587.00	22,834,300	貸付有価証券 15,600株（15,600株）
7607	進和	8,500	2,236.00	19,006,000	貸付有価証券 2,600株
7608	エスケイジャパン	3,100	450.00	1,395,000	貸付有価証券 1,000株
7609	ダイトロン	6,100	1,696.00	10,345,600	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
7613	シークス	18,300	1,311.00	23,991,300	貸付有価証券 11,000株（7,300株）
7619	田中商事	4,400	723.00	3,181,200	
7628	オーハシテクニカ	8,100	1,534.00	12,425,400	貸付有価証券 800株（800株）
7637	白銅	5,200	1,520.00	7,904,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
8001	伊藤忠商事	1,009,700	2,604.50	2,629,763,650	
8002	丸紅	1,502,700	797.50	1,198,403,250	
8007	高島	2,300	1,941.00	4,464,300	
8012	長瀬産業	81,200	1,553.00	126,103,600	貸付有価証券 6,800株
8014	蝶理	9,200	2,149.00	19,770,800	貸付有価証券 2,800株

8015	豊田通商	161,100	3,725.00	600,097,500	貸付有価証券 48,700株
8018	三共生興	21,800	578.00	12,600,400	貸付有価証券 2,500株
8020	兼松	53,800	1,417.00	76,234,600	
8025	ツカモトコーポレーション	2,600	1,130.00	2,938,000	貸付有価証券 600株
8031	三井物産	1,268,900	1,945.50	2,468,644,950	
8032	日本紙パルプ商事	8,200	3,985.00	32,677,000	貸付有価証券 3,300株（800株）
8036	日立ハイテクノロジーズ	50,100	8,010.00	401,301,000	貸付有価証券 15,100株
8037	カメイ	18,800	1,158.00	21,770,400	貸付有価証券 7,600株（1,900株）
8038	東都水産	1,800	2,833.00	5,099,400	
8041	OUGホールディングス	2,300	2,714.00	6,242,200	貸付有価証券 100株（100株）
8043	スターゼン	5,300	4,530.00	24,009,000	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
8051	山善	56,400	1,031.00	58,148,400	貸付有価証券 17,000株
8052	椿本興業	2,700	4,045.00	10,921,500	貸付有価証券 500株（500株）
8053	住友商事	910,900	1,666.50	1,518,014,850	貸付有価証券 273,900株
8057	内田洋行	6,200	6,860.00	42,532,000	
8058	三菱商事	1,013,000	2,872.00	2,909,336,000	貸付有価証券 383,700株（96,600株）
8059	第一実業	7,100	3,700.00	26,270,000	貸付有価証券 1,900株
8060	キャノンマーケティングジャパン	41,300	2,710.00	111,923,000	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
8061	西華産業	8,200	1,295.00	10,619,000	貸付有価証券 800株（800株）
8065	佐藤商事	11,900	946.00	11,257,400	貸付有価証券 4,700株（1,100株）
8068	菱洋エレクトロ	14,600	1,864.00	27,214,400	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
8070	東京産業	13,100	612.00	8,017,200	貸付有価証券 5,300株（1,300株）
8074	ユアサ商事	13,700	3,485.00	47,744,500	貸付有価証券 9,700株（5,500株）
8075	神鋼商事	3,600	2,493.00	8,974,800	
8077	小林産業	8,600	281.00	2,416,600	貸付有価証券 2,600株（400株）
8078	阪和興業	27,000	2,708.00	73,116,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
8079	正栄食品工業	9,300	3,830.00	35,619,000	貸付有価証券 3,800株（900株）

8081	カナデン	11,700	1,339.00	15,666,300	貸付有価証券 4,700株（1,100株）
8084	菱電商事	10,400	1,680.00	17,472,000	貸付有価証券 800株
8087	フルサト工業	8,000	1,707.00	13,656,000	
8088	岩谷産業	32,000	3,660.00	117,120,000	貸付有価証券 12,700株（3,000株）
8089	すてきナイスグループ	6,200	1,226.00	7,601,200	
8090	昭光通商	4,600	704.00	3,238,400	貸付有価証券 3,200株（1,800株）
8091	ニチモウ	2,200	2,036.00	4,479,200	
8093	極東貿易	4,100	2,037.00	8,351,700	貸付有価証券 1,200株
8095	イワキ	18,900	521.00	9,846,900	貸付有価証券 5,700株
8097	三愛石油	35,500	1,120.00	39,760,000	貸付有価証券 11,700株（3,400株）
8098	稲畑産業	31,800	1,496.00	47,572,800	貸付有価証券 9,700株
8101	G S I クレオス	3,500	1,239.00	4,336,500	
8103	明和産業	13,300	601.00	7,993,300	貸付有価証券 5,300株（1,300株）
8104	クワザワ	5,100	657.00	3,350,700	貸付有価証券 2,100株（500株）
8125	ワキタ	30,800	1,045.00	32,186,000	貸付有価証券 9,300株
8129	東邦ホールディングス	46,300	2,286.00	105,841,800	貸付有価証券 4,400株（4,400株）
8130	サンゲツ	39,700	1,928.00	76,541,600	
8131	ミツウロコグループホールディングス	21,300	1,150.00	24,495,000	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	2,099.00	12,384,100	貸付有価証券 1,300株
8133	伊藤忠エネクス	31,900	978.00	31,198,200	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
8136	サンリオ	40,500	2,181.00	88,330,500	貸付有価証券 16,200株（3,900株）
8137	サンワテクノス	10,200	950.00	9,690,000	
8140	リョーサン	15,900	2,498.00	39,718,200	貸付有価証券 6,300株（6,300株）
8141	新光商事	22,600	856.00	19,345,600	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
8142	トーヨー	6,500	1,836.00	11,934,000	
8150	三信電気	7,700	1,725.00	13,282,500	貸付有価証券 800株（800株）
8151	東陽テクニカ	16,600	1,109.00	18,409,400	
8153	モスフードサービス	18,900	3,080.00	58,212,000	
8154	加賀電子	14,400	2,312.00	33,292,800	貸付有価証券 5,800株（1,400株）

8158	ソーダニッカ	14,900	606.00	9,029,400	貸付有価証券 4,400株
8159	立花エレテック	10,700	1,809.00	19,356,300	貸付有価証券 1,100株
8275	フォーバル	6,300	1,146.00	7,219,800	貸付有価証券 1,900株
8283	PALTA C	23,100	5,300.00	122,430,000	貸付有価証券 16,200株(9,200株)
8285	三谷産業	19,000	351.00	6,669,000	貸付有価証券 5,700株
8835	太平洋興発	5,700	788.00	4,491,600	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	3,605.00	9,373,000	
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	2,088.00	2,714,400	貸付有価証券 300株
9274	国際紙パルプ商事	34,200	282.00	9,644,400	貸付有価証券 13,600株(3,300株)
9305	ヤマタネ	7,200	1,553.00	11,181,600	
9763	丸紅建材リース	1,400	1,839.00	2,574,600	
9810	日鉄物産	10,300	4,795.00	49,388,500	
9824	泉州電業	4,400	3,020.00	13,288,000	貸付有価証券 1,300株
9830	トラスコ中山	30,000	2,569.00	77,070,000	貸付有価証券 12,900株(3,900株)
9832	オートボックスセブン	53,500	1,612.00	86,242,000	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
9837	モリト	10,500	803.00	8,431,500	貸付有価証券 3,200株
9869	加藤産業	22,600	3,475.00	78,535,000	貸付有価証券 8,900株(2,100株)
9872	北恵	2,700	912.00	2,462,400	貸付有価証券 800株
9880	イノテック	8,600	1,167.00	10,036,200	
9882	イエローハット	27,300	1,729.00	47,201,700	貸付有価証券 8,200株
9896	JKホールディングス	13,000	740.00	9,620,000	貸付有価証券 1,900株(1,700株)
9902	日伝	13,100	2,010.00	26,331,000	貸付有価証券 4,000株
9930	北沢産業	10,800	272.00	2,937,600	貸付有価証券 7,600株(4,300株)
9932	杉本商事	7,800	1,979.00	15,436,200	貸付有価証券 700株(700株)
9934	因幡電機産業	41,100	2,727.00	112,079,700	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
9960	東テク	4,800	2,650.00	12,720,000	貸付有価証券 600株
9962	ミスミグループ本社	180,800	2,739.00	495,211,200	貸付有価証券 126,500株(71,900株)

9972	アルテック	11,400	266.00	3,032,400	
9982	タキヒヨー	4,400	1,887.00	8,302,800	貸付有価証券 700株
9986	蔵王産業	2,800	1,463.00	4,096,400	
9987	スズケン	61,100	4,300.00	262,730,000	
9991	ジェコス	9,900	1,067.00	10,563,300	貸付有価証券 3,000株
9995	グローセル	14,400	459.00	6,609,600	貸付有価証券 3,400株(800株)
2651	ローソン	36,500	6,330.00	231,045,000	
2659	サンエー	12,000	4,545.00	54,540,000	貸付有価証券 8,300株(4,700株)
2664	カワチ薬品	11,200	2,230.00	24,976,000	貸付有価証券 3,400株
2670	エービーシー・マート	22,500	7,120.00	160,200,000	
2674	ハードオフコーポレーション	5,700	820.00	4,674,000	
2678	アスクル	15,100	3,470.00	52,397,000	
2681	ゲオホールディングス	26,000	1,246.00	32,396,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
2685	アダストリア	20,000	2,139.00	42,780,000	
2686	ジーフット	8,700	625.00	5,437,500	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,100	667.00	1,400,700	貸付有価証券 500株
2695	くら寿司	7,500	5,550.00	41,625,000	貸付有価証券 2,300株
2698	キャンドウ	6,900	1,653.00	11,405,700	貸付有価証券 2,100株
2726	パルグループホールディングス	7,400	3,305.00	24,457,000	
2730	エディオン	66,300	1,076.00	71,338,800	貸付有価証券 46,200株(26,200株)
2734	サーラコーポレーション	29,300	636.00	18,634,800	貸付有価証券 8,900株
2735	ワッツ	6,400	626.00	4,006,400	
2742	ハローズ	5,400	2,716.00	14,666,400	貸付有価証券 1,600株
2752	フジオフードシステム	12,200	1,790.00	21,838,000	貸付有価証券 5,000株(1,200株)
2753	あみやき亭	3,100	3,485.00	10,803,500	
2764	ひらまつ	26,500	273.00	7,234,500	貸付有価証券 8,100株
2791	大黒天物産	3,500	3,655.00	12,792,500	貸付有価証券 1,100株
2792	ハニーズホールディングス	12,700	1,394.00	17,703,800	
2796	ファーマライズホールディングス	3,500	655.00	2,292,500	貸付有価証券 700株
3028	アルベン	11,100	1,666.00	18,492,600	貸付有価証券 3,300株

3030	ハブ	4,100	1,037.00	4,251,700	貸付有価証券 1,700株(400株)
3034	クオールホールディングス	21,200	1,415.00	29,998,000	貸付有価証券 800株(800株)
3046	ジズホールディングス	7,600	7,620.00	57,912,000	
3048	ビックカメラ	85,600	1,176.00	100,665,600	貸付有価証券 25,900株
3050	D C Mホールディングス	77,900	1,053.00	82,028,700	貸付有価証券 7,400株(7,400株)
3053	ベッパーフードサービス	11,500	978.00	11,247,000	貸付有価証券 3,500株
3064	MonotaRO	102,600	2,813.00	288,613,800	貸付有価証券 71,800株(40,800株)
3067	東京一番フーズ	3,700	622.00	2,301,400	
3073	D Dホールディングス	5,700	1,686.00	9,610,200	
3082	きちりホールディングス	3,800	769.00	2,922,200	
3085	アークランドサービスホールディングス	10,500	2,005.00	21,052,500	貸付有価証券 800株
3086	J . フロント リテイリング	172,400	1,314.00	226,533,600	
3087	ドトール・日レスホールディングス	23,000	2,114.00	48,622,000	
3088	マツモトキヨシホールディングス	59,700	4,400.00	262,680,000	貸付有価証券 23,700株(5,700株)
3091	ブロンコビリー	7,500	2,652.00	19,890,000	貸付有価証券 700株(700株)
3092	Z O Z O	99,300	1,722.00	170,994,600	貸付有価証券 56,700株(13,600株)
3093	トレジャー・ファクトリー	4,200	866.00	3,637,200	
3097	物語コーポレーション	3,800	9,170.00	34,846,000	貸付有価証券 1,400株(300株)
3098	ココカラファイン	15,100	5,640.00	85,164,000	貸付有価証券 4,600株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	252,300	828.00	208,904,400	貸付有価証券 100,500株(24,100株)
3134	H a m e e	5,100	1,685.00	8,593,500	貸付有価証券 400株(400株)
3141	ウエルシアホールディングス	42,900	6,140.00	263,406,000	貸付有価証券 9,700株(4,100株)
3148	クリエイトSDホールディングス	24,300	2,904.00	70,567,200	貸付有価証券 6,400株
3159	丸善CHIホールディングス	16,800	362.00	6,081,600	
3169	ミサワ	2,900	675.00	1,957,500	
3172	ティーライフ	1,900	903.00	1,715,700	
3175	エー・ピーカンパニー	2,700	614.00	1,657,800	
3178	チムニー	4,400	2,356.00	10,366,400	
3179	シュッピン	9,800	1,076.00	10,544,800	
3186	ネクステージ	20,600	1,058.00	21,794,800	貸付有価証券 8,200株(2,000株)
3191	ジョイフル本田	42,300	1,375.00	58,162,500	

3193	鳥貴族	4,800	2,572.00	12,345,600	貸付有価証券 1,100株
3194	キリン堂ホールディングス	5,700	1,751.00	9,980,700	貸付有価証券 1,700株
3196	ホットランド	9,600	1,301.00	12,489,600	貸付有価証券 900株(900株)
3197	すかいらーくホールディングス	161,800	2,045.00	330,881,000	貸付有価証券 64,300株(15,400株)
3198	S F Pホールディングス	6,200	2,245.00	13,919,000	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	5,400	1,963.00	10,600,200	貸付有価証券 3,700株(2,100株)
3221	ヨシックス	2,300	2,908.00	6,688,400	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ ホール	41,900	973.00	40,768,700	貸付有価証券 27,800株(16,600株)
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	649.00	4,348,300	
3328	B E E N O S	5,400	1,320.00	7,128,000	貸付有価証券 1,500株
3333	あさひ	10,700	1,329.00	14,220,300	貸付有価証券 500株
3341	日本調剤	4,400	3,705.00	16,302,000	
3349	コスモス薬品	6,400	24,730.00	158,272,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
3361	トーエル	7,000	803.00	5,621,000	貸付有価証券 2,100株
3376	オンリー	2,400	780.00	1,872,000	貸付有価証券 200株(200株)
3382	セブン&アイ・ホールディングス	564,700	4,276.00	2,414,657,200	
3387	クリエイト・レストランツ・ホール ディング	38,800	2,347.00	91,063,600	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
3391	ツルハホールディングス	31,400	13,370.00	419,818,000	貸付有価証券 9,500株
3395	サンマルクホールディングス	11,400	2,326.00	26,516,400	
3396	フェリシモ	3,200	996.00	3,187,200	
3397	トリドールホールディングス	17,800	2,604.00	46,351,200	
3415	T O K Y O B A S E	13,000	513.00	6,669,000	
3538	ウイルプラスホールディングス	1,800	832.00	1,497,600	
3539	J Mホールディングス	7,300	2,301.00	16,797,300	
3544	サツドラホールディングス	2,200	1,883.00	4,142,600	貸付有価証券 600株
3546	アレンザホールディングス	7,200	1,008.00	7,257,600	貸付有価証券 2,900株(700株)
3547	串カツ田中ホールディングス	2,200	2,324.00	5,112,800	貸付有価証券 900株(200株)
3548	パロックジャパンリミテッド	10,000	996.00	9,960,000	
3549	クスリのアオキホールディングス	12,900	6,740.00	86,946,000	貸付有価証券 10,100株(5,700株)
3561	力の源ホールディングス	6,500	1,027.00	6,675,500	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	15,800	9,500.00	150,100,000	
3564	L I X I L ビバ	14,200	2,213.00	31,424,600	貸付有価証券 4,300株
4350	メディカルシステムネットワーク	13,900	542.00	7,533,800	
7416	はるやまホールディングス	6,800	872.00	5,929,600	貸付有価証券 2,100株
7419	ノジマ	25,700	2,344.00	60,240,800	貸付有価証券 7,700株
7421	カップ・クリエイト	20,200	1,478.00	29,855,600	
7445	ライトオン	10,800	603.00	6,512,400	
7448	ジーンズメイト	4,400	297.00	1,306,800	貸付有価証券 3,000株（1,700株）
7453	良品計画	191,700	1,858.00	356,178,600	貸付有価証券 18,300株（18,300株）
7455	三城ホールディングス	15,300	338.00	5,171,400	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァン	22,000	1,299.00	28,578,000	貸付有価証券 8,800株（2,100株）
7475	アルビス	5,500	2,226.00	12,243,000	貸付有価証券 100株（100株）
7494	コナカ	17,000	414.00	7,038,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	1,800	1,697.00	3,054,600	貸付有価証券 500株
7508	G - 7ホールディングス	8,500	2,429.00	20,646,500	
7512	イオン北海道	14,500	805.00	11,672,500	貸付有価証券 4,400株
7513	コジマ	24,800	531.00	13,168,800	貸付有価証券 7,500株
7514	ヒマラヤ	5,000	814.00	4,070,000	
7516	コーナン商事	20,500	2,448.00	50,184,000	貸付有価証券 8,100株（1,900株）
7520	エコス	5,300	1,703.00	9,025,900	
7522	ワタミ	17,100	1,308.00	22,366,800	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
7524	マルシェ	3,800	784.00	2,979,200	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	317,200	1,770.00	561,444,000	
7545	西松屋チェーン	31,700	956.00	30,305,200	貸付有価証券 9,600株
7550	ゼンショーホールディングス	69,200	2,378.00	164,557,600	貸付有価証券 48,400株（27,500株）
7554	幸楽苑ホールディングス	9,200	1,879.00	17,286,800	貸付有価証券 6,300株（3,600株）
7561	ハークスレイ	3,000	1,288.00	3,864,000	
7581	サイゼリヤ	23,800	2,516.00	59,880,800	貸付有価証券 7,200株
7593	V Tホールディングス	59,800	448.00	26,790,400	
7596	魚力	4,000	1,601.00	6,404,000	
7601	ポブラ	3,800	508.00	1,930,400	

7605	フジ・コーポレーション	3,800	2,137.00	8,120,600	
7606	ユナイテッドアローズ	15,100	2,920.00	44,092,000	
7611	ハイデイ日高	20,800	1,999.00	41,579,200	貸付有価証券 14,600株(8,300株)
7615	京都きもの友禅	9,200	333.00	3,063,600	
7616	コロワイド	48,000	2,238.00	107,424,000	貸付有価証券 19,100株(19,100株)
7618	ピーシーデポコーポレーション	19,200	562.00	10,790,400	
7630	壱番屋	10,200	5,780.00	58,956,000	
7640	トップカルチャー	5,200	334.00	1,736,800	
7646	P L A N T	3,700	566.00	2,094,200	
7649	スギホールディングス	28,800	5,530.00	159,264,000	
7679	薬王堂ホールディングス	6,300	2,243.00	14,130,900	貸付有価証券 2,500株(600株)
7918	ヴィア・ホールディングス	17,700	670.00	11,859,000	貸付有価証券 5,300株
8005	スクロール	22,200	358.00	7,947,600	貸付有価証券 6,100株
8008	ヨンドシーホールディングス	14,700	2,412.00	35,456,400	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
8028	ファミリーマート	115,300	2,398.00	276,489,400	
8160	木曽路	18,900	2,983.00	56,378,700	
8163	S R Sホールディングス	17,000	1,052.00	17,884,000	
8165	千趣会	26,100	491.00	12,815,100	
8166	タカキュー	11,100	185.00	2,053,500	
8168	ケーヨー	29,600	557.00	16,487,200	貸付有価証券 8,900株
8173	上新電機	17,000	2,365.00	40,205,000	貸付有価証券 6,700株(1,600株)
8174	日本瓦斯	22,800	3,595.00	81,966,000	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	25,200	2,414.00	60,832,800	貸付有価証券 17,600株(10,000株)
8181	東天紅	1,100	1,277.00	1,404,700	
8182	いなげや	17,900	1,484.00	26,563,600	貸付有価証券 7,100株(1,700株)
8184	島忠	27,100	3,255.00	88,210,500	
8185	チヨダ	15,100	1,493.00	22,544,300	
8194	ライフコーポレーション	10,900	2,739.00	29,855,100	貸付有価証券 3,000株
8200	リンガーハット	17,800	2,465.00	43,877,000	貸付有価証券 7,100株(1,700株)
8203	M r M a x H D	19,800	478.00	9,464,400	貸付有価証券 7,900株(1,900株)
8207	テンアライド	13,300	444.00	5,905,200	
8214	A O K Iホールディングス	28,900	1,067.00	30,836,300	貸付有価証券 2,800株(2,800株)

8217	オークワ	22,600	1,526.00	34,487,600	貸付有価証券 8,900株(2,100株)
8218	コメリ	22,300	2,372.00	52,895,600	
8219	青山商事	29,800	1,432.00	42,673,600	
8227	しまむら	16,800	8,270.00	138,936,000	貸付有価証券 6,700株(1,600株)
8230	はせがわ	7,600	404.00	3,070,400	
8233	高島屋	105,200	1,195.00	125,714,000	貸付有価証券 10,100株(10,100株)
8237	松屋	29,100	772.00	22,465,200	貸付有価証券 20,300株(11,500株)
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	68,400	1,003.00	68,605,200	貸付有価証券 20,700株
8244	近鉄百貨店	5,500	3,500.00	19,250,000	貸付有価証券 1,700株
8251	パルコ	13,400	1,848.00	24,763,200	
8252	丸井グループ	132,300	2,487.00	329,030,100	貸付有価証券 92,300株(52,400株)
8255	アクシアル リテイリング	12,000	3,835.00	46,020,000	貸付有価証券 3,600株
8260	井筒屋	7,800	242.00	1,887,600	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	555,500	2,300.00	1,277,650,000	貸付有価証券 43,200株(43,200株)
8273	イズミ	29,400	3,515.00	103,341,000	
8276	平和堂	29,300	1,975.00	57,867,500	貸付有価証券 11,700株(2,800株)
8278	フジ	17,400	1,870.00	32,538,000	貸付有価証券 6,900株(1,700株)
8279	ヤオコー	16,400	5,760.00	94,464,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
8281	ゼビオホールディングス	17,400	1,185.00	20,619,000	
8282	ケーズホールディングス	139,300	1,326.00	184,711,800	貸付有価証券 42,200株
8289	O l y m p i cグループ	7,400	608.00	4,499,200	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	21,200	278.00	5,893,600	貸付有価証券 3,600株
9262	シルバーライフ	1,100	2,560.00	2,816,000	
9267	Genky DrugStores	6,300	2,012.00	12,675,600	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	1,233.00	2,959,200	
9277	総合メディカルホールディングス	12,600	2,080.00	26,208,000	貸付有価証券 2,100株(1,200株)
9278	ブックオフグループホールディングス	8,400	1,000.00	8,400,000	貸付有価証券 5,800株(3,300株)
9627	アインホールディングス	17,700	6,730.00	119,121,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
9828	元気寿司	3,600	3,330.00	11,988,000	

9831	ヤマダ電機	439,800	559.00	245,848,200	貸付有価証券 64,200株
9842	アークランドサカモト	22,600	1,224.00	27,662,400	
9843	ニトリホールディングス	62,500	17,385.00	1,086,562,500	貸付有価証券 18,900株
9850	グルメ杵屋	10,300	1,224.00	12,607,200	
9854	愛眼	11,500	257.00	2,955,500	貸付有価証券 3,500株
9856	ケーユーホールディングス	7,500	890.00	6,675,000	
9861	吉野家ホールディングス	47,400	2,550.00	120,870,000	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
9887	松屋フーズホールディングス	6,900	4,845.00	33,430,500	貸付有価証券 2,800株（700株）
9900	サガミホールディングス	19,300	1,406.00	27,135,800	
9919	関西スーパーマーケット	12,000	1,018.00	12,216,000	貸付有価証券 3,600株
9936	王将フードサービス	10,600	6,540.00	69,324,000	
9945	ブレナス	16,200	2,053.00	33,258,600	
9946	ミニストップ	10,700	1,584.00	16,948,800	貸付有価証券 4,300株（1,000株）
9948	アークス	29,500	1,984.00	58,528,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
9956	バローホールディングス	31,900	1,946.00	62,077,400	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
9966	藤久	1,200	717.00	860,400	
9974	ベルク	7,100	6,030.00	42,813,000	貸付有価証券 2,900株（700株）
9979	大庄	7,700	1,668.00	12,843,600	
9983	ファーストリテイリング	19,300	57,600.00	1,111,680,000	貸付有価証券 7,700株（7,600株）
9989	サンドラッグ	54,300	3,665.00	199,009,500	
9990	サックスパー ホールディングス	12,200	842.00	10,272,400	
9993	ヤマザワ	3,400	1,673.00	5,688,200	
9994	やまや	3,000	2,240.00	6,720,000	
9997	ベルーナ	31,000	643.00	19,933,000	貸付有価証券 12,300株（12,300株）
7150	島根銀行	2,900	657.00	1,905,300	
7161	じもとホールディングス	97,700	105.00	10,258,500	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	751,200	249.00	187,048,800	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,500	1,294.00	25,233,000	貸付有価証券 7,800株（1,900株）
7180	九州フィナンシャルグループ	237,200	460.00	109,112,000	貸付有価証券 71,700株
7182	ゆうちょ銀行	409,600	1,032.00	422,707,200	貸付有価証券 162,700株（162,700株）
7184	富山第一銀行	34,500	329.00	11,350,500	貸付有価証券 8,000株

7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	850,300	428.00	363,928,400	
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	98,600	744.00	73,358,400	貸付有価証券 29,600株
7321	関西みらいフィナンシャルグループ	84,800	619.00	52,491,200	貸付有価証券 58,800株(33,400株)
7322	三十三フィナンシャルグループ	13,400	1,610.00	21,574,000	貸付有価証券 3,200株
7327	第四北越フィナンシャルグループ	25,100	2,765.00	69,401,500	貸付有価証券 10,000株(2,400株)
8303	新生銀行	106,100	1,733.00	183,871,300	貸付有価証券 63,900株(42,100株)
8304	あおぞら銀行	86,100	3,050.00	262,605,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,951,600	570.60	5,678,382,960	貸付有価証券 1,673,600株
8308	りそなホールディングス	1,586,500	461.20	731,693,800	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	273,300	4,067.00	1,111,511,100	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	999,800	3,904.00	3,903,219,200	
8331	千葉銀行	497,200	613.00	304,783,600	貸付有価証券 216,700株(66,500株)
8334	群馬銀行	284,100	370.00	105,117,000	貸付有価証券 55,800株
8336	武蔵野銀行	21,500	1,740.00	37,410,000	
8337	千葉興業銀行	39,600	355.00	14,058,000	
8338	筑波銀行	60,100	215.00	12,921,500	貸付有価証券 28,100株(17,300株)
8341	七十七銀行	48,800	1,694.00	82,667,200	貸付有価証券 15,900株(1,200株)
8342	青森銀行	11,200	2,750.00	30,800,000	貸付有価証券 4,500株(1,100株)
8343	秋田銀行	9,300	2,044.00	19,009,200	貸付有価証券 2,400株
8344	山形銀行	16,200	1,448.00	23,457,600	貸付有価証券 4,900株
8345	岩手銀行	9,500	2,775.00	26,362,500	貸付有価証券 3,800株(900株)
8346	東邦銀行	129,300	256.00	33,100,800	貸付有価証券 51,400株(12,300株)
8349	東北銀行	6,900	1,041.00	7,182,900	
8350	みちのく銀行	9,300	1,428.00	13,280,400	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	121,800	1,946.00	237,022,800	貸付有価証券 48,500株(48,500株)
8355	静岡銀行	358,000	781.00	279,598,000	貸付有価証券 142,300株(142,300株)
8356	十六銀行	18,100	2,271.00	41,105,100	貸付有価証券 4,100株(1,700株)
8358	スルガ銀行	147,900	442.00	65,371,800	貸付有価証券 44,700株

8359	八十二銀行	348,900	431.00	150,375,900	貸付有価証券 138,700株（33,300株）
8360	山梨中央銀行	16,800	1,039.00	17,455,200	
8361	大垣共立銀行	28,600	2,321.00	66,380,600	貸付有価証券 11,400株（2,700株）
8362	福井銀行	12,400	1,635.00	20,274,000	貸付有価証券 3,900株（100株）
8363	北國銀行	14,900	3,210.00	47,829,000	貸付有価証券 10,400株（5,900株）
8364	清水銀行	6,000	2,121.00	12,726,000	貸付有価証券 100株（100株）
8365	富山銀行	2,800	2,195.00	6,146,000	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	29,000	2,678.00	77,662,000	貸付有価証券 11,500株（2,800株）
8367	南都銀行	24,000	2,644.00	63,456,000	貸付有価証券 7,200株
8368	百五銀行	130,100	336.00	43,713,600	貸付有価証券 31,900株
8369	京都銀行	51,800	4,520.00	234,136,000	貸付有価証券 20,600株（4,900株）
8370	紀陽銀行	51,200	1,609.00	82,380,800	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	96,200	1,084.00	104,280,800	貸付有価証券 38,200株（9,200株）
8379	広島銀行	213,400	540.00	115,236,000	貸付有価証券 80,300株（20,300株）
8381	山陰合同銀行	85,700	629.00	53,905,300	貸付有価証券 25,900株
8382	中国銀行	124,400	1,043.00	129,749,200	貸付有価証券 49,500株（11,900株）
8383	鳥取銀行	4,900	1,320.00	6,468,000	
8385	伊予銀行	206,300	580.00	119,654,000	貸付有価証券 81,700株（19,600株）
8386	百十四銀行	15,400	2,024.00	31,169,600	貸付有価証券 1,600株
8387	四国銀行	22,000	977.00	21,494,000	貸付有価証券 6,600株
8388	阿波銀行	23,600	2,514.00	59,330,400	貸付有価証券 9,300株（2,200株）
8392	大分銀行	8,300	2,562.00	21,264,600	貸付有価証券 3,300株（800株）
8393	宮崎銀行	9,600	2,486.00	23,865,600	貸付有価証券 2,900株
8395	佐賀銀行	8,800	1,581.00	13,912,800	貸付有価証券 2,600株
8397	沖縄銀行	13,200	3,615.00	47,718,000	貸付有価証券 5,300株（1,300株）
8399	琉球銀行	33,300	1,093.00	36,396,900	
8410	セブン銀行	482,900	330.00	159,357,000	

8411	みずほフィナンシャルグループ	19,644,100	162.80	3,198,059,480	貸付有価証券 1,873,600株 (1,873,600株)
8416	高知銀行	5,200	837.00	4,352,400	
8418	山口フィナンシャルグループ	180,400	686.00	123,754,400	貸付有価証券 54,500株
8521	長野銀行	4,700	1,526.00	7,172,200	貸付有価証券 1,400株
8522	名古屋銀行	11,700	3,330.00	38,961,000	貸付有価証券 3,500株
8524	北洋銀行	217,900	222.00	48,373,800	貸付有価証券 65,900株
8527	愛知銀行	5,200	3,385.00	17,602,000	貸付有価証券 1,600株
8530	中京銀行	5,900	2,241.00	13,221,900	貸付有価証券 1,800株
8537	大光銀行	5,000	1,673.00	8,365,000	貸付有価証券 3,100株(1,600株)
8541	愛媛銀行	20,200	1,138.00	22,987,600	貸付有価証券 6,100株
8542	トマト銀行	5,600	1,044.00	5,846,400	
8544	京葉銀行	61,600	600.00	36,960,000	貸付有価証券 18,600株
8550	栃木銀行	69,800	212.00	14,797,600	
8551	北日本銀行	4,500	2,171.00	9,769,500	貸付有価証券 1,300株
8558	東和銀行	25,400	821.00	20,853,400	貸付有価証券 4,600株
8562	福島銀行	13,600	238.00	3,236,800	貸付有価証券 600株(600株)
8563	大東銀行	7,500	637.00	4,777,500	貸付有価証券 100株(100株)
8600	トモニホールディングス	111,800	379.00	42,372,200	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	140,400	124.00	17,409,600	
8714	池田泉州ホールディングス	166,200	195.00	32,409,000	
7148	F P G	44,600	999.00	44,555,400	貸付有価証券 13,700株
7190	マーキュリアインベストメント	6,400	729.00	4,665,600	貸付有価証券 2,500株(600株)
8473	S B Iホールディングス	161,500	2,506.00	404,719,000	貸付有価証券 48,900株
8518	日本アジア投資	12,200	283.00	3,452,600	貸付有価証券 4,900株(1,200株)
8595	ジャフコ	22,200	5,000.00	111,000,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
8601	大和証券グループ本社	1,160,000	560.90	650,644,000	貸付有価証券 461,000株(461,000株)
8604	野村ホールディングス	2,543,700	544.30	1,384,535,910	貸付有価証券 1,010,800株(242,600株)

8609	岡三証券グループ	123,200	409.00	50,388,800	貸付有価証券 48,900株(11,700株)
8613	丸三証券	42,900	540.00	23,166,000	貸付有価証券 30,000株(17,000株)
8614	東洋証券	51,700	153.00	7,910,100	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	166,000	348.00	57,768,000	
8617	光世証券	3,500	605.00	2,117,500	貸付有価証券 2,500株(1,400株)
8622	水戸証券	41,800	231.00	9,655,800	貸付有価証券 29,200株(16,600株)
8624	いちよし証券	27,000	622.00	16,794,000	貸付有価証券 8,200株
8628	松井証券	82,600	895.00	73,927,000	貸付有価証券 57,400株(32,600株)
8692	だいこう証券ビジネス	7,000	696.00	4,872,000	貸付有価証券 300株
8698	マネックスグループ	109,100	245.00	26,729,500	貸付有価証券 77,100株(43,800株)
8706	極東証券	19,400	780.00	15,132,000	
8707	岩井コスモホールディングス	13,700	1,299.00	17,796,300	
8708	藍澤證券	26,000	746.00	19,396,000	貸付有価証券 7,800株
8732	マネーパートナーズグループ	15,400	232.00	3,572,800	貸付有価証券 6,100株(1,500株)
8739	スパークス・グループ	50,100	276.00	13,827,600	貸付有価証券 20,000株(4,800株)
8742	小林洋行	4,100	270.00	1,107,000	貸付有価証券 100株
7181	かんぽ生命保険	51,200	1,870.00	95,744,000	
8630	S O M P Oホールディングス	271,800	4,193.00	1,139,657,400	貸付有価証券 81,900株
8715	アニコム ホールディングス	12,000	4,050.00	48,600,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
8725	M S & A Dインシュアランスグループ ホール	378,000	3,697.00	1,397,466,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディング ス	118,800	2,657.00	315,651,600	貸付有価証券 42,300株(6,400株)
8750	第一生命ホールディングス	818,100	1,696.50	1,387,906,650	
8766	東京海上ホールディングス	517,000	6,144.00	3,176,448,000	
8795	T & Dホールディングス	432,100	1,230.00	531,483,000	
8798	アドバンスクリエイト	3,400	1,861.00	6,327,400	貸付有価証券 1,300株(300株)
7164	全国保証	40,700	4,725.00	192,307,500	貸付有価証券 16,200株(16,200株)
7187	ジェイリース	4,000	392.00	1,568,000	貸付有価証券 1,600株(400株)
7191	イントラスト	5,100	743.00	3,789,300	貸付有価証券 500株(500株)
7192	日本モーゲージサービス	2,900	1,999.00	5,797,100	

7196	C a s a	5,000	1,547.00	7,735,000	
7198	アルヒ	23,000	1,653.00	38,019,000	貸付有価証券 8,900株(2,100株)
7199	プレミアグループ	7,800	2,079.00	16,216,200	
8253	クレディセゾン	101,300	1,766.00	178,895,800	貸付有価証券 30,600株
8424	芙蓉総合リース	15,200	7,110.00	108,072,000	貸付有価証券 1,700株(200株)
8425	みずほリース	22,300	3,335.00	74,370,500	貸付有価証券 15,700株(8,900株)
8439	東京センチュリー	29,100	5,650.00	164,415,000	貸付有価証券 11,600株(2,800株)
8511	日本証券金融	63,700	514.00	32,741,800	
8515	アイフル	220,500	312.00	68,796,000	貸付有価証券 77,900株(77,900株)
8566	リコーリース	11,400	4,200.00	47,880,000	貸付有価証券 2,000株
8570	イオンフィナンシャルサービス	88,500	1,737.00	153,724,500	貸付有価証券 35,300株(8,500株)
8572	アコム	290,600	522.00	151,693,200	貸付有価証券 115,400株(27,700株)
8584	ジャックス	16,000	2,620.00	41,920,000	
8585	オリエントコーポレーション	391,000	165.00	64,515,000	貸付有価証券 10,800株(10,800株)
8586	日立キャピタル	34,100	3,005.00	102,470,500	貸付有価証券 10,300株
8589	アプラスフィナンシャル	69,400	86.00	5,968,400	貸付有価証券 21,000株
8591	オリックス	904,200	1,899.00	1,717,075,800	貸付有価証券 273,900株
8593	三菱UFJリース	366,900	702.00	257,563,800	貸付有価証券 110,200株
8596	九州リースサービス	7,100	601.00	4,267,100	貸付有価証券 2,200株
8697	日本取引所グループ	414,900	2,008.00	833,119,200	貸付有価証券 267,800株(164,400株)
8771	イー・ギャランティ	15,500	1,380.00	21,390,000	貸付有価証券 10,700株(6,100株)
8772	アサックス	7,500	724.00	5,430,000	
8793	NECキャピタルソリューション	5,900	2,456.00	14,490,400	貸付有価証券 1,800株
2337	いちご	184,000	426.00	78,384,000	
2353	日本駐車場開発	158,500	146.00	23,141,000	
2975	スター・マイカ・ホールディングス	7,500	1,661.00	12,457,500	貸付有価証券 2,300株
3003	ヒューリック	308,700	1,345.00	415,201,500	貸付有価証券 93,200株
3228	三栄建築設計	5,800	1,490.00	8,642,000	

3231	野村不動産ホールディングス	87,700	2,721.00	238,631,700	貸付有価証券 3,300株
3232	三重交通グループホールディングス	29,300	613.00	17,960,900	貸付有価証券 8,900株
3244	サムティ	20,500	1,862.00	38,171,000	貸付有価証券 8,200株(2,000株)
3245	ディア・ライフ	18,600	591.00	10,992,600	
3246	コーセーアールイー	4,200	616.00	2,587,200	貸付有価証券 400株(400株)
3250	エー・ディー・ワークス	268,200	28.00	7,509,600	
3252	日本商業開発	9,200	1,718.00	15,805,600	
3254	プレサンスコーポレーション	23,700	1,283.00	30,407,100	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
3258	ユニゾホールディングス	21,800	5,580.00	121,644,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
3271	THEグローバル社	6,800	454.00	3,087,200	貸付有価証券 700株(700株)
3275	ハウスコム	1,900	1,576.00	2,994,400	貸付有価証券 600株
3276	日本管理センター	9,500	1,379.00	13,100,500	
3277	サンセイランディック	4,200	887.00	3,725,400	
3280	エストラスト	2,000	873.00	1,746,000	貸付有価証券 600株
3284	フージャースホールディングス	28,800	698.00	20,102,400	貸付有価証券 8,700株
3288	オープンハウス	42,000	3,040.00	127,680,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
3289	東急不動産ホールディングス	393,100	798.00	313,693,800	貸付有価証券 118,700株
3291	飯田グループホールディングス	120,600	1,876.00	226,245,600	貸付有価証券 47,900株(11,500株)
3294	イーグランド	2,300	847.00	1,948,100	貸付有価証券 700株
3299	ムゲンエステート	10,000	699.00	6,990,000	
3452	ビーロッド	3,400	1,762.00	5,990,800	貸付有価証券 300株(300株)
3454	ファーストブラザーズ	3,300	1,209.00	3,989,700	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
3457	ハウスドゥ	7,100	1,327.00	9,421,700	貸付有価証券 2,400株
3458	シーアールイー	3,600	1,187.00	4,273,200	
3464	プロパティエージェント	2,300	1,219.00	2,803,700	貸付有価証券 900株(200株)
3465	ケイアイスター不動産	4,500	1,982.00	8,919,000	
3467	アグレ都市デザイン	2,300	526.00	1,209,800	貸付有価証券 500株
3475	グッドコムアセット	3,300	2,260.00	7,458,000	
3480	ジェイ・エス・ピー	1,500	5,320.00	7,980,000	貸付有価証券 500株
3484	テンポイノベーション	3,200	913.00	2,921,600	

3486	グローバル・リンク・マネジメント	2,400	609.00	1,461,600	貸付有価証券 900株(200株)
4666	パーク24	77,600	2,785.00	216,116,000	貸付有価証券 7,400株(7,400株)
4809	バラカ	3,700	2,022.00	7,481,400	貸付有価証券 2,600株(1,500株)
8801	三井不動産	713,000	2,982.00	2,126,166,000	貸付有価証券 218,700株
8802	三菱地所	1,012,900	2,186.00	2,214,199,400	貸付有価証券 305,900株
8803	平和不動産	26,500	3,340.00	88,510,000	貸付有価証券 8,000株
8804	東京建物	158,000	1,770.00	279,660,000	
8806	ダイビル	37,200	1,403.00	52,191,600	
8818	京阪神ビルディング	23,500	1,445.00	33,957,500	貸付有価証券 7,100株
8830	住友不動産	325,000	4,104.00	1,333,800,000	
8841	テーオーシー	28,400	913.00	25,929,200	貸付有価証券 5,600株(2,700株)
8842	東京楽天地	2,400	6,050.00	14,520,000	
8848	レオパレス21	189,400	326.00	61,744,400	貸付有価証券 75,100株(18,000株)
8850	スターツコーポレーション	19,700	2,659.00	52,382,300	貸付有価証券 7,300株(1,900株)
8860	フジ住宅	16,800	681.00	11,440,800	貸付有価証券 5,100株
8864	空港施設	14,500	548.00	7,946,000	
8869	明和地所	7,900	620.00	4,898,000	
8871	ゴールドクレスト	11,400	1,952.00	22,252,800	貸付有価証券 4,500株(1,100株)
8877	エスリード	5,600	1,923.00	10,768,800	
8881	日神グループホールディングス	21,400	553.00	11,834,200	
8892	日本エスコン	26,200	945.00	24,759,000	貸付有価証券 9,700株(1,800株)
8897	タカラレーベン	66,100	503.00	33,248,300	貸付有価証券 20,000株
8904	AVANTIA	8,100	1,004.00	8,132,400	
8905	イオンモール	72,500	1,876.00	136,010,000	貸付有価証券 7,300株
8908	毎日コムネット	3,700	940.00	3,478,000	
8917	ファースト住建	6,200	1,243.00	7,706,600	貸付有価証券 1,900株
8918	ランド	786,900	11.00	8,655,900	貸付有価証券 234,800株
8919	カチタス	17,900	4,580.00	81,982,000	貸付有価証券 7,100株(1,700株)
8923	トーセイ	19,900	1,403.00	27,919,700	
8928	穴吹興産	3,100	1,769.00	5,483,900	

8934	サンフロンティア不動産	20,000	1,232.00	24,640,000	貸付有価証券 6,000株
8935	エフ・ジェー・ネクスト	12,600	1,168.00	14,716,800	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
8940	インテリックス	4,100	722.00	2,960,200	
8944	ランドビジネス	6,100	777.00	4,739,700	貸付有価証券 1,100株(600株)
8945	日本社宅サービス	3,300	1,111.00	3,666,300	
8999	グランディハウス	11,200	503.00	5,633,600	
9706	日本空港ビルデング	46,100	5,610.00	258,621,000	貸付有価証券 32,200株(18,300株)
1954	日本工営	9,400	3,635.00	34,169,000	貸付有価証券 3,700株(900株)
2120	L I F U L L	48,900	588.00	28,753,200	貸付有価証券 14,700株(4,700株)
2124	ジェイエイシーリクルートメント	9,400	1,708.00	16,055,200	
2127	日本M&Aセンター	105,800	3,680.00	389,344,000	貸付有価証券 10,100株(10,100株)
2130	メンバーズ	4,100	1,913.00	7,843,300	
2139	中広	1,400	546.00	764,400	貸付有価証券 500株
2146	UTグループ	16,500	2,858.00	47,157,000	
2148	アイティメディア	4,200	977.00	4,103,400	貸付有価証券 1,300株
2151	タケエイ	13,400	1,070.00	14,338,000	
2153	E・Jホールディングス	2,500	1,725.00	4,312,500	
2154	ビーネックスグループ	17,400	1,142.00	19,870,800	
2157	コシダカホールディングス	33,700	1,525.00	51,392,500	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
2163	アルトナー	3,400	832.00	2,828,800	貸付有価証券 300株(300株)
2168	パソナグループ	15,200	1,447.00	21,994,400	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
2169	C D S	3,500	1,485.00	5,197,500	
2170	リンクアンドモチベーション	30,900	542.00	16,747,800	
2174	G C A	16,900	931.00	15,733,900	
2175	エス・エム・エス	43,600	2,351.00	102,503,600	貸付有価証券 30,800株(17,500株)
2180	サニーサイドアップグループ	3,600	1,067.00	3,841,200	
2181	パーソルホールディングス	140,000	2,115.00	296,100,000	貸付有価証券 55,700株(13,400株)
2183	リニカル	6,800	1,080.00	7,344,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
2193	クックパッド	48,900	329.00	16,088,100	
2196	エスクリ	4,400	768.00	3,379,200	
2198	アイ・ケイ・ケイ	6,800	725.00	4,930,000	
2301	学情	5,000	2,379.00	11,895,000	貸付有価証券 1,500株

2305	スタジオアリス	7,000	1,925.00	13,475,000	
2309	シミックホールディングス	7,800	1,705.00	13,299,000	貸付有価証券 2,400株
2311	エプコ	2,200	1,311.00	2,884,200	
2325	N J S	3,100	1,804.00	5,592,400	
2331	総合警備保障	55,700	5,690.00	316,933,000	貸付有価証券 20,400株(3,600株)
2371	カカクコム	104,900	2,929.00	307,252,100	貸付有価証券 31,700株
2372	アイロムグループ	4,900	1,436.00	7,036,400	貸付有価証券 2,000株(500株)
2374	セントケア・ホールディング	9,000	472.00	4,248,000	
2376	サイネックス	2,400	681.00	1,634,400	
2378	ルネサンス	7,800	1,768.00	13,790,400	
2379	ディップ	19,700	3,445.00	67,866,500	貸付有価証券 7,900株(1,900株)
2389	オプトホールディング	7,600	1,602.00	12,175,200	
2395	新日本科学	15,200	630.00	9,576,000	貸付有価証券 4,600株
2398	ツクイ	33,000	571.00	18,843,000	
2410	キャリアデザインセンター	3,500	1,225.00	4,287,500	
2412	ベネフィット・ワン	38,200	2,016.00	77,011,200	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
2413	エムスリー	308,800	3,220.00	994,336,000	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	8,900	584.00	5,197,600	
2424	プラス	1,600	784.00	1,254,400	
2427	アウトソーシング	80,100	1,034.00	82,823,400	貸付有価証券 31,800株(7,600株)
2428	ウェルネット	14,100	700.00	9,870,000	
2429	ワールドホールディングス	4,600	1,705.00	7,843,000	
2432	ディー・エヌ・エー	68,600	1,769.00	121,353,400	貸付有価証券 27,500株(6,600株)
2433	博報堂D Yホールディングス	194,800	1,572.00	306,225,600	貸付有価証券 77,400株(77,400株)
2440	ぐるなび	24,400	898.00	21,911,200	貸付有価証券 9,500株(9,500株)
2445	タカミヤ	14,800	642.00	9,501,600	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
2453	ジャパンベストレスキューシステム	9,500	966.00	9,177,000	貸付有価証券 3,800株(900株)
2461	ファンコミュニケーションズ	38,500	455.00	17,517,500	貸付有価証券 11,700株
2462	ライク	4,600	1,860.00	8,556,000	貸付有価証券 2,200株(500株)
2464	ビジネス・ブレークスルー	5,800	400.00	2,320,000	貸付有価証券 1,700株

2471	エスプール	27,000	860.00	23,220,000	貸付有価証券 8,200株
2475	W D Bホールディングス	6,400	2,647.00	16,940,800	貸付有価証券 2,500株(600株)
2485	ティア	8,200	604.00	4,952,800	貸付有価証券 700株
2487	C D G	1,500	1,437.00	2,155,500	貸付有価証券 500株(100株)
2491	バリューコマース	7,800	2,651.00	20,677,800	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
2492	インフォーマート	153,500	888.00	136,308,000	貸付有価証券 14,600株(14,600株)
2749	J Pホールディングス	44,000	322.00	14,168,000	
3521	エコナックホールディングス	25,300	150.00	3,795,000	貸付有価証券 7,600株
4282	E P Sホールディングス	21,100	1,269.00	26,775,900	
4286	レッグス	3,500	1,550.00	5,425,000	貸付有価証券 300株(300株)
4290	プレステージ・インターナショナル	52,400	1,008.00	52,819,200	貸付有価証券 6,300株(5,000株)
4301	アミューズ	7,600	2,841.00	21,591,600	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
4310	ドリームインキュベータ	4,300	1,768.00	7,602,400	
4318	クイック	8,700	1,487.00	12,936,900	
4319	T A C	8,400	214.00	1,797,600	貸付有価証券 2,500株
4321	ケネディクス	130,500	562.00	73,341,000	
4324	電通グループ	144,400	3,680.00	531,392,000	貸付有価証券 13,800株(13,800株)
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	5,300	1,025.00	5,432,500	貸付有価証券 1,600株
4337	ぴあ	4,000	4,375.00	17,500,000	貸付有価証券 2,800株(1,600株)
4343	イオンファンタジー	5,400	2,346.00	12,668,400	
4345	シーティーエス	15,800	705.00	11,139,000	貸付有価証券 6,300株(1,500株)
4346	ネクシィーズグループ	4,900	1,765.00	8,648,500	貸付有価証券 3,400株(1,900株)
4544	みらかホールディングス	39,200	2,942.00	115,326,400	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
4641	アルプス技研	12,400	1,850.00	22,940,000	
4651	サニックス	24,500	334.00	8,183,000	貸付有価証券 17,100株(9,700株)
4653	ダイオーズ	2,800	1,386.00	3,880,800	
4658	日本空調サービス	14,700	760.00	11,172,000	
4661	オリエンタルランド	149,000	14,550.00	2,167,950,000	貸付有価証券 56,800株(14,300株)
4665	ダスキン	36,000	3,035.00	109,260,000	貸付有価証券 25,200株(14,300株)

4668	明光ネットワークジャパン	16,400	941.00	15,432,400	貸付有価証券 5,000株
4671	ファルコホールディングス	7,700	2,145.00	16,516,500	
4678	秀英予備校	3,100	457.00	1,416,700	
4679	田谷	2,600	618.00	1,606,800	
4680	ラウンドワン	39,100	1,032.00	40,351,200	貸付有価証券 15,600株(3,700株)
4681	リゾートトラスト	64,200	1,789.00	114,853,800	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
4694	ビー・エム・エル	18,000	3,145.00	56,610,000	
4696	ワタベウェディング	2,300	539.00	1,239,700	貸付有価証券 600株
4708	りらいあコミュニケーションズ	25,300	1,440.00	36,432,000	
4714	リソー教育	64,000	372.00	23,808,000	貸付有価証券 19,400株
4718	早稲田アカデミー	4,600	1,078.00	4,958,800	
4732	ユー・エス・エス	156,800	1,996.00	312,972,800	貸付有価証券 1,400株
4745	東京個別指導学院	4,900	704.00	3,449,600	
4751	サイバーエージェント	80,500	4,415.00	355,407,500	貸付有価証券 24,300株
4755	楽天	652,800	869.00	567,283,200	貸付有価証券 259,500株(62,300株)
4763	クリーク・アンド・リバー社	7,200	1,059.00	7,624,800	貸付有価証券 2,200株
4767	テー・オー・ダブリュー	11,100	950.00	10,545,000	
4792	山田コンサルティンググループ	6,800	1,518.00	10,322,400	貸付有価証券 2,000株
4801	セントラルスポーツ	5,200	3,055.00	15,886,000	
4848	フルキャストホールディングス	14,000	2,423.00	33,922,000	
4849	エン・ジャパン	24,900	4,630.00	115,287,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
5261	リソルホールディングス	1,500	4,180.00	6,270,000	
6028	テクノプロ・ホールディングス	28,000	7,700.00	215,600,000	貸付有価証券 3,400株(2,100株)
6029	アトラ	3,200	308.00	985,600	貸付有価証券 300株(300株)
6032	インターワークス	2,700	552.00	1,490,400	
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	5,700	5,740.00	32,718,000	
6036	Ke e P e r 技研	5,100	1,254.00	6,395,400	貸付有価証券 500株(500株)
6037	ファーストロジック	3,200	603.00	1,929,600	貸付有価証券 1,300株(300株)
6044	三機サービス	2,700	1,075.00	2,902,500	貸付有価証券 1,200株(300株)
6047	G u n o s y	8,700	1,221.00	10,622,700	貸付有価証券 3,900株(900株)

6048	デザインワン・ジャパン	2,800	307.00	859,600	
6050	イー・ガーディアン	7,100	2,249.00	15,967,900	貸付有価証券 2,200株
6054	リブセンス	9,000	287.00	2,583,000	貸付有価証券 6,300株(3,600株)
6055	ジャパンマテリアル	43,100	1,657.00	71,416,700	
6058	ベクトル	17,500	1,281.00	22,417,500	
6059	ウチヤマホールディングス	6,900	511.00	3,525,900	貸付有価証券 800株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	11,900	905.00	10,769,500	貸付有価証券 3,600株(800株)
6065	ライクキッズ	2,400	843.00	2,023,200	
6070	キャリアリンク	4,600	589.00	2,709,400	
6071	I B J	9,600	1,268.00	12,172,800	
6073	アサンテ	5,600	1,970.00	11,032,000	
6077	N・フィールド	9,600	624.00	5,990,400	
6078	バリューHR	2,800	3,055.00	8,554,000	貸付有価証券 200株(200株)
6080	M & Aキャピタルパートナーズ	9,900	3,770.00	37,323,000	
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	1,863.00	9,873,900	
6083	E R Iホールディングス	3,900	777.00	3,030,300	貸付有価証券 2,700株(1,500株)
6087	アピスト	2,200	2,614.00	5,750,800	
6088	シグマクシス	9,600	1,880.00	18,048,000	
6089	ウィルグループ	9,100	1,104.00	10,046,400	
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	19,300	219.00	4,226,700	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	1,003,300	4,450.00	4,464,685,000	貸付有価証券 398,700株(95,700株)
6099	エラン	8,300	1,701.00	14,118,300	貸付有価証券 3,300株(800株)
6171	土木管理総合試験所	6,100	424.00	2,586,400	
6175	ネットマーケティング	4,000	1,022.00	4,088,000	
6178	日本郵政	1,148,000	1,020.50	1,171,534,000	
6183	ベルシステム24ホールディングス	23,500	1,550.00	36,425,000	
6184	鎌倉新書	10,500	1,657.00	17,398,500	貸付有価証券 3,200株
6185	S M N	2,200	888.00	1,953,600	貸付有価証券 200株(200株)
6186	一蔵	1,500	674.00	1,011,000	
6187	L I T A L I C O	4,800	2,757.00	13,233,600	貸付有価証券 1,400株
6189	グローバルキッズCOMPANY	2,100	808.00	1,696,800	貸付有価証券 100株(100株)
6191	エアトリ	6,200	1,612.00	9,994,400	貸付有価証券 2,500株(600株)

6194	アトラエ	3,600	3,725.00	13,410,000	
6196	ストライク	5,300	4,885.00	25,890,500	
6197	ソラスト	38,600	1,158.00	44,698,800	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
6199	セラク	4,400	1,221.00	5,372,400	
6200	インソース	6,800	3,335.00	22,678,000	
6532	ペイカレント・コンサルティング	8,500	8,140.00	69,190,000	
6533	Orchestra Holdings	2,900	1,215.00	3,523,500	貸付有価証券 800株
6535	アイモバイル	4,400	686.00	3,018,400	貸付有価証券 1,300株
6538	キャリアインデックス	5,700	385.00	2,194,500	貸付有価証券 2,200株(500株)
6539	MS - Japan	4,500	1,427.00	6,421,500	
6540	船場	2,300	1,033.00	2,375,900	
6541	グレイステクノロジー	6,400	2,807.00	17,964,800	貸付有価証券 600株(600株)
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	14,800	2,456.00	36,348,800	貸付有価証券 5,800株(1,400株)
6546	フルテック	2,000	1,273.00	2,546,000	
6547	グリーンズ	3,500	943.00	3,300,500	
6551	ツナググループ・ホールディングス	1,700	713.00	1,212,100	
6552	GameWith	3,100	733.00	2,272,300	貸付有価証券 300株(300株)
6553	ソウルドアウト	2,100	2,148.00	4,510,800	貸付有価証券 600株
6555	MS&Consulting	2,000	1,044.00	2,088,000	
6564	ミダック	1,340	1,331.00	1,783,540	
6569	日総工産	9,300	1,015.00	9,439,500	
6571	キュービーネットホールディングス	5,800	2,298.00	13,328,400	
6572	RPAホールディングス	7,900	1,065.00	8,413,500	貸付有価証券 3,200株(800株)
7030	スプリックス	4,700	1,116.00	5,245,200	貸付有価証券 1,400株
7033	マネジメントソリューションズ	1,500	3,735.00	5,602,500	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	7,100	953.00	6,766,300	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	76,600	3,060.00	234,396,000	貸付有価証券 30,400株(30,400株)
8920	東祥	8,700	2,139.00	18,609,300	貸付有価証券 800株(800株)
9603	エイチ・アイ・エス	21,800	2,673.00	58,271,400	貸付有価証券 8,700株(8,700株)
9612	ラックランド	3,200	2,191.00	7,011,200	貸付有価証券 1,100株(300株)
9616	共立メンテナンス	23,200	4,695.00	108,924,000	貸付有価証券 16,200株(9,200株)
9619	イチネンホールディングス	15,700	1,512.00	23,738,400	貸付有価証券 6,200株(6,200株)

9621	建設技術研究所	9,700	2,437.00	23,638,900	
9622	スペース	9,100	1,223.00	11,129,300	貸付有価証券 2,800株
9624	長大	5,100	1,221.00	6,227,100	
9628	燦ホールディングス	6,100	1,496.00	9,125,600	
9632	スバル興業	800	9,380.00	7,504,000	
9633	東京テアトル	5,500	1,372.00	7,546,000	
9644	タナベ経営	2,700	1,294.00	3,493,800	
9663	ナガワ	4,500	6,940.00	31,230,000	貸付有価証券 1,700株(400株)
9671	よみうりランド	3,000	4,455.00	13,365,000	
9672	東京都競馬	9,200	3,150.00	28,980,000	
9675	常磐興産	5,600	1,678.00	9,396,800	
9678	カナモト	22,900	2,752.00	63,020,800	
9681	東京ドーム	56,700	1,033.00	58,571,100	
9699	西尾レントオール	14,200	2,967.00	42,131,400	
9704	アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	89,700	30.00	2,691,000	貸付有価証券 23,200株
9715	トランス・コスモス	13,300	2,857.00	37,998,100	
9716	乃村工藝社	60,000	1,293.00	77,580,000	貸付有価証券 42,100株(23,900株)
9722	藤田観光	6,100	2,702.00	16,482,200	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
9726	KNT-CTホールディングス	8,700	1,322.00	11,501,400	貸付有価証券 2,600株
9728	日本管財	15,000	1,915.00	28,725,000	
9729	トーカイ	13,500	2,734.00	36,909,000	貸付有価証券 5,300株(1,300株)
9731	白洋舎	1,600	2,817.00	4,507,200	貸付有価証券 300株
9735	セコム	148,600	9,690.00	1,439,934,000	貸付有価証券 44,900株
9740	セントラル警備保障	6,700	6,020.00	40,334,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
9743	丹青社	26,400	1,248.00	32,947,200	
9744	メイテック	17,300	6,190.00	107,087,000	貸付有価証券 5,200株
9755	応用地質	15,100	1,406.00	21,230,600	
9757	船井総研ホールディングス	28,900	2,924.00	84,503,600	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
9760	進学会ホールディングス	5,500	512.00	2,816,000	貸付有価証券 1,200株
9765	オオバ	10,100	805.00	8,130,500	
9768	いであ	2,600	2,173.00	5,649,800	貸付有価証券 200株(200株)
9769	学究社	4,100	1,424.00	5,838,400	
9783	ベネッセホールディングス	46,700	3,045.00	142,201,500	

9787	イオンディライト	17,300	3,825.00	66,172,500	貸付有価証券 6,900株(1,700株)
9788	ナック	7,700	1,071.00	8,246,700	貸付有価証券 2,400株
9792	ニチイ学館	19,900	1,522.00	30,287,800	貸付有価証券 6,000株
9793	ダイセキ	23,500	3,015.00	70,852,500	貸付有価証券 7,100株
9795	ステップ	5,100	1,665.00	8,491,500	
合 計		173,489,740		351,446,643,310	

(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MUFJ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。

J P X日経400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 2月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	202,352,483
株式	6,338,270,530
派生商品評価勘定	2,540,250
未収配当金	11,227,900
前払金	384,000
差入委託証拠金	6,162,500
流動資産合計	6,560,937,663
資産合計	6,560,937,663
負債の部	
流動負債	
未払金	569,900
未払解約金	30,743,687
未払利息	69
流動負債合計	31,313,656
負債合計	31,313,656
純資産の部	
元本等	
元本	4,146,501,765

[令和 2年 2月 5日現在]

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,383,122,242
元本等合計	6,529,624,007
純資産合計	6,529,624,007
負債純資産合計	6,560,937,663

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 2年 2月 5日現在]
1. 期首	平成31年 2月 6日
期首元本額	5,280,574,800円
期中追加設定元本額	1,213,644,486円
期中一部解約元本額	2,347,717,521円
元本の内訳	
国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用）	831,141円
eMAXIS J P X日経400インデックス	3,647,184,601円
J P X日経400インデックスファンド（ラップ向け）	22,179,028円
国内株式セレクション（ラップ向け）	414,354,942円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	8,720,772円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	53,231,281円
合計	4,146,501,765円
2. 受益権の総数	4,146,501,765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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5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。

区分	自 平成31年 2月 6日 至 令和 2年 2月 5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、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>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 2月 5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おります。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	718,069
合計	718,069

(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 2月 5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	188,571,000		191,125,000	2,554,000
	合計	188,571,000		191,125,000	2,554,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.5747円
(1万口当たり純資産額)	(15,747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	
1332	日本水産	4,600	618.00	2,842,800	
1333	マル八二チ口	700	2,596.00	1,817,200	
1605	国際石油開発帝石	18,600	1,047.50	19,483,500	
1719	安藤・間	2,800	908.00	2,542,400	

1720	東急建設	1,400	769.00	1,076,600	
1721	コムシスホールディングス	1,600	3,120.00	4,992,000	
1801	大成建設	3,600	4,470.00	16,092,000	
1802	大林組	10,700	1,226.00	13,118,200	
1803	清水建設	10,900	1,135.00	12,371,500	
1808	長谷工コーポレーション	4,100	1,433.00	5,875,300	
1812	鹿島建設	8,400	1,431.00	12,020,400	
1820	西松建設	800	2,477.00	1,981,600	
1821	三井住友建設	2,600	627.00	1,630,200	
1824	前田建設工業	2,700	1,063.00	2,870,100	
1860	戸田建設	4,400	732.00	3,220,800	
1861	熊谷組	500	3,215.00	1,607,500	
1878	大東建託	1,300	12,770.00	16,601,000	
1881	N I P P O	900	2,700.00	2,430,000	
1893	五洋建設	4,200	676.00	2,839,200	
1911	住友林業	2,700	1,624.00	4,384,800	
1925	大和ハウス工業	10,600	3,535.00	37,471,000	
1928	積水ハウス	11,700	2,375.00	27,787,500	
1951	協和エクシオ	1,600	2,735.00	4,376,000	
1959	九電工	800	3,255.00	2,604,000	
2201	森永製菓	800	5,280.00	4,224,000	
2206	江崎グリコ	1,000	4,880.00	4,880,000	
2229	カルビー	1,600	3,685.00	5,896,000	
2267	ヤクルト本社	2,400	5,750.00	13,800,000	
2269	明治ホールディングス	2,300	7,790.00	17,917,000	
2282	日本ハム	1,300	4,860.00	6,318,000	
2502	アサヒグループホールディングス	7,200	5,061.00	36,439,200	
2503	キリンホールディングス	14,500	2,463.00	35,713,500	
2587	サントリー食品インターナショナル	2,300	4,750.00	10,925,000	
2801	キッコーマン	2,500	5,670.00	14,175,000	
2802	味の素	7,600	1,947.00	14,797,200	
2809	キューピー	1,900	2,241.00	4,257,900	
2815	アリアケジャパン	300	7,420.00	2,226,000	
2871	ニチレイ	1,600	2,831.00	4,529,600	
2875	東洋水産	1,800	4,725.00	8,505,000	
2897	日清食品ホールディングス	1,500	8,830.00	13,245,000	
2914	日本たばこ産業	19,800	2,298.00	45,500,400	
3401	帝人	2,700	2,026.00	5,470,200	
3402	東レ	24,200	724.10	17,523,220	
8111	ゴールドウイン	600	6,650.00	3,990,000	
3861	王子ホールディングス	14,000	591.00	8,274,000	
3405	クラレ	5,300	1,337.00	7,086,100	

3407	旭化成	22,200	1,151.00	25,552,200
4004	昭和電工	2,400	2,682.00	6,436,800
4005	住友化学	24,600	454.00	11,168,400
4021	日産化学	1,900	4,660.00	8,854,000
4042	東ソー	5,200	1,659.00	8,626,800
4043	トクヤマ	1,000	2,784.00	2,784,000
4061	デンカ	1,200	3,010.00	3,612,000
4063	信越化学工業	5,700	13,095.00	74,641,500
4088	エア・ウォーター	3,100	1,551.00	4,808,100
4091	大陽日酸	3,200	2,453.00	7,849,600
4182	三菱瓦斯化学	3,200	1,665.00	5,328,000
4183	三井化学	3,000	2,561.00	7,683,000
4185	J S R	3,100	2,053.00	6,364,300
4188	三菱ケミカルホールディングス	22,300	806.60	17,987,180
4202	ダイセル	4,600	1,012.00	4,655,200
4204	積水化学工業	7,200	1,841.00	13,255,200
4206	アイカ工業	1,000	3,465.00	3,465,000
4208	宇部興産	1,700	2,190.00	3,723,000
4217	日立化成	1,500	4,600.00	6,900,000
4246	ダイキョーニシカワ	700	778.00	544,600
4403	日油	1,300	3,595.00	4,673,500
4452	花王	8,200	8,581.00	70,364,200
4612	日本ペイントホールディングス	2,800	5,500.00	15,400,000
4613	関西ペイント	3,800	2,588.00	9,834,400
4631	D I C	1,400	2,922.00	4,090,800
4911	資生堂	6,800	7,035.00	47,838,000
4912	ライオン	4,400	2,067.00	9,094,800
4922	コーセー	600	14,550.00	8,730,000
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	1,500	2,394.00	3,591,000
4967	小林製薬	1,000	8,810.00	8,810,000
6988	日東電工	2,400	6,210.00	14,904,000
7988	ニフコ	1,300	2,881.00	3,745,300
8113	ユニ・チャーム	6,600	3,700.00	24,420,000
4151	協和キリン	3,400	2,638.00	8,969,200
4502	武田薬品工業	21,800	4,328.00	94,350,400
4503	アステラス製薬	30,000	1,884.00	56,520,000
4506	大日本住友製薬	2,500	1,836.00	4,590,000
4507	塩野義製薬	4,400	6,465.00	28,446,000
4516	日本新薬	900	9,840.00	8,856,000
4519	中外製薬	3,600	11,690.00	42,084,000
4521	科研製薬	600	5,950.00	3,570,000
4523	エーザイ	4,100	9,042.00	37,072,200

4528	小野薬品工業	7,800	2,626.50	20,486,700	
4530	久光製薬	900	5,640.00	5,076,000	
4536	参天製薬	6,400	2,069.00	13,241,600	
4555	沢井製薬	700	7,300.00	5,110,000	
4568	第一三共	9,800	7,900.00	77,420,000	
4578	大塚ホールディングス	6,500	4,948.00	32,162,000	
4587	ペプチドリーム	1,700	5,360.00	9,112,000	
5019	出光興産	3,800	2,767.00	10,514,600	
5020	J X T Gホールディングス	51,300	467.90	24,003,270	
5021	コスモエネルギーホールディングス	1,000	2,126.00	2,126,000	
5101	横浜ゴム	2,000	1,886.00	3,772,000	
5108	ブリヂストン	10,500	3,941.00	41,380,500	
5110	住友ゴム工業	3,100	1,233.00	3,822,300	
5201	A G C	3,400	3,725.00	12,665,000	
5233	太平洋セメント	2,200	3,000.00	6,600,000	
5301	東海カーボン	3,600	1,020.00	3,672,000	
5332	T O T O	2,400	4,870.00	11,688,000	
5333	日本碍子	4,200	1,853.00	7,782,600	
5334	日本特殊陶業	2,700	1,917.00	5,175,900	
5393	ニチアス	900	2,647.00	2,382,300	
5401	日本製鉄	15,100	1,525.00	23,027,500	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	9,100	1,313.00	11,948,300	
5486	日立金属	3,600	1,773.00	6,382,800	
5703	日本軽金属ホールディングス	8,500	212.00	1,802,000	
5713	住友金属鉱山	4,300	3,193.00	13,729,900	
5714	D O W Aホールディングス	900	3,985.00	3,586,500	
5801	古河電気工業	1,000	2,632.00	2,632,000	
5802	住友電気工業	12,600	1,475.50	18,591,300	
3436	S U M C O	4,000	1,728.00	6,912,000	
5929	三和ホールディングス	3,200	1,196.00	3,827,200	
5947	リンナイ	700	7,830.00	5,481,000	
5975	東プレ	600	1,709.00	1,025,400	
6113	アマダホールディングス	4,300	1,172.00	5,039,600	
6136	オーエスジー	1,600	1,866.00	2,985,600	
6141	D M G 森精機	2,100	1,592.00	3,343,200	
6146	ディスコ	500	26,010.00	13,005,000	
6268	ナブテスコ	2,000	3,140.00	6,280,000	
6269	三井海洋開発	400	2,532.00	1,012,800	
6273	S M C	1,100	48,990.00	53,889,000	
6301	小松製作所	15,500	2,413.00	37,401,500	
6302	住友重機械工業	2,000	2,863.00	5,726,000	
6305	日立建機	1,400	2,997.00	4,195,800	

6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	700	5,170.00	3,619,000	
6326	クボタ	18,100	1,776.00	32,145,600	
6367	ダイキン工業	4,300	15,780.00	67,854,000	
6383	ダイフク	1,700	6,710.00	11,407,000	
6432	竹内製作所	600	1,916.00	1,149,600	
6463	T P R	500	1,815.00	907,500	
6471	日本精工	6,400	939.00	6,009,600	
6473	ジェイテクト	3,300	1,181.00	3,897,300	
6481	T H K	2,000	2,840.00	5,680,000	
6586	マキタ	4,400	4,175.00	18,370,000	
7011	三菱重工業	5,700	4,038.00	23,016,600	
7013	I H I	2,500	2,647.00	6,617,500	
4902	コニカミノルタ	7,500	679.00	5,092,500	
6448	ブラザー工業	4,200	2,256.00	9,475,200	
6479	ミネベアミツミ	6,300	2,276.00	14,338,800	
6501	日立製作所	16,400	4,105.00	67,322,000	
6503	三菱電機	34,100	1,598.00	54,491,800	
6504	富士電機	2,100	3,470.00	7,287,000	
6506	安川電機	3,700	3,890.00	14,393,000	
6588	東芝テック	400	4,440.00	1,776,000	
6594	日本電産	4,100	14,175.00	58,117,500	
6641	日新電機	800	1,185.00	948,000	
6645	オムロン	3,100	6,650.00	20,615,000	
6701	日本電気	4,100	5,040.00	20,664,000	
6702	富士通	3,300	12,705.00	41,926,500	
6723	ルネサスエレクトロニクス	16,300	721.00	11,752,300	
6724	セイコーエプソン	4,200	1,708.00	7,173,600	
6728	アルバック	600	4,190.00	2,514,000	
6750	エレコム	400	4,470.00	1,788,000	
6752	パナソニック	39,000	1,235.00	48,165,000	
6755	富士通ゼネラル	900	2,478.00	2,230,200	
6758	ソニー	14,600	7,659.00	111,821,400	
6762	T D K	1,600	11,820.00	18,912,000	
6770	アルプスアルパイン	3,000	1,915.00	5,745,000	
6806	ヒロセ電機	500	14,010.00	7,005,000	
6841	横河電機	3,100	1,985.00	6,153,500	
6845	アズビル	2,200	3,020.00	6,644,000	
6849	日本光電工業	1,400	3,350.00	4,690,000	
6856	堀場製作所	700	7,040.00	4,928,000	
6857	アドバンテスト	2,500	5,730.00	14,325,000	
6861	キーエンス	2,400	37,710.00	90,504,000	
6869	シスメックス	2,400	8,039.00	19,293,600	

6877	O B A R A G R O U P	200	3,545.00	709,000	
6920	レーザーテック	1,500	5,180.00	7,770,000	
6923	スタンレー電気	2,400	2,932.00	7,036,800	
6952	カシオ計算機	3,000	2,021.00	6,063,000	
6954	ファナック	3,200	20,355.00	65,136,000	
6965	浜松ホトニクス	2,400	4,715.00	11,316,000	
6971	京セラ	4,800	7,199.00	34,555,200	
6976	太陽誘電	1,500	3,375.00	5,062,500	
6981	村田製作所	10,000	6,446.00	64,460,000	
7276	小糸製作所	2,000	4,905.00	9,810,000	
7735	S C R E E Nホールディングス	600	6,410.00	3,846,000	
7751	キャノン	18,400	2,875.50	52,909,200	
8035	東京エレクトロン	2,300	24,590.00	56,557,000	
3116	トヨタ紡織	1,000	1,650.00	1,650,000	
6201	豊田自動織機	2,800	6,080.00	17,024,000	
6902	デンソー	7,500	4,500.00	33,750,000	
7012	川崎重工業	2,700	2,166.00	5,848,200	
7202	いすゞ自動車	9,900	1,090.50	10,795,950	
7203	トヨタ自動車	13,100	7,715.00	101,066,500	
7205	日野自動車	4,300	1,017.00	4,373,100	
7259	アイシン精機	2,800	3,720.00	10,416,000	
7261	マツダ	10,000	941.00	9,410,000	
7267	本田技研工業	26,900	2,849.00	76,638,100	
7269	スズキ	6,800	5,003.00	34,020,400	
7270	S U B A R U	10,600	2,688.00	28,492,800	
7272	ヤマハ発動機	4,400	2,063.00	9,077,200	
7282	豊田合成	1,100	2,378.00	2,615,800	
7309	シマノ	1,300	17,300.00	22,490,000	
7313	テイ・エス テック	800	3,080.00	2,464,000	
4543	テルモ	9,700	3,941.00	38,227,700	
7701	島津製作所	4,100	3,120.00	12,792,000	
7717	ブイ・テクノロジー	200	5,030.00	1,006,000	
7729	東京精密	600	3,985.00	2,391,000	
7731	ニコン	5,500	1,332.00	7,326,000	
7733	オリンパス	18,900	1,830.00	34,587,000	
7741	H O Y A	6,800	10,120.00	68,816,000	
7747	朝日インテック	3,900	3,005.00	11,719,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	3,500	6,584.00	23,044,000	
7846	パイロットコーポレーション	600	4,465.00	2,679,000	
7867	タカラトミー	1,500	1,185.00	1,777,500	
7951	ヤマハ	2,000	5,730.00	11,460,000	
7956	ビジョン	2,100	3,920.00	8,232,000	

7974	任天堂	2,100	40,430.00	84,903,000	
9502	中部電力	10,400	1,557.00	16,192,800	
9503	関西電力	12,900	1,289.00	16,628,100	
9506	東北電力	8,500	1,044.00	8,874,000	
9508	九州電力	7,000	921.00	6,447,000	
9513	電源開発	2,700	2,502.00	6,755,400	
9531	東京瓦斯	6,600	2,414.50	15,935,700	
9532	大阪瓦斯	6,600	1,870.00	12,342,000	
9001	東武鉄道	3,600	3,735.00	13,446,000	
9003	相鉄ホールディングス	1,500	2,903.00	4,354,500	
9005	東急	8,600	1,953.00	16,795,800	
9007	小田急電鉄	5,100	2,440.00	12,444,000	
9008	京王電鉄	1,800	6,260.00	11,268,000	
9009	京成電鉄	2,400	4,005.00	9,612,000	
9020	東日本旅客鉄道	6,000	9,733.00	58,398,000	
9021	西日本旅客鉄道	3,000	9,164.00	27,492,000	
9022	東海旅客鉄道	2,800	22,145.00	62,006,000	
9024	西武ホールディングス	4,600	1,726.00	7,939,600	
9041	近鉄グループホールディングス	3,200	5,820.00	18,624,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	4,300	4,325.00	18,597,500	
9045	京阪ホールディングス	1,900	4,950.00	9,405,000	
9048	名古屋鉄道	3,500	3,275.00	11,462,500	
9062	日本通運	1,100	5,930.00	6,523,000	
9064	ヤマトホールディングス	5,700	1,905.00	10,858,500	
9065	山九	900	5,510.00	4,959,000	
9086	日立物流	600	3,240.00	1,944,000	
9201	日本航空	5,800	3,127.00	18,136,600	
9202	ANAホールディングス	5,900	3,466.00	20,449,400	
2327	日鉄ソリューションズ	500	3,415.00	1,707,500	
3626	T I S	1,100	6,910.00	7,601,000	
3659	ネクソン	9,500	1,605.00	15,247,500	
3668	コロプラ	1,100	1,188.00	1,306,800	
3738	ティーガイア	300	2,731.00	819,300	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	800	2,081.00	1,664,800	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	600	7,280.00	4,368,000	
3932	アカツキ	100	5,500.00	550,000	
4307	野村総合研究所	4,700	2,698.00	12,680,600	
4684	オービック	1,200	15,570.00	18,684,000	
4689	Zホールディングス	46,000	420.00	19,320,000	
4704	トレンドマイクロ	1,500	5,850.00	8,775,000	
4716	日本オラクル	700	9,680.00	6,776,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	1,500	3,270.00	4,905,000	

4768	大塚商会	1,800	5,070.00	9,126,000	
4819	デジタルガレージ	600	4,230.00	2,538,000	
8056	日本ユニシス	1,000	3,810.00	3,810,000	
9404	日本テレビホールディングス	2,800	1,486.00	4,160,800	
9432	日本電信電話	34,100	2,818.50	96,110,850	
9433	K D D I	25,000	3,330.00	83,250,000	
9435	光通信	300	26,960.00	8,088,000	
9437	N T T ドコモ	24,700	3,089.00	76,298,300	
9602	東宝	2,000	4,105.00	8,210,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	8,900	1,462.00	13,011,800	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,400	5,610.00	7,854,000	
9697	カプコン	1,600	3,355.00	5,368,000	
9719	S C S K	800	5,930.00	4,744,000	
9766	コナミホールディングス	1,200	4,300.00	5,160,000	
9984	ソフトバンクグループ	16,100	4,577.00	73,689,700	
2768	双日	18,600	348.00	6,472,800	
2784	アルフレッサ ホールディングス	3,700	2,274.00	8,413,800	
3038	神戸物産	1,200	4,365.00	5,238,000	
3107	ダイワボウホールディングス	300	6,300.00	1,890,000	
3167	T O K A Iホールディングス	1,800	1,013.00	1,823,400	
3360	シップヘルスケアホールディングス	500	4,975.00	2,487,500	
3543	コメダホールディングス	700	2,198.00	1,538,600	
7458	第一興商	700	5,310.00	3,717,000	
7459	メディパルホールディングス	3,600	2,326.00	8,373,600	
7575	日本ライフライン	1,000	1,460.00	1,460,000	
8001	伊藤忠商事	23,500	2,604.50	61,205,750	
8002	丸紅	35,000	797.50	27,912,500	
8015	豊田通商	3,800	3,725.00	14,155,000	
8020	兼松	1,300	1,417.00	1,842,100	
8031	三井物産	29,500	1,945.50	57,392,250	
8036	日立ハイテクノロジーズ	1,200	8,010.00	9,612,000	
8053	住友商事	21,200	1,666.50	35,329,800	
8058	三菱商事	23,600	2,872.00	67,779,200	
8088	岩谷産業	700	3,660.00	2,562,000	
8283	P A L T A C	500	5,300.00	2,650,000	
9810	日鉄物産	200	4,795.00	959,000	
9962	ミスミグループ本社	4,200	2,739.00	11,503,800	
2651	ローソン	900	6,330.00	5,697,000	
2670	エービーシー・マート	500	7,120.00	3,560,000	
2702	日本マクドナルドホールディングス	1,400	5,240.00	7,336,000	
2782	セリア	800	3,060.00	2,448,000	
3048	ビックカメラ	2,000	1,176.00	2,352,000	

3064	MonotaRO	2,400	2,813.00	6,751,200	
3086	J.フロントリテイリング	4,000	1,314.00	5,256,000	
3088	マツモトキヨシホールディングス	1,400	4,400.00	6,160,000	
3092	ZOZO	2,300	1,722.00	3,960,600	
3141	ウエルシアホールディングス	1,000	6,140.00	6,140,000	
3148	クリエイティブSDホールディングス	600	2,904.00	1,742,400	
3197	すかいらーくホールディングス	3,800	2,045.00	7,771,000	
3349	コスモス薬品	100	24,730.00	2,473,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	13,100	4,276.00	56,015,600	
3391	ツルハホールディングス	700	13,370.00	9,359,000	
3549	クスリのアオキホールディングス	300	6,740.00	2,022,000	
7419	ノジマ	600	2,344.00	1,406,400	
7453	良品計画	4,500	1,858.00	8,361,000	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	7,400	1,770.00	13,098,000	
7550	ゼンショーホールディングス	1,600	2,378.00	3,804,800	
7564	ワークマン	300	8,780.00	2,634,000	
7606	ユナイテッドアローズ	400	2,920.00	1,168,000	
7649	スギホールディングス	700	5,530.00	3,871,000	
8028	ファミリーマート	2,700	2,398.00	6,474,600	
8227	しまむら	400	8,270.00	3,308,000	
8252	丸井グループ	3,100	2,487.00	7,709,700	
8267	イオン	12,900	2,300.00	29,670,000	
8273	イズミ	700	3,515.00	2,460,500	
8279	ヤオコー	400	5,760.00	2,304,000	
8282	ケーズホールディングス	3,200	1,326.00	4,243,200	
9627	アインホールディングス	400	6,730.00	2,692,000	
9843	ニトリホールディングス	1,500	17,385.00	26,077,500	
9983	ファーストリテイリング	400	57,600.00	23,040,000	
9989	サンドラッグ	1,300	3,665.00	4,764,500	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	17,500	249.00	4,357,500	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	19,800	428.00	8,474,400	
8303	新生銀行	2,500	1,733.00	4,332,500	
8304	あおぞら銀行	2,000	3,050.00	6,100,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	170,800	570.60	97,458,480	
8308	りそなホールディングス	36,900	461.20	17,018,280	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	6,400	4,067.00	26,028,800	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	22,600	3,904.00	88,230,400	
8331	千葉銀行	11,600	613.00	7,110,800	
8410	セブン銀行	11,200	330.00	3,696,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	457,300	162.80	74,448,440	
7148	FPG	1,000	999.00	999,000	

8473	SBIホールディングス	3,800	2,506.00	9,522,800	
8601	大和証券グループ本社	27,000	560.90	15,144,300	
8604	野村ホールディングス	59,200	544.30	32,222,560	
8628	松井証券	1,900	895.00	1,700,500	
8630	SOMPOホールディングス	6,300	4,193.00	26,415,900	
8725	MS&ADインシュアランスグループホール	8,800	3,697.00	32,533,600	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	2,800	2,657.00	7,439,600	
8750	第一生命ホールディングス	19,000	1,696.50	32,233,500	
8766	東京海上ホールディングス	12,000	6,144.00	73,728,000	
8795	T&Dホールディングス	10,100	1,230.00	12,423,000	
7164	全国保証	900	4,725.00	4,252,500	
8424	芙蓉総合リース	400	7,110.00	2,844,000	
8439	東京センチュリー	700	5,650.00	3,955,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	2,100	1,737.00	3,647,700	
8585	オリエントコーポレーション	9,100	165.00	1,501,500	
8591	オリックス	21,100	1,899.00	40,068,900	
8593	三菱UFJリース	8,500	702.00	5,967,000	
8697	日本取引所グループ	9,700	2,008.00	19,477,600	
2337	いちご	4,300	426.00	1,831,800	
3003	ヒューリック	7,000	1,345.00	9,415,000	
3231	野村不動産ホールディングス	2,000	2,721.00	5,442,000	
3254	プレサンスコーポレーション	600	1,283.00	769,800	
3288	オープンハウス	1,000	3,040.00	3,040,000	
3289	東急不動産ホールディングス	9,200	798.00	7,341,600	
3291	飯田グループホールディングス	2,800	1,876.00	5,252,800	
4666	パーク24	1,800	2,785.00	5,013,000	
8801	三井不動産	16,600	2,982.00	49,501,200	
8802	三菱地所	23,600	2,186.00	51,589,600	
8804	東京建物	3,700	1,770.00	6,549,000	
8830	住友不動産	7,600	4,104.00	31,190,400	
8850	スターツコーポレーション	500	2,659.00	1,329,500	
8905	イオンモール	1,700	1,876.00	3,189,200	
9706	日本空港ビルデング	1,100	5,610.00	6,171,000	
2121	ミクシィ	800	1,903.00	1,522,400	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	200	1,708.00	341,600	
2127	日本M&Aセンター	2,500	3,680.00	9,200,000	
2146	UTグループ	500	2,858.00	1,429,000	
2175	エス・エム・エス	1,000	2,351.00	2,351,000	
2181	パースルホールディングス	3,300	2,115.00	6,979,500	
2331	総合警備保障	1,300	5,690.00	7,397,000	
2371	カカクコム	2,400	2,929.00	7,029,600	

2379	ディップ	500	3,445.00	1,722,500	
2412	ベネフィット・ワン	1,200	2,016.00	2,419,200	
2413	エムスリー	7,200	3,220.00	23,184,000	
2427	アウトソーシング	1,900	1,034.00	1,964,600	
2432	ディー・エヌ・エー	1,600	1,769.00	2,830,400	
2433	博報堂DYホールディングス	4,500	1,572.00	7,074,000	
4324	電通グループ	3,400	3,680.00	12,512,000	
4661	オリエンタルランド	3,500	14,550.00	50,925,000	
4681	リゾートトラスト	1,500	1,789.00	2,683,500	
4732	ユー・エス・エス	3,700	1,996.00	7,385,200	
4751	サイバーエージェント	1,900	4,415.00	8,388,500	
4755	楽天	15,200	869.00	13,208,800	
4849	エン・ジャパン	600	4,630.00	2,778,000	
6028	テクノプロ・ホールディングス	700	7,700.00	5,390,000	
6098	リクルートホールディングス	23,400	4,450.00	104,130,000	
8876	リログループ	1,800	3,060.00	5,508,000	
9678	カナモト	500	2,752.00	1,376,000	
9735	セコム	3,500	9,690.00	33,915,000	
9744	メイテック	400	6,190.00	2,476,000	
	合計	2,845,900		6,338,270,530	

(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。

日本株インカム・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 2年 2月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	76,146,546
株式	6,329,964,070
投資証券	215,737,000
未収配当金	12,980,626

[令和 2年 2月 5日現在]

流動資産合計	6,634,828,242
資産合計	6,634,828,242
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,325,658
未払利息	26
流動負債合計	1,325,684
負債合計	1,325,684
純資産の部	
元本等	
元本	3,132,924,133
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,500,578,425
元本等合計	6,633,502,558
純資産合計	6,633,502,558
負債純資産合計	6,634,828,242

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	<p>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。</p> <p>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。</p>
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 2年 2月 5日現在]
1. 期首	平成31年 2月 6日
期首元本額	3,492,198,425円
期中追加設定元本額	57,013,604円
期中一部解約元本額	416,287,896円
元本の内訳	
三菱UFJ 好配当日本株ファンド（2ヵ月決算型）	2,655,386,644円
好配当日本株ファンド（ラップ向け）	18,368,492円
国内株式セレクション（ラップ向け）	459,168,997円
合計	3,132,924,133円
2. 受益権の総数	3,132,924,133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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、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。
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 2月 5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、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
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 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	96,725,420
投資証券	1,368,900
合計	98,094,320

(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

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）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	2.1174円
(1万口当たり純資産額)	(21,174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	
1407	ウエストホールディングス	57,400	1,718.00	98,613,200	
1926	ライト工業	65,700	1,552.00	101,966,400	
1928	積水ハウス	33,000	2,375.00	78,375,000	
1951	協和エクシオ	16,500	2,735.00	45,127,500	
6379	レイズネクスト	84,200	1,315.00	110,723,000	
3401	帝人	30,800	2,026.00	62,400,800	
4061	デンカ	18,700	3,010.00	56,287,000	
4182	三菱瓦斯化学	41,900	1,665.00	69,763,500	
4206	アイカ工業	16,500	3,465.00	57,172,500	
4928	ノエビアホールディングス	11,000	5,230.00	57,530,000	
5208	有沢製作所	43,100	1,007.00	43,401,700	
7995	バルカー	14,300	2,421.00	34,620,300	
4502	武田薬品工業	69,500	4,328.00	300,796,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	36,000	2,125.00	76,500,000	
5021	コスモエネルギーホールディングス	28,600	2,126.00	60,803,600	

5393	ニチアス	33,200	2,647.00	87,880,400	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	50,100	1,313.00	65,781,300	
5801	古河電気工業	24,200	2,632.00	63,694,400	
5802	住友電気工業	61,200	1,475.50	90,300,600	
3433	トーカロ	36,300	1,181.00	42,870,300	
5929	三和ホールディングス	51,400	1,196.00	61,474,400	
6305	日立建機	45,600	2,997.00	136,663,200	
6464	ツバキ・ナカシマ	27,700	1,320.00	36,564,000	
7011	三菱重工業	19,400	4,038.00	78,337,200	
6501	日立製作所	35,600	4,105.00	146,138,000	
6652	I D E C	28,100	1,964.00	55,188,400	
6670	M C J	86,200	765.00	65,943,000	
6859	エスベック	27,600	2,210.00	60,996,000	
6925	ウシオ電機	57,500	1,551.00	89,182,500	
7752	リコー	86,100	1,231.00	105,989,100	
8035	東京エレクトロン	5,700	24,590.00	140,163,000	
7203	トヨタ自動車	23,400	7,715.00	180,531,000	
7267	本田技研工業	78,200	2,849.00	222,791,800	
7270	S U B A R U	33,300	2,688.00	89,510,400	
7282	豊田合成	25,000	2,378.00	59,450,000	
7740	タムロン	28,200	2,376.00	67,003,200	
8050	セイコーホールディングス	27,200	2,679.00	72,868,800	
9502	中部電力	91,000	1,557.00	141,687,000	
9069	センコーグループホールディングス	76,500	887.00	67,855,500	
9201	日本航空	18,400	3,127.00	57,536,800	
9303	住友倉庫	64,200	1,502.00	96,428,400	
3635	コーエーテクモホールディングス	27,100	3,105.00	84,145,500	
4704	トレンドマイクロ	12,600	5,850.00	73,710,000	
9432	日本電信電話	24,700	2,818.50	69,616,950	
9434	ソフトバンク	159,100	1,499.50	238,570,450	
9437	N T T ドコモ	55,000	3,089.00	169,895,000	
3167	T O K A Iホールディングス	107,000	1,013.00	108,391,000	
3543	コメダホールディングス	29,000	2,198.00	63,742,000	
8001	伊藤忠商事	59,700	2,604.50	155,488,650	
8002	丸紅	130,200	797.50	103,834,500	
8130	サンゲツ	28,500	1,928.00	54,948,000	
9934	因幡電機産業	16,400	2,727.00	44,722,800	
7593	V Tホールディングス	79,800	448.00	35,750,400	
8252	丸井グループ	27,800	2,487.00	69,138,600	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	167,200	570.60	95,404,320	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	42,400	3,904.00	165,529,600	
8367	南都銀行	12,600	2,644.00	33,314,400	

8410	セブン銀行	200,400	330.00	66,132,000	
8473	SBIホールディングス	36,800	2,506.00	92,220,800	
8750	第一生命ホールディングス	124,200	1,696.50	210,705,300	
8766	東京海上ホールディングス	21,700	6,144.00	133,324,800	
8593	三菱UFJリース	107,000	702.00	75,114,000	
2353	日本駐車場開発	200,100	146.00	29,214,600	
3231	野村不動産ホールディングス	23,100	2,721.00	62,855,100	
3284	フージャースホールディングス	57,100	698.00	39,855,800	
4666	パーク24	23,700	2,785.00	66,004,500	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	10,300	1,708.00	17,592,400	
4714	リソー教育	272,600	372.00	101,407,200	
6183	ベルシステム24ホールディングス	24,100	1,550.00	37,355,000	
9743	丹青社	82,900	1,248.00	103,459,200	
9744	メイテック	14,800	6,190.00	91,612,000	
	合計	3,886,400		6,329,964,070	

(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	アドバンス・レジデンス投資法人	60	20,340,000	
	日本リート投資法人	43	21,091,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	900	20,403,000	
	ラサールロジポート投資法人	108	19,072,800	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	55	43,175,000	
	オリックス不動産投資法人	78	18,400,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	145	20,952,500	
	ケネディクス・オフィス投資法人	30	25,890,000	
	大和証券オフィス投資法人	31	26,412,000	
	合計	1,450	215,737,000	

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。

貸借対照表

(単位：円)

[令和2年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,144,479
株式	3,574,992,150
派生商品評価勘定	164,450
未収配当金	6,775,200
前払金	35,000
差入委託証拠金	480,000
流動資産合計	3,600,591,279
資産合計	3,600,591,279
負債の部	
流動負債	
未払金	8,611,750
未払解約金	2,238
未払利息	6
流動負債合計	8,613,994
負債合計	8,613,994
純資産の部	
元本等	
元本	2,696,148,429
剰余金	
剰余金又は欠損金()	895,828,856
元本等合計	3,591,977,285
純資産合計	3,591,977,285
負債純資産合計	3,600,591,279

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和2年2月5日現在]
1. 期首	平成31年2月6日
期首元本額	2,080,896,522円
期中追加設定元本額	2,038,214,038円
期中一部解約元本額	1,422,962,131円
元本の内訳	
iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスファンド(ラップ向け)	1,561,943,723円
国内株式セレクション(ラップ向け)	206,603,760円

	[令和 2年 2月 5日現在]
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	4,212,337円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	28,412,275円
eMAXIS JAPAN クオリティ150インデックス	894,976,334円
合計	2,696,148,429円
2. 受益権の総数	2,696,148,429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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

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

区分	[令和 2年 2月 5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 2月 5日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式		7,320,105
合計		7,320,105

(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 2月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	16,890,000		17,055,000	165,000
	合計	16,890,000		17,055,000	165,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.3323円
(1万口当たり純資産額)	(13,323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	
1719	安藤・間	5,300	908.00	4,812,400	
1721	コムシスホールディングス	3,400	3,120.00	10,608,000	
1803	清水建設	19,100	1,135.00	21,678,500	
1878	大東建託	1,800	12,770.00	22,986,000	
1928	積水ハウス	17,000	2,375.00	40,375,000	
1951	協和エクシオ	2,900	2,735.00	7,931,500	
1959	九電工	1,400	3,255.00	4,557,000	
2201	森永製菓	1,200	5,280.00	6,336,000	
2222	寿スピリッツ	600	7,150.00	4,290,000	
2229	カルビー	2,300	3,685.00	8,475,500	
2267	ヤクルト本社	3,900	5,750.00	22,425,000	
2269	明治ホールディングス	3,800	7,790.00	29,602,000	
2587	サントリー食品インターナショナル	3,300	4,750.00	15,675,000	
2801	キッコーマン	5,100	5,670.00	28,917,000	
2815	アリアケジャパン	500	7,420.00	3,710,000	
2914	日本たばこ産業	28,600	2,298.00	65,722,800	
8111	ゴールドウイン	900	6,650.00	5,985,000	
3407	旭化成	36,500	1,151.00	42,011,500	
4021	日産化学	3,900	4,660.00	18,174,000	
4042	東ソー	8,500	1,659.00	14,101,500	
4063	信越化学工業	5,900	13,095.00	77,260,500	
4204	積水化学工業	12,000	1,841.00	22,092,000	
4403	日油	2,200	3,595.00	7,909,000	
4452	花王	8,200	8,581.00	70,364,200	
4912	ライオン	7,800	2,067.00	16,122,600	
4921	ファンケル	2,600	3,000.00	7,800,000	
4922	コーセー	1,000	14,550.00	14,550,000	
4967	小林製薬	1,600	8,810.00	14,096,000	
7988	ニフコ	2,500	2,881.00	7,202,500	
8113	ユニ・チャーム	12,200	3,700.00	45,140,000	

4503	アステラス製薬	38,600	1,884.00	72,722,400	
4506	大日本住友製薬	4,500	1,836.00	8,262,000	
4507	塩野義製薬	7,800	6,465.00	50,427,000	
4516	日本新薬	1,800	9,840.00	17,712,000	
4519	中外製薬	5,900	11,690.00	68,971,000	
4521	科研製薬	1,000	5,950.00	5,950,000	
4528	小野薬品工業	13,100	2,626.50	34,407,150	
4536	参天製薬	10,500	2,069.00	21,724,500	
4552	J C R ファーマ	500	9,970.00	4,985,000	
4555	沢井製薬	1,200	7,300.00	8,760,000	
4587	ペプチドリーム	2,600	5,360.00	13,936,000	
5101	横浜ゴム	3,800	1,886.00	7,166,800	
5108	ブリヂストン	16,400	3,941.00	64,632,400	
3436	SUMCO	6,700	1,728.00	11,577,600	
5929	三和ホールディングス	5,800	1,196.00	6,936,800	
6005	三浦工業	3,000	4,220.00	12,660,000	
6103	オークマ	800	5,160.00	4,128,000	
6134	F U J I	2,400	1,810.00	4,344,000	
6146	ディスコ	800	26,010.00	20,808,000	
6268	ナブテスコ	3,300	3,140.00	10,362,000	
6367	ダイキン工業	4,600	15,780.00	72,588,000	
6465	ホンザキ	1,600	10,330.00	16,528,000	
6448	ブラザー工業	6,900	2,256.00	15,566,400	
6479	ミネベアミツミ	11,200	2,276.00	25,491,200	
6645	オムロン	5,600	6,650.00	37,240,000	
6754	アンリツ	3,600	2,174.00	7,826,400	
6758	ソニー	9,800	7,659.00	75,058,200	
6841	横河電機	7,000	1,985.00	13,895,000	
6845	アズビル	3,800	3,020.00	11,476,000	
6856	堀場製作所	1,100	7,040.00	7,744,000	
6861	キーエンス	1,800	37,710.00	67,878,000	
6869	シスメックス	4,600	8,039.00	36,979,400	
6920	レーザーテック	2,500	5,180.00	12,950,000	
6923	スタンレー電気	4,000	2,932.00	11,728,000	
6952	カシオ計算機	6,400	2,021.00	12,934,400	
6965	浜松ホトニクス	3,800	4,715.00	17,917,000	
6976	太陽誘電	3,400	3,375.00	11,475,000	
6981	村田製作所	10,900	6,446.00	70,261,400	
7276	小糸製作所	3,400	4,905.00	16,677,000	
8035	東京エレクトロン	3,000	24,590.00	73,770,000	
7202	いすゞ自動車	16,300	1,090.50	17,775,150	
7309	シマノ	2,200	17,300.00	38,060,000	

7313	テイ・エス テック	1,400	3,080.00	4,312,000	
4543	テルモ	18,800	3,941.00	74,090,800	
7701	島津製作所	7,200	3,120.00	22,464,000	
7730	マニー	2,100	2,791.00	5,861,100	
7741	HOYA	7,400	10,120.00	74,888,000	
7747	朝日インテック	6,800	3,005.00	20,434,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	5,800	6,584.00	38,187,200	
7951	ヤマハ	4,400	5,730.00	25,212,000	
7956	ビジョン	3,200	3,920.00	12,544,000	
7974	任天堂	1,600	40,430.00	64,688,000	
9022	東海旅客鉄道	3,200	22,145.00	70,864,000	
9065	山九	1,600	5,510.00	8,816,000	
9201	日本航空	9,100	3,127.00	28,455,700	
2327	日鉄ソリューションズ	1,000	3,415.00	3,415,000	
3626	T I S	2,300	6,910.00	15,893,000	
3659	ネクソン	12,500	1,605.00	20,062,500	
4307	野村総合研究所	11,100	2,698.00	29,947,800	
4684	オービック	1,900	15,570.00	29,583,000	
4686	ジャストシステム	800	5,870.00	4,696,000	
4704	トレンドマイクロ	3,400	5,850.00	19,890,000	
4716	日本オラクル	900	9,680.00	8,712,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,800	3,270.00	9,156,000	
4768	大塚商会	3,400	5,070.00	17,238,000	
4819	デジタルガレージ	1,000	4,230.00	4,230,000	
7518	ネットワンシステムズ	2,300	1,929.00	4,436,700	
8056	日本ユニシス	2,100	3,810.00	8,001,000	
9433	K D D I	22,300	3,330.00	74,259,000	
9435	光通信	600	26,960.00	16,176,000	
9437	N T T ドコモ	23,500	3,089.00	72,591,500	
9602	東宝	3,600	4,105.00	14,778,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	16,800	1,462.00	24,561,600	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,400	5,610.00	13,464,000	
9697	カプコン	2,500	3,355.00	8,387,500	
9719	S C S K	1,300	5,930.00	7,709,000	
9766	コナミホールディングス	2,700	4,300.00	11,610,000	
3038	神戸物産	1,900	4,365.00	8,293,500	
3360	シップヘルスケアホールディングス	1,100	4,975.00	5,472,500	
7458	第一興商	1,200	5,310.00	6,372,000	
8001	伊藤忠商事	28,500	2,604.50	74,228,250	
8036	日立ハイテクノロジーズ	1,700	8,010.00	13,617,000	
9962	ミスミグループ本社	7,400	2,739.00	20,268,600	
2670	エービーシー・マート	800	7,120.00	5,696,000	

3064	MonotaRO	3,600	2,813.00	10,126,800	
3088	マツモトキヨシホールディングス	2,700	4,400.00	11,880,000	
3141	ウエルシアホールディングス	1,400	6,140.00	8,596,000	
3349	コスモス薬品	300	24,730.00	7,419,000	
3391	ツルハホールディングス	1,100	13,370.00	14,707,000	
3549	クスリのアオキホールディングス	600	6,740.00	4,044,000	
3563	スシローグローバルホールディングス	700	9,500.00	6,650,000	
7453	良品計画	6,900	1,858.00	12,820,200	
7649	スギホールディングス	1,100	5,530.00	6,083,000	
8282	ケーズホールディングス	6,200	1,326.00	8,221,200	
9843	ニトリホールディングス	2,500	17,385.00	43,462,500	
9983	ファーストリテイリング	1,100	57,600.00	63,360,000	
9989	サンドラッグ	2,000	3,665.00	7,330,000	
8410	セブン銀行	19,000	330.00	6,270,000	
8630	SOMPOホールディングス	9,800	4,193.00	41,091,400	
8725	MS&ADインシュアランスグループ ホール	13,200	3,697.00	48,800,400	
8729	ソニーフィナンシャルホールディング ス	4,000	2,657.00	10,628,000	
8750	第一生命ホールディングス	31,400	1,696.50	53,270,100	
8766	東京海上ホールディングス	11,800	6,144.00	72,499,200	
7164	全国保証	1,400	4,725.00	6,615,000	
8591	オリックス	34,700	1,899.00	65,895,300	
3288	オープンハウス	1,800	3,040.00	5,472,000	
4666	パーク24	3,300	2,785.00	9,190,500	
2127	日本M&Aセンター	3,800	3,680.00	13,984,000	
2175	エス・エム・エス	1,900	2,351.00	4,466,900	
2331	総合警備保障	2,300	5,690.00	13,087,000	
2371	カカクコム	3,400	2,929.00	9,958,600	
2412	ベネフィット・ワン	2,100	2,016.00	4,233,600	
2413	エムスリー	11,700	3,220.00	37,674,000	
4661	オリエンタルランド	4,800	14,550.00	69,840,000	
4732	ユー・エス・エス	6,500	1,996.00	12,974,000	
4849	エン・ジャパン	1,000	4,630.00	4,630,000	
6028	テクノプロ・ホールディングス	1,000	7,700.00	7,700,000	
6098	リクルートホールディングス	17,800	4,450.00	79,210,000	
9616	共立メンテナンス	700	4,695.00	3,286,500	
9678	カナモト	1,000	2,752.00	2,752,000	
	合計	909,000		3,574,992,150	

(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。

日本株オープン「35」マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
[令和 2年 2月 5日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	124,114,031
株式	6,900,137,360
未収入金	97,029,837
未収配当金	13,329,900
流動資産合計	7,134,611,128
資産合計	7,134,611,128
負債の部	
流動負債	
未払金	119,154,143
未払解約金	576,001
未払利息	42
流動負債合計	119,730,186
負債合計	119,730,186
純資産の部	
元本等	
元本	2,358,070,658
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,656,810,284
元本等合計	7,014,880,942
純資産合計	7,014,880,942
負債純資産合計	7,134,611,128

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。
--------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1. 期首	平成31年 2月 6日

	[令和 2年 2月 5日現在]
期首元本額	2,982,079,442円
期中追加設定元本額	36,605,627円
期中一部解約元本額	660,614,411円
元本の内訳	
三菱UFJ 日本株オープン「35」	1,804,354,252円
国内株式セレクション（ラップ向け）	225,125,458円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	4,119,527円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	30,681,487円
三菱UFJ 日本株オープン「35」VA	268,702,854円
三菱UFJ <DC>日本株オープン「35」	25,087,080円
合計	2,358,070,658円
2. 受益権の総数	2,358,070,658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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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 2月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p>

区分	[令和 2年 2月 5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>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 2月 5日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,119,478,859
合計		1,119,478,859

(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

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）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	2.9748円
(1万口当たり純資産額)	(29,748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	
4186	東京応化工業	47,700	4,680.00	223,236,000	
4369	トリケミカル研究所	26,800	11,870.00	318,116,000	
4911	資生堂	24,700	7,035.00	173,764,500	
4921	ファンケル	34,600	3,000.00	103,800,000	
4516	日本新薬	7,300	9,840.00	71,832,000	
4565	ソーせいグループ	129,000	2,049.00	264,321,000	
4568	第一三共	36,700	7,900.00	289,930,000	
5706	三井金属鉱業	38,800	2,652.00	102,897,600	
5713	住友金属鉱山	38,400	3,193.00	122,611,200	
3436	SUMCO	104,600	1,728.00	180,748,800	
6145	NITTOKU	29,500	3,725.00	109,887,500	
6235	オプトラン	52,000	2,925.00	152,100,000	
6383	ダイフク	17,700	6,710.00	118,767,000	
4062	イビデン	39,000	2,580.00	100,620,000	
6501	日立製作所	40,000	4,105.00	164,200,000	
6594	日本電産	9,800	14,175.00	138,915,000	
6619	ダブル・スコープ	53,700	798.00	42,852,600	
6857	アドバンテスト	17,500	5,730.00	100,275,000	
6861	キーエンス	4,500	37,710.00	169,695,000	
6920	レーザーテック	25,400	5,180.00	131,572,000	
6941	山一電機	176,200	1,916.00	337,599,200	
6967	新光電気工業	121,700	1,318.00	160,400,600	
6976	太陽誘電	55,000	3,375.00	185,625,000	
6981	村田製作所	39,300	6,446.00	253,327,800	
8035	東京エレクトロン	6,200	24,590.00	152,458,000	
7203	トヨタ自動車	27,400	7,715.00	211,391,000	
7267	本田技研工業	78,300	2,849.00	223,076,700	
7747	朝日インテック	37,600	3,005.00	112,988,000	
7974	任天堂	3,100	40,430.00	125,333,000	
9519	レノバ	400,900	1,355.00	543,219,500	
3626	TIS	17,700	6,910.00	122,307,000	
3694	オプティム	45,600	4,505.00	205,428,000	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	13,500	7,280.00	98,280,000	
3774	インターネットイニシアティブ	27,800	2,999.00	83,372,200	
8056	日本ユニシス	23,200	3,810.00	88,392,000	
9984	ソフトバンクグループ	21,300	4,577.00	97,490,100	
8058	三菱商事	42,600	2,872.00	122,347,200	
9983	ファーストリテイリング	1,100	57,600.00	63,360,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	499,600	570.60	285,071,760	
8766	東京海上ホールディングス	14,600	6,144.00	89,702,400	

2427	アウトソーシング	101,300	1,034.00	104,744,200	
6069	トレンドーズ	215,500	715.00	154,082,500	
	合 計	2,747,200		6,900,137,360	

(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

該当事項はありません。

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 2年 2月 5日現在]

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		174,987,645
株式		8,589,964,100
未収配当金		8,044,600
流動資産合計		8,772,996,345
資産合計		8,772,996,345
負債の部		
流動負債		
未払金		10,284,770
未払解約金		11,070,287
未払利息		60
流動負債合計		21,355,117
負債合計		21,355,117
純資産の部		
元本等		
元本		1,386,389,447
剰余金		
剰余金又は欠損金()		7,365,251,781
元本等合計		8,751,641,228
純資産合計		8,751,641,228
負債純資産合計		8,772,996,345

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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 2年 2月 5日現在]
1. 期首	平成31年 2月 6日
期首元本額	1,769,008,157円
期中追加設定元本額	116,869,823円
期中一部解約元本額	499,488,533円
元本の内訳	
三菱UFJ ジャパン・アクティブ・プラス	37,183,670円
国内株式セレクション(ラップ向け)	51,242,176円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	1,193,953円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	6,684,865円
日本・小型株・ファンド	560,300,175円
日本株スタイル・ミックス・ファンド	21,906,680円
三菱UFJ 日本株スタイル・ミックス・ファンドF(適格機関投資家限定)	4,280,336円
三菱UFJ国際 日本・小型株・ファンド(適格機関投資家用)	315,884,574円
<DC>日本株スタイル・ミックス・ファンド	387,713,018円
合計	1,386,389,447円
2. 受益権の総数	1,386,389,447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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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 2月 5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、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
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 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	41,385,422
合計	41,385,422

(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

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）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	6.3125円
(1万口当たり純資産額)	(63,125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	
1377	サカタのタネ	25,000	3,450.00	86,250,000	
1431	Lib Work	20,000	1,867.00	37,340,000	
1824	前田建設工業	85,500	1,063.00	90,886,500	
1861	熊谷組	12,000	3,215.00	38,580,000	
2607	不二製油グループ本社	42,500	2,886.00	122,655,000	
2925	ピクルスコーポレーション	14,500	2,778.00	40,281,000	
4092	日本化学工業	45,000	3,345.00	150,525,000	
4113	田岡化学工業	9,500	8,030.00	76,285,000	
4203	住友ベークライト	26,000	4,100.00	106,600,000	
4235	ウルトラファブリックス・ホールディングス	31,000	1,469.00	45,539,000	
4368	扶桑化学工業	57,200	3,540.00	202,488,000	
4925	ハーバー研究所	6,000	7,300.00	43,800,000	
4974	タカラバイオ	64,000	2,132.00	136,448,000	
4996	クミアイ化学工業	110,000	873.00	96,030,000	
4540	ツムラ	25,000	2,998.00	74,950,000	
4552	JCRファーマ	6,800	9,970.00	67,796,000	
4565	そーせいグループ	60,500	2,049.00	123,964,500	
4572	カルナバイオサイエンス	60,000	1,913.00	114,780,000	
4574	大幸薬品	12,500	3,725.00	46,562,500	
4587	ペプチドリーム	8,400	5,360.00	45,024,000	
4595	ミズホメディー	16,000	2,444.00	39,104,000	
5194	相模ゴム工業	42,700	1,815.00	77,500,500	
3110	日東紡績	18,200	4,620.00	84,084,000	
5344	MARUWA	21,000	8,100.00	170,100,000	
5393	ニチアス	51,000	2,647.00	134,997,000	
7943	ニチハ	31,500	2,747.00	86,530,500	
3433	トーカロ	211,000	1,181.00	249,191,000	
3445	RS Technologies	27,500	2,879.00	79,172,500	
6013	タクマ	89,900	1,227.00	110,307,300	

6272	レオン自動機	81,700	1,451.00	118,546,700	
6289	技研製作所	28,000	4,920.00	137,760,000	
6323	ローツェ	35,300	4,160.00	146,848,000	
6324	ハーモニック・ドライブ・システムズ	8,700	5,170.00	44,979,000	
6332	月島機械	27,000	1,456.00	39,312,000	
6651	日東工業	53,000	2,314.00	122,642,000	
6703	沖電気工業	43,000	1,380.00	59,340,000	
6750	エレコム	9,500	4,470.00	42,465,000	
6920	レーザーテック	30,900	5,180.00	160,062,000	
7282	豊田合成	17,700	2,378.00	42,090,600	
7600	日本エム・ディ・エム	43,500	2,011.00	87,478,500	
7729	東京精密	31,500	3,985.00	125,527,500	
7780	メニコン	26,000	5,270.00	137,020,000	
7839	S H O E I	16,500	5,410.00	89,265,000	
9519	レノバ	45,000	1,355.00	60,975,000	
9090	丸和運輸機関	25,000	2,294.00	57,350,000	
2317	システナ	25,000	1,741.00	43,525,000	
3655	ブレインパッド	7,800	5,780.00	45,084,000	
3762	テクマトリックス	38,500	2,778.00	106,953,000	
3769	G M O ペイメントゲートウェイ	14,500	7,280.00	105,560,000	
3835	e B A S E	25,200	1,678.00	42,285,600	
3836	アバント	83,000	1,082.00	89,806,000	
3923	ラクス	12,000	1,823.00	21,876,000	
4348	インフォコム	37,000	3,085.00	114,145,000	
4384	ラクスル	24,000	3,635.00	87,240,000	
4397	チームスピリット	59,500	2,220.00	132,090,000	
4429	リックソフト	10,000	6,560.00	65,600,000	
4443	S a n s a n	15,900	5,720.00	90,948,000	
4475	H E N N G E	55,500	2,023.00	112,276,500	
4478	フリー	22,800	3,290.00	75,012,000	
4483	J M D C	3,800	5,530.00	21,014,000	
4800	オリコン	34,000	1,246.00	42,364,000	
4812	電通国際情報サービス	20,000	4,795.00	95,900,000	
4819	デジタルガレージ	21,000	4,230.00	88,830,000	
8056	日本ユニシス	33,200	3,810.00	126,492,000	
9416	ビジョン	76,000	1,447.00	109,972,000	
9470	学研ホールディングス	6,200	7,160.00	44,392,000	
3139	ラクト・ジャパン	46,500	4,210.00	195,765,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	35,000	4,975.00	174,125,000	
3141	ウエルシアホールディングス	6,300	6,140.00	38,682,000	
3182	オイシックス・ラ・大地	27,000	1,044.00	28,188,000	
3186	ネクステージ	81,000	1,058.00	85,698,000	

7564	ワークマン	16,500	8,780.00	144,870,000	
8282	ケーズホールディングス	51,000	1,326.00	67,626,000	
7164	全国保証	18,500	4,725.00	87,412,500	
7198	アルヒ	39,000	1,653.00	64,467,000	
2337	いちご	200,000	426.00	85,200,000	
3288	オープンハウス	7,000	3,040.00	21,280,000	
3479	ティーケーピー	9,300	3,920.00	36,456,000	
8919	カチタス	23,000	4,580.00	105,340,000	
2127	日本M&Aセンター	24,600	3,680.00	90,528,000	
2151	タケエイ	31,000	1,070.00	33,170,000	
2157	コシダカホールディングス	26,000	1,525.00	39,650,000	
2175	エス・エム・エス	30,600	2,351.00	71,940,600	
2183	リニカル	37,000	1,080.00	39,960,000	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	30,000	966.00	28,980,000	
2491	バリューコマース	48,500	2,651.00	128,573,500	
4293	セプテーニ・ホールディングス	300,000	306.00	91,800,000	
4848	フルキャストホールディングス	55,000	2,423.00	133,265,000	
6055	ジャパンマテリアル	150,000	1,657.00	248,550,000	
6095	メドピア	23,500	1,674.00	39,339,000	
6191	エアトリ	21,000	1,612.00	33,852,000	
6197	ソラスト	67,000	1,158.00	77,586,000	
6532	ペイカレント・コンサルティング	21,000	8,140.00	170,940,000	
6571	キュービーネットホールディングス	51,600	2,298.00	118,576,800	
9716	乃村工芸社	78,000	1,293.00	100,854,000	
9757	船井総研ホールディングス	33,000	2,924.00	96,492,000	
	合計	3,965,300		8,589,964,100	

(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

該当事項はありません。

日本株式最小分散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2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	29,979,113
株式	8,495,398,190
未収配当金	19,157,800
前払金	975,000
差入委託証拠金	1,440,000
流動資産合計	8,546,950,103
資産合計	8,546,950,103
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	376,650
未払解約金	44,995
未払利息	10
流動負債合計	421,655
負債合計	421,655
純資産の部	
元本等	
元本	6,306,422,677
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,240,105,771
元本等合計	8,546,528,448
純資産合計	8,546,528,448
負債純資産合計	8,546,950,103

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和2年2月5日現在]
1. 期首	平成31年2月6日
期首元本額	10,558,359,108円
期中追加設定元本額	2,050,954,578円
期中一部解約元本額	6,302,891,009円
元本の内訳	
国内株式セレクション(ラップ向け)	663,887,514円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	13,799,822円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	87,627,241円

	[令和 2年 2月 5日現在]
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）	460,408,700円
日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	4,570,602,105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）	510,097,295円
合計	6,306,422,677円
2. 受益権の総数	6,306,422,677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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 2月 5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 2月 5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>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 2月 5日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式		58,590,143
合計		58,590,143

(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 2月 5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	51,540,000		51,165,000	375,000
	合計	51,540,000		51,165,000	375,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3552円 (13,552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	
1801	大成建設	4,200	4,470.00	18,774,000	
1878	大東建託	5,100	12,770.00	65,127,000	
1928	積水ハウス	54,800	2,375.00	130,150,000	
2212	山崎製パン	14,900	2,114.00	31,498,600	
2229	カルビー	5,100	3,685.00	18,793,500	
2269	明治ホールディングス	7,000	7,790.00	54,530,000	
2282	日本ハム	8,300	4,860.00	40,338,000	
2502	アサヒグループホールディングス	18,300	5,061.00	92,616,300	
2503	麒麟ホールディングス	15,700	2,463.00	38,669,100	
2587	サントリー食品インターナショナル	19,700	4,750.00	93,575,000	
2802	味の素	30,000	1,947.00	58,410,000	
2875	東洋水産	17,600	4,725.00	83,160,000	
2897	日清食品ホールディングス	3,400	8,830.00	30,022,000	
2914	日本たばこ産業	52,200	2,298.00	119,955,600	
3401	帝人	13,400	2,026.00	27,148,400	
3402	東レ	24,900	724.10	18,030,090	
4063	信越化学工業	1,100	13,095.00	14,404,500	
4452	花王	12,800	8,581.00	109,836,800	
4901	富士フイルムホールディングス	18,300	5,536.00	101,308,800	
4911	資生堂	1,500	7,035.00	10,552,500	
4912	ライオン	12,500	2,067.00	25,837,500	
8113	ユニ・チャーム	16,700	3,700.00	61,790,000	
4151	協和キリン	7,100	2,638.00	18,729,800	
4502	武田薬品工業	21,000	4,328.00	90,888,000	
4503	アステラス製薬	50,000	1,884.00	94,200,000	
4507	塩野義製薬	13,700	6,465.00	88,570,500	
4519	中外製薬	9,700	11,690.00	113,393,000	
4528	小野薬品工業	6,300	2,626.50	16,546,950	
4536	参天製薬	4,800	2,069.00	9,931,200	

4568	第一三共	3,200	7,900.00	25,280,000	
4578	大塚ホールディングス	3,700	4,948.00	18,307,600	
5108	ブリヂストン	29,000	3,941.00	114,289,000	
5463	丸一鋼管	6,600	3,070.00	20,262,000	
5947	リンナイ	4,100	7,830.00	32,103,000	
6367	ダイキン工業	600	15,780.00	9,468,000	
6417	SANKYO	19,800	3,735.00	73,953,000	
6460	セガサミーホールディングス	12,200	1,530.00	18,666,000	
6465	ホシザキ	2,200	10,330.00	22,726,000	
7011	三菱重工業	16,300	4,038.00	65,819,400	
6502	東芝	11,200	3,530.00	39,536,000	
6701	日本電気	29,300	5,040.00	147,672,000	
6702	富士通	7,800	12,705.00	99,099,000	
6724	セイコーエプソン	4,400	1,708.00	7,515,200	
6758	ソニー	6,900	7,659.00	52,847,100	
6861	キーエンス	900	37,710.00	33,939,000	
6952	カシオ計算機	13,800	2,021.00	27,889,800	
6954	ファナック	200	20,355.00	4,071,000	
6971	京セラ	1,200	7,199.00	8,638,800	
7751	キャノン	42,700	2,875.50	122,783,850	
7752	リコー	21,100	1,231.00	25,974,100	
8035	東京エレクトロン	800	24,590.00	19,672,000	
7201	日産自動車	125,400	592.60	74,312,040	
7203	トヨタ自動車	16,400	7,715.00	126,526,000	
7269	スズキ	5,600	5,003.00	28,016,800	
7309	シマノ	3,000	17,300.00	51,900,000	
4543	テルモ	11,300	3,941.00	44,533,300	
7733	オリンパス	24,900	1,830.00	45,567,000	
7741	HOYA	7,400	10,120.00	74,888,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	9,100	6,584.00	59,914,400	
7912	大日本印刷	4,500	3,090.00	13,905,000	
7974	任天堂	600	40,430.00	24,258,000	
9501	東京電力ホールディングス	21,900	452.00	9,898,800	
9502	中部電力	39,100	1,557.00	60,878,700	
9503	関西電力	22,000	1,289.00	28,358,000	
9504	中国電力	87,300	1,498.00	130,775,400	
9506	東北電力	42,100	1,044.00	43,952,400	
9508	九州電力	76,400	921.00	70,364,400	
9531	東京瓦斯	40,700	2,414.50	98,270,150	
9532	大阪瓦斯	40,700	1,870.00	76,109,000	
9533	東邦瓦斯	8,500	4,235.00	35,997,500	
9001	東武鉄道	23,100	3,735.00	86,278,500	

9005	東急	19,400	1,953.00	37,888,200	
9007	小田急電鉄	27,000	2,440.00	65,880,000	
9008	京王電鉄	7,800	6,260.00	48,828,000	
9009	京成電鉄	6,900	4,005.00	27,634,500	
9020	東日本旅客鉄道	12,800	9,733.00	124,582,400	
9021	西日本旅客鉄道	13,200	9,164.00	120,964,800	
9022	東海旅客鉄道	5,300	22,145.00	117,368,500	
9024	西武ホールディングス	20,400	1,726.00	35,210,400	
9041	近鉄グループホールディングス	20,900	5,820.00	121,638,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	12,000	4,325.00	51,900,000	
9045	京阪ホールディングス	18,100	4,950.00	89,595,000	
9048	名古屋鉄道	35,900	3,275.00	117,572,500	
9064	ヤマトホールディングス	2,400	1,905.00	4,572,000	
9142	九州旅客鉄道	33,900	3,625.00	122,887,500	
9143	S Gホールディングス	8,800	2,435.00	21,428,000	
9201	日本航空	38,500	3,127.00	120,389,500	
9202	A N Aホールディングス	34,600	3,466.00	119,923,600	
9364	上組	5,300	2,411.00	12,778,300	
4684	オービック	600	15,570.00	9,342,000	
4689	Zホールディングス	118,400	420.00	49,728,000	
4716	日本オラクル	3,900	9,680.00	37,752,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	5,100	3,270.00	16,677,000	
9432	日本電信電話	47,200	2,818.50	133,033,200	
9433	K D D I	40,300	3,330.00	134,199,000	
9434	ソフトバンク	84,900	1,499.50	127,307,550	
9435	光通信	2,300	26,960.00	62,008,000	
9437	N T T ドコモ	43,100	3,089.00	133,135,900	
9602	東宝	19,200	4,105.00	78,816,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	31,000	1,462.00	45,322,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,000	5,610.00	5,610,000	
9766	コナミホールディングス	6,800	4,300.00	29,240,000	
7459	メディカルホールディングス	3,000	2,326.00	6,978,000	
8001	伊藤忠商事	33,600	2,604.50	87,511,200	
8031	三井物産	23,200	1,945.50	45,135,600	
8036	日立ハイテクノロジーズ	700	8,010.00	5,607,000	
8053	住友商事	22,300	1,666.50	37,162,950	
8058	三菱商事	22,400	2,872.00	64,332,800	
9987	スズケン	4,900	4,300.00	21,070,000	
2651	ローソン	19,800	6,330.00	125,334,000	
2670	エービーシー・マート	14,600	7,120.00	103,952,000	
2702	日本マクドナルドホールディングス	23,700	5,240.00	124,188,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	26,100	4,276.00	111,603,600	

7453	良品計画	1,800	1,858.00	3,344,400	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	31,300	1,770.00	55,401,000	
8028	ファミリーマート	4,400	2,398.00	10,551,200	
8227	しまむら	6,400	8,270.00	52,928,000	
9831	ヤマダ電機	224,800	559.00	125,663,200	
9843	ニトリホールディングス	5,800	17,385.00	100,833,000	
9983	ファーストリテイリング	1,000	57,600.00	57,600,000	
7182	ゆうちょ銀行	120,500	1,032.00	124,356,000	
8304	あおぞら銀行	9,700	3,050.00	29,585,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,000	570.60	4,564,800	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	13,300	3,904.00	51,923,200	
8410	セブン銀行	35,600	330.00	11,748,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	752,700	162.80	122,539,560	
7181	かんぽ生命保険	2,400	1,870.00	4,488,000	
8725	M S & A Dインシュアランスグループ ホール	14,100	3,697.00	52,127,700	
8766	東京海上ホールディングス	16,400	6,144.00	100,761,600	
3003	ヒューリック	28,100	1,345.00	37,794,500	
3231	野村不動産ホールディングス	6,700	2,721.00	18,230,700	
4666	パーク24	16,400	2,785.00	45,674,000	
8801	三井不動産	8,800	2,982.00	26,241,600	
8802	三菱地所	38,900	2,186.00	85,035,400	
8830	住友不動産	16,600	4,104.00	68,126,400	
8905	イオンモール	3,700	1,876.00	6,941,200	
2331	総合警備保障	5,300	5,690.00	30,157,000	
2371	カカクコム	5,000	2,929.00	14,645,000	
4324	電通グループ	7,000	3,680.00	25,760,000	
4661	オリエンタルランド	8,600	14,550.00	125,130,000	
4732	ユー・エス・エス	2,000	1,996.00	3,992,000	
4755	楽天	19,100	869.00	16,597,900	
6178	日本郵政	127,900	1,020.50	130,521,950	
9735	セコム	13,200	9,690.00	127,908,000	
9783	ベネッセホールディングス	5,300	3,045.00	16,138,500	
	合計	3,800,200		8,495,398,190	

(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。

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[令和2年2月5日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	32,791,342
株式	3,946,998,940
未収入金	25,607,639
未収配当金	6,881,900
流動資産合計	4,012,279,821
資産合計	4,012,279,821
負債の部	
流動負債	
未払金	21,978,669
未払解約金	2,932,227
未払利息	11
流動負債合計	24,910,907
負債合計	24,910,907
純資産の部	
元本等	
元本	1,256,721,479
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,730,647,435
元本等合計	3,987,368,914
純資産合計	3,987,368,914
負債純資産合計	4,012,279,821

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

[令和2年2月5日現在]	
1. 期首	平成31年2月6日
期首元本額	1,324,481,536円
期中追加設定元本額	139,083,204円
期中一部解約元本額	206,843,261円
元本の内訳	

	[令和 2年 2月 5日現在]
三菱UFJ ジャパン・アクティブ・プラス	395,616,758円
国内株式セレクション（ラップ向け）	103,792,502円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	2,185,952円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	14,416,002円
三菱UFJ ジャパン・アクティブ・ファンド	326,583,526円
世界ソブリン債券・日本株ファンド（毎月分配型）	390,988,290円
MUAM ジャパン・アクティブ・ニュートラル（適格機関投資家限定）	23,138,449円
合計	1,256,721,479円
2. 受益権の総数	1,256,721,479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 2月 6日 至 令和 2年 2月 5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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 2月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>

区分	[令和 2年 2月 5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 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	145,513,659
合計	145,513,659

(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

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)

	[令和 2年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	3.1728円
(1万口当たり純資産額)	(31,728円)

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1)株式

(単位：円)

			評価額	
--	--	--	-----	--

	銘柄	株式数	単価	金額	備考
1605	国際石油開発帝石	37,800	1,047.50	39,595,500	
1803	清水建設	34,600	1,135.00	39,271,000	
1824	前田建設工業	35,200	1,063.00	37,417,600	
1925	大和ハウス工業	14,100	3,535.00	49,843,500	
1928	積水ハウス	8,000	2,375.00	19,000,000	
1951	協和エクシオ	14,400	2,735.00	39,384,000	
1963	日揮ホールディングス	30,100	1,535.00	46,203,500	
2270	雪印メグミルク	15,600	2,665.00	41,574,000	
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	28,300	718.00	20,319,400	
2871	ニチレイ	15,000	2,831.00	42,465,000	
2875	東洋水産	8,800	4,725.00	41,580,000	
3402	東レ	108,400	724.10	78,492,440	
3941	レンゴー	50,100	871.00	43,637,100	
4091	大陽日酸	16,400	2,453.00	40,229,200	
4182	三菱瓦斯化学	23,500	1,665.00	39,127,500	
4188	三菱ケミカルホールディングス	36,700	806.60	29,602,220	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	16,300	2,394.00	39,022,200	
4985	アース製薬	8,300	5,970.00	49,551,000	
4502	武田薬品工業	27,400	4,328.00	118,587,200	
4523	エーザイ	4,700	9,042.00	42,497,400	
4568	第一三共	15,800	7,900.00	124,820,000	
5486	日立金属	23,000	1,773.00	40,779,000	
5801	古河電気工業	14,900	2,632.00	39,216,800	
3436	SUMCO	44,000	1,728.00	76,032,000	
6305	日立建機	18,700	2,997.00	56,043,900	
7013	IHI	28,800	2,647.00	76,233,600	
4062	イビデン	18,700	2,580.00	48,246,000	
6501	日立製作所	22,300	4,105.00	91,541,500	
6702	富士通	5,500	12,705.00	69,877,500	
6753	シャープ	37,100	1,559.00	57,838,900	
6758	ソニー	13,800	7,659.00	105,694,200	
6925	ウシオ電機	52,500	1,551.00	81,427,500	
7752	リコー	69,100	1,231.00	85,062,100	
7105	三菱ロジスネクスト	40,200	1,655.00	66,531,000	
7203	トヨタ自動車	6,300	7,715.00	48,604,500	
7251	ケーヒン	7,500	2,580.00	19,350,000	
7267	本田技研工業	48,100	2,849.00	137,036,900	
7282	豊田合成	24,700	2,378.00	58,736,600	
7974	任天堂	1,800	40,430.00	72,774,000	
9502	中部電力	26,800	1,557.00	41,727,600	
9009	京成電鉄	16,900	4,005.00	67,684,500	

9065	山九	7,200	5,510.00	39,672,000	
9143	S Gホールディングス	38,000	2,435.00	92,530,000	
9201	日本航空	3,100	3,127.00	9,693,700	
9303	住友倉庫	13,700	1,502.00	20,577,400	
3626	T I S	5,900	6,910.00	40,769,000	
4348	インフォコム	6,400	3,085.00	19,744,000	
4689	Zホールディングス	110,300	420.00	46,326,000	
4812	電通国際情報サービス	6,100	4,795.00	29,249,500	
9434	ソフトバンク	66,400	1,499.50	99,566,800	
9435	光通信	1,500	26,960.00	40,440,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,100	5,610.00	51,051,000	
9719	S C S K	9,900	5,930.00	58,707,000	
3139	ラクト・ジャパン	5,100	4,210.00	21,471,000	
8001	伊藤忠商事	34,400	2,604.50	89,594,800	
8058	三菱商事	31,200	2,872.00	89,606,400	
3186	ネクステージ	81,300	1,058.00	86,015,400	
3563	スシローグローバルホールディングス	10,000	9,500.00	95,000,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	120,900	570.60	68,985,540	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	12,700	3,904.00	49,580,800	
8473	S B Iホールディングス	20,400	2,506.00	51,122,400	
8604	野村ホールディングス	87,800	544.30	47,789,540	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	15,300	2,657.00	40,652,100	
8766	東京海上ホールディングス	14,800	6,144.00	90,931,200	
8439	東京センチュリー	8,700	5,650.00	49,155,000	
8804	東京建物	33,300	1,770.00	58,941,000	
8919	カチタス	4,200	4,580.00	19,236,000	
2432	ディー・エヌ・エー	17,000	1,769.00	30,073,000	
4324	電通グループ	16,100	3,680.00	59,248,000	
4751	サイバーエージェント	10,500	4,415.00	46,357,500	
9616	共立メンテナンス	9,000	4,695.00	42,255,000	
	合 計	1,880,500		3,946,998,940	

(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

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	6,033,416,388
負債総額	26,507,721
純資産総額（ - ）	6,006,908,667
発行済口数	6,087,279,874口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9868
（10,000口当たり）	（9,868）

（参考）

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	431,273,906,605
負債総額	118,324,192,426
純資産総額（ - ）	312,949,714,179
発行済口数	188,123,066,216口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.6635
（10,000口当たり）	（16,635）

JPX日経400インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	6,318,346,388
負債総額	177,794,871
純資産総額（ - ）	6,140,551,517
発行済口数	4,375,710,567口

1口当たり純資産価額（ / ）	1.4033
（10,000口当たり）	（14,033）

日本株インカム・マザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	5,859,636,348
負債総額	6,779,810
純資産総額（ - ）	5,852,856,538
発行済口数	3,111,219,919口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.8812
（10,000口当たり）	（18,812）

JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	3,193,797,618
負債総額	10,024,865
純資産総額（ - ）	3,183,772,753
発行済口数	2,680,679,342口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1877
（10,000口当たり）	（11,877）

日本株オープン「35」マザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	6,075,313,988
負債総額	37,666,699
純資産総額（ - ）	6,037,647,289
発行済口数	2,318,545,068口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.6041

(10,000口当たり)	(26,041)
--------------	----------

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

(単位:円)

資産総額	7,260,557,293
負債総額	3,047,580
純資産総額(-)	7,257,509,713
発行済口数	1,372,674,721口
1口当たり純資産価額(/)	5.2871
(10,000口当たり)	(52,871)

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

(単位:円)

資産総額	8,007,660,404
負債総額	127,468,237
純資産総額(-)	7,880,192,167
発行済口数	6,550,134,840口
1口当たり純資産価額(/)	1.2031
(10,000口当たり)	(12,031)

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 2月28日現在

(単位:円)

資産総額	3,514,176,302
負債総額	43,301,538
純資産総額(-)	3,470,874,764
発行済口数	1,243,491,717口
1口当たり純資産価額(/)	2.7912
(10,000口当たり)	(27,912)

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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の譲渡の対抗要件

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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2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2月28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	890	13,659,102
追加型公社債投資信託	16	1,318,207
単位型株式投資信託	66	318,052
単位型公社債投資信託	13	71,887
合計	985	15,367,247

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	2	3,990,054
その他未払金	2	4,330,584	2	3,961,765
未払費用	2	4,388,803	2	3,803,995
未払消費税等		99,010		194,852
未払法人税等		736,829		573,657
賞与引当金		906,167		901,135

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	2 28,533,952
広告宣伝費	730,784	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)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
					別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	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			
	資本金	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、次表には含まれておりません（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、記載しておりません。

(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、記載しておりません。

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
非積立型制度の退職給付債務	651,168	458,822
未積立退職給付債務	354,690	586,529
未認識数理計算上の差異	1,005,858	1,045,351
未認識過去勤務費用	169,893	114,968
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	550,128	484,766
	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

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第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%
長期期待運用収益率	1.5 ~ 1.8%	1.5 ~ 1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度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

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第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
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	664,152 千円	未払費用	348,142 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)	5,852,112 千円	未払手数料	921,796 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(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,298,064 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. (株)三菱東京UFJ銀行は、平成30年4月1日付で、(株)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(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)	6,263,571 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	(株)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	647,817
諸経費		177,080
一般管理費合計		6,358,399
営業利益		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
受取賃貸料		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	12,337
その他		175
営業外費用合計		58,970
経常利益		7,031,318
特別利益		
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		利益剰余金合計	
						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	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 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

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
	小計	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	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	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して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

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
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。

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2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11月 1日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年11月 1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3月11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
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式セレクション（ラップ向け）の平成31年2月6日から令和2年2月5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、国内株式セレクション（ラップ向け）の令和2年2月5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続が実施される。中間監査手続は、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続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。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。