

【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9月24日提出
【計算期間】	第3期(自 2019年6月26日至 2020年6月25日)
【ファンド名】	つみたて8資産均等バランス
【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、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）およびＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の各対象インデックスを12.5%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	ＭＭＦ	インデックス型
	海外	債券	ＭＲＦ	
追加型	内外	不動産投信	ＥＴＦ	特殊型 （ ）
		その他資産 （ ）		
		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	グローバル （日本を含む）	ファミリー ファンド	あり （ ）	日経２２５	ブル・ベア型
	年２回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	ＴＯＰＩＸ	条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 （ ）	年４回 年６回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （ ）	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			その他 （合成ベンチ マーク）	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
不動産投信						その他 （ ）

その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株 式、債券、不動 産投信））） 資産複合 （ ）						
---	--	--	--	--	--	--

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

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

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

商品分類の定義

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

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

特色

1

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

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

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)およびS&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)の各対象インデックス(以下「ベンチマーク」という場合があります。)を12.5%ずつ組み合わせた合成指数をいいます。

特色

2

主として対象インデックスに採用されている日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。)、公社債および不動産投資信託証券(リート)に投資を行います。

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

※実際の運用は各マザーファンドを通じて行います。

■ DR(預託証券)とは、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

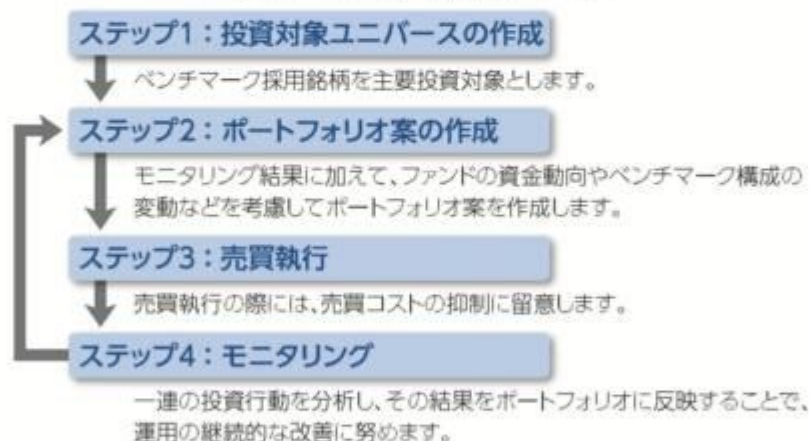
<基本投資割合>



<各マザーファンドの主要投資対象と運用目標および基本投資割合>

	主要投資対象	運用目標	基本投資割合
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
新興国株式インデックスマザーファンド	新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動した投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
東証REIT指数マザーファンド	国内不動産投資信託証券	東証REIT指数(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%
MUAM G-REITマザーファンド	先進国不動産投資信託証券	S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。	12.5%

<各マザーファンドの運用プロセス>



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

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

特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。



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

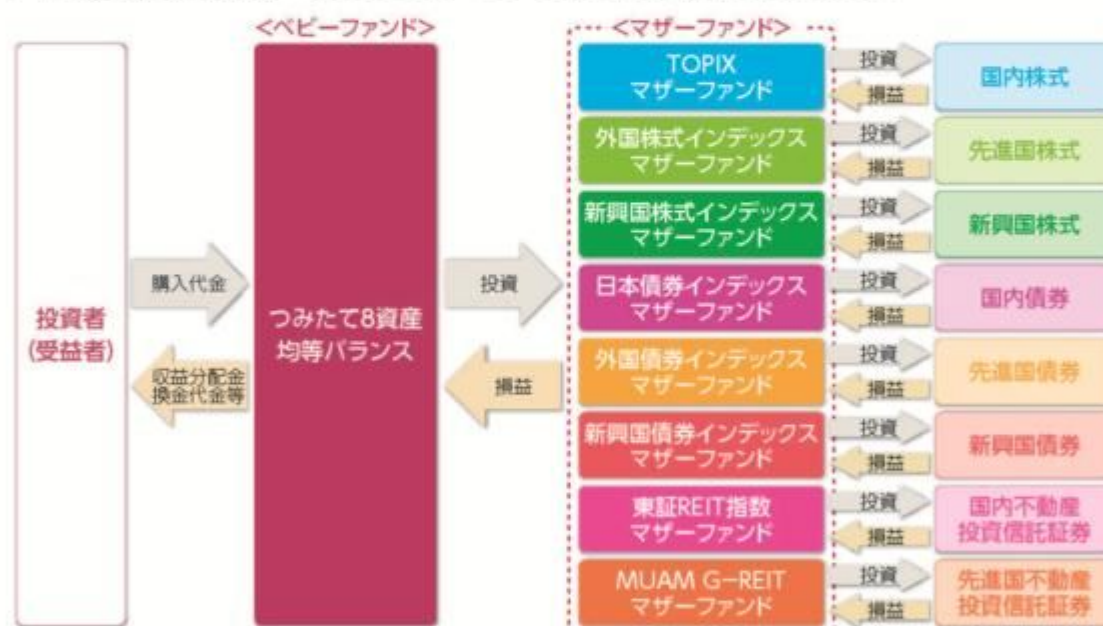
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

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



■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを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。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。



指数について

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

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

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

・JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

・東証REIT指数(配当込み)とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。

東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。

・S&P先進国REITインデックスとは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。

S&P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REITインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任を負いません。

(2)【ファンドの沿革】

2017年8月16日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家(受益者)

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
------	--

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

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

投資↓↑損益

マザーファンド

投資↓↑損益

有価証券等

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	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6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】

ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド受益証券およびＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として対象インデックスに採用されている日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の１口当たりの純資産額の変動率を合成ベンチマークの変動率に連動させることを目的とした運用を行います。このほか、日本を含む世界各国の株式（ＤＲ（預託証書）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

国内株式、先進国株式、新興国株式、国内債券、先進国債券、新興国債券、国内不動産投資信託証券および先進国不動産投資信託証券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ12.5%とします。

合成ベンチマークとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

- ２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲

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

- １．株券または新株引受権証書

- ２．国債証券

- ３．地方債証券

- ４．特別の法律により法人の発行する債券

- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

- ６．資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）

- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるものの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの

23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの
7. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から6. に該当するものを除きます。）
8. 外国の者に対する権利で7. の権利の性質を有するもの
9. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
10. 外国法人の社員権で9. の権利の性質を有するもの
11. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号で定めるものをいいます。）
12. 外国の法令に基づく権利であって、11. の権利に類するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

< マザーファンドの概要 >

ＴＯＰＩＸマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

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

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

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

投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

新興国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

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

投資態度

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

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

日本債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

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

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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

外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

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

投資態度

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

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

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

５％以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

新興国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の１０％以下とします。

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

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

投資態度

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

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

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

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

MUAM G - REITマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

（運用方法）

投資対象

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

投資態度

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

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への直接投資は行いません。

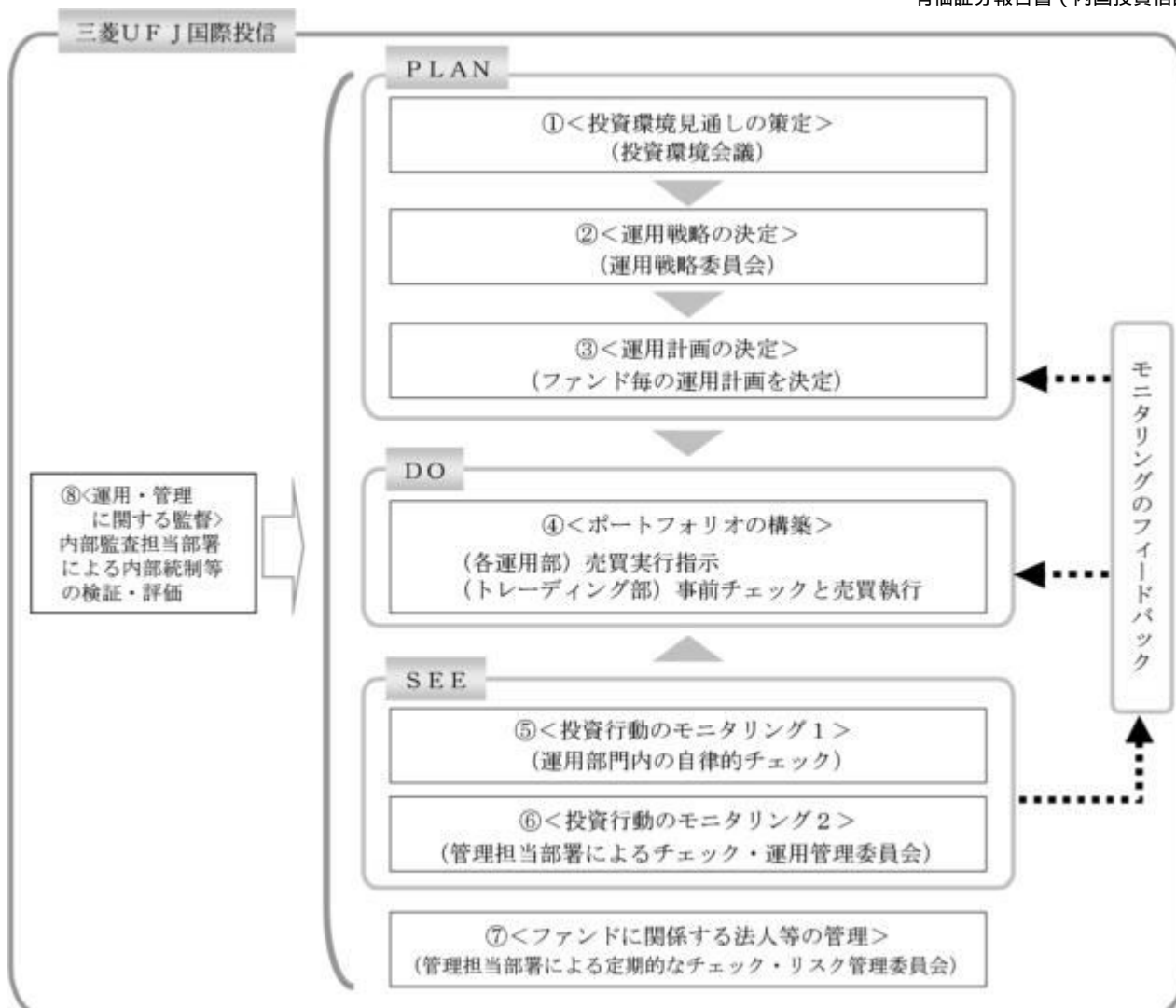
投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（３）【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

a．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

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

新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

投資信託証券

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

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

同一銘柄の転換社債等

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

せん。

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

スワップ取引

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

信用取引

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

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

有価証券の借入れ

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

資金の借入れ

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

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

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

投資する株式等の範囲

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

金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引

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

有価証券の貸付

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

有価証券の空売り

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

デリバティブ取引等

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

信用リスクの分散規制

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3【投資リスク】

（１）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なりスクであり、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し、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、ファンドはその影響を受け組入株式や組入公社債、組入不動産投資信託証券の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動 リスク	組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。
信用リスク	組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。
流動性 リスク	有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。また、不動産投資信託証券は、株式と比べ市場規模が小さく、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。
カントリー・ リスク	新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

留意事項

- ・ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、合成ベンチマークの動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。
- ・不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的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。

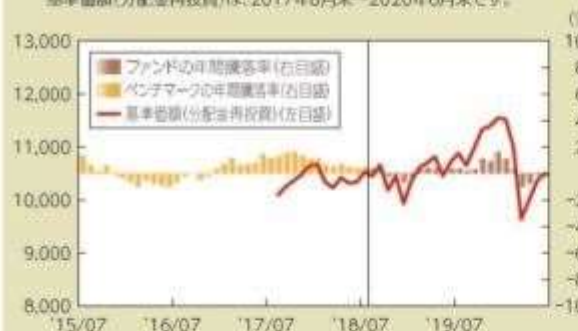
* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■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。

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2018年8月～2020年6月です。
ベンチマークの年間騰落率は、2015年7月～2018年7月です。
基準価額(分配金再投資)は、2017年8月末～2020年6月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2015年7月末～2020年6月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2018年7月以前)の年間騰落率を含みます。



ファンド：日本株・先進国株・新興国株・日本国債・先進国債・新興国債

(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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。

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

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

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）
上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6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	0.10%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.10%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

個別元本について

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

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

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

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6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】

【つみたて8資産均等バランス】

（１）【投資状況】

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	22,222,884,746	99.00
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	224,114,883	1.00
純資産総額		22,446,999,629	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 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	1,285,729,078	2.1873	2,812,329,591	2.2034	2,832,975,450	12.62
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	1,214,384,890	2.3486	2,852,104,352	2.3320	2,831,945,563	12.62
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	2,118,612,156	1.3249	2,807,071,036	1.3296	2,816,906,722	12.55
日本	親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	1,929,982,838	1.4425	2,784,153,474	1.4590	2,815,844,960	12.54

日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	983,644,519	2.8316	2,785,295,043	2.8547	2,808,010,008	12.51
日本	親投資信託受益証券	ＴＯＰＩＸマザーファンド	1,598,806,395	1.7410	2,783,555,517	1.7403	2,782,402,769	12.40
日本	親投資信託受益証券	東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド	973,850,254	2.8420	2,767,761,522	2.8256	2,751,711,277	12.26
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	1,920,939,985	1.3465	2,586,737,782	1.3447	2,583,087,997	11.51

（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 6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.00
合計	99.00

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

【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6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 6月25日）	1,719,844,704	1,719,844,704	10,352	10,352
第2計算期間末日（令和 1年 6月25日）	9,447,668,345	9,447,668,345	10,710	10,710
第3計算期間末日（令和 2年 6月25日）	22,121,755,856	22,121,755,856	10,490	10,490
令和 1年 6月末日	9,618,335,936	—	10,717	—
7月末日	10,668,100,541	—	10,885	—
8月末日	11,347,174,486	—	10,654	—
9月末日	12,576,591,036	—	10,982	—
10月末日	14,006,953,145	—	11,331	—
11月末日	15,058,524,400	—	11,391	—
12月末日	16,108,871,096	—	11,546	—

令和 2年 1月末日	17,582,050,557	—	11,528	—
2月末日	17,838,726,720	—	11,009	—
3月末日	16,871,590,580	—	9,644	—
4月末日	18,814,434,198	—	9,997	—
5月末日	20,857,888,507	—	10,357	—
6月末日	22,446,999,629	—	10,510	—

【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	3.52
第2計算期間	3.45
第3計算期間	2.05

（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	1,686,339,471	24,944,050	1,661,395,421
第2計算期間	7,483,220,180	323,353,612	8,821,261,989
第3計算期間	13,287,635,933	1,020,666,967	21,088,230,955

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	287,757,481,530	99.14

コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,483,303,938	0.86
純資産総額		290,240,785,468	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 6月30日現在
（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,493,600,000	0.86

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 3 0 銘柄

令和 2年 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,468,000	6,903.42	10,134,224,242	6,762.00	9,926,616,000	3.42
日本	株式	ソニー	電気機器	824,200	6,558.11	5,405,197,093	7,384.00	6,085,892,800	2.10
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,024,400	4,226.69	4,329,826,488	5,450.00	5,582,980,000	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	119,200	35,223.53	4,198,645,244	45,030.00	5,367,576,000	1.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,725,800	2,508.22	4,328,698,235	2,515.50	4,341,249,900	1.50
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,094,700	3,399.78	3,721,740,416	3,848.00	4,212,405,600	1.45
日本	株式	任天堂	その他製品	80,700	40,214.69	3,245,325,708	48,010.00	3,874,407,000	1.33
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	8,876,800	447.37	3,971,228,990	421.60	3,742,458,880	1.29
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	900,700	3,140.47	2,828,628,867	3,682.00	3,316,377,400	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	376,500	7,353.13	2,768,455,972	8,806.00	3,315,459,000	1.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	941,200	3,238.06	3,047,668,976	3,234.00	3,043,840,800	1.05
日本	株式	ダイキン工業	機械	167,600	14,174.74	2,375,686,950	17,335.00	2,905,346,000	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,035,900	2,603.18	2,696,642,860	2,755.50	2,854,422,450	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	221,300	10,974.99	2,428,766,355	12,595.00	2,787,273,500	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	897,500	2,954.31	2,651,500,462	3,032.00	2,721,220,000	0.94
日本	株式	花王	化学	315,000	8,592.36	2,706,594,340	8,540.00	2,690,100,000	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	261,000	9,103.15	2,375,922,341	10,260.00	2,677,860,000	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	923,200	3,176.10	2,932,180,024	2,882.00	2,660,662,400	0.92

日本	株式	村田製作所	電気機器	386,500	5,562.93	2,150,074,821	6,316.00	2,441,134,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	123,700	15,638.19	1,934,445,050	19,260.00	2,382,462,000	0.82
日本	株式	中外製薬	医薬品	411,500	3,953.91	1,627,035,090	5,765.00	2,372,297,500	0.82
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,633,000	134.39	2,369,726,860	132.20	2,331,082,600	0.80
日本	株式	S M C	機械	41,300	46,580.75	1,923,785,000	55,180.00	2,278,934,000	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	316,600	5,703.76	1,805,812,750	7,196.00	2,278,253,600	0.78
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	83,500	21,387.35	1,785,843,997	26,440.00	2,207,740,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	458,800	5,010.83	2,298,969,063	4,698.00	2,155,442,400	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	632,200	3,224.21	2,038,347,850	3,403.00	2,151,376,600	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	906,400	2,298.14	2,083,039,510	2,321.50	2,104,207,600	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,140,800	1,670.03	1,905,176,365	1,799.50	2,052,869,600	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	849,600	2,453.37	2,084,384,711	2,270.00	1,928,592,000	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 6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.19
	建設業	2.57
	食料品	3.90
	繊維製品	0.50
	パルプ・紙	0.23
	化学	7.24
	医薬品	6.84
	石油・石炭製品	0.42
	ゴム製品	0.62
	ガラス・土石製品	0.76
	鉄鋼	0.56
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.54
	機械	5.23
	電気機器	14.98
	輸送用機器	7.21
	精密機器	2.62
	その他製品	2.47
	電気・ガス業	1.54
	陸運業	3.98
	海運業	0.13
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.88

卸売業	4.43
小売業	4.94
銀行業	4.90
証券、商品先物取引業	0.78
保険業	1.98
その他金融業	1.12
不動産業	2.00
サービス業	5.25
小計	99.14
合計	99.14

（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 6月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ ２０年０９月限	買建	160	円	2,512,013,000	2,493,600,000	0.86

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

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	313,270,928,432	66.30
	イギリス	21,848,577,960	4.62
	スイス	16,074,902,770	3.40
	フランス	15,827,632,218	3.35
	カナダ	15,372,319,920	3.25
	ドイツ	14,159,716,750	3.00
	オーストラリア	9,713,861,606	2.06
	オランダ	7,940,411,230	1.68
	香港	4,810,922,579	1.02
	スウェーデン	4,787,170,894	1.01
	スペイン	3,779,750,005	0.80

	デンマーク	3,662,171,513	0.78
	イタリア	3,011,690,764	0.64
	フィンランド	1,584,585,807	0.34
	シンガポール	1,460,465,683	0.31
	ベルギー	1,420,659,266	0.30
	アイルランド	1,026,505,477	0.22
	ノルウェー	811,875,257	0.17
	ニュージーランド	501,879,314	0.11
	イスラエル	478,490,706	0.10
	ルクセンブルグ	348,426,562	0.07
	オーストリア	265,344,082	0.06
	ポルトガル	264,328,842	0.06
	小計	442,422,617,637	93.64
投資証券	アメリカ	9,330,722,928	1.97
	オーストラリア	615,565,057	0.13
	シンガポール	266,024,173	0.06
	イギリス	263,162,200	0.06
	香港	204,462,258	0.04
	フランス	176,400,774	0.04
	オランダ	99,640,248	0.02
	カナダ	84,452,718	0.02
	小計	11,040,430,356	2.34
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	19,032,662,241	4.02
純資産総額		472,495,710,234	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 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,706,197,455	2.48
	買建	カナダ	538,278,072	0.11
	買建	ドイツ	2,122,251,494	0.45
	買建	オーストラリア	568,453,037	0.12
	買建	イギリス	764,360,745	0.16
	買建	スイス	579,327,492	0.12

（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 6月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	484,116	34,083.54	16,500,391,407	38,978.17	18,869,959,233	3.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	799,398	20,136.60	16,097,162,563	21,379.92	17,091,069,765	3.62
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	46,814	260,576.73	12,198,639,122	288,784.14	13,519,140,786	2.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	46,060	151,675.29	6,986,164,070	150,531.09	6,933,462,273	1.47
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	266,185	23,113.46	6,152,456,936	23,771.75	6,327,684,232	1.34
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	291,479	16,057.56	4,680,444,330	14,980.16	4,366,404,855	0.92
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	329,283	11,942.44	3,932,444,315	11,879.04	3,911,566,719	0.83
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	188,724	19,894.19	3,754,511,302	20,619.28	3,891,353,225	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	273,163	12,439.66	3,398,054,953	12,676.68	3,462,802,233	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	339,976	9,773.09	3,322,617,881	10,019.81	3,406,498,324	0.72
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	104,969	31,253.21	3,280,619,166	31,218.74	3,277,000,171	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	120,665	25,613.03	3,090,596,289	26,516.96	3,199,670,040	0.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	21,055	151,300.82	3,185,638,860	150,294.06	3,164,441,598	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	98,984	30,513.04	3,020,303,286	31,560.27	3,123,962,577	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	473,171	6,501.03	3,076,099,623	6,278.00	2,970,572,175	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	153,306	18,988.09	2,910,989,291	19,090.45	2,926,680,620	0.62
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	77,764	38,917.11	3,026,350,188	37,526.76	2,918,231,664	0.62
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	457,189	6,087.31	2,783,051,172	5,892.30	2,693,895,019	0.57
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	67,715	35,278.38	2,388,875,881	39,648.32	2,684,785,989	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	793,287	3,179.40	2,522,182,558	3,222.50	2,556,370,055	0.54
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	53,346	40,219.34	2,145,541,019	45,703.30	2,438,088,669	0.52
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	199,715	11,714.57	2,339,575,387	12,015.16	2,399,608,638	0.51

アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	48,543	47,323.71	2,297,235,223	48,185.63	2,339,075,406	0.50
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	469,395	4,706.08	2,209,011,923	4,972.20	2,333,926,288	0.49
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	280,717	8,420.95	2,363,906,179	8,201.16	2,302,207,502	0.49
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	237,885	9,467.45	2,252,165,866	9,439.15	2,245,432,531	0.48
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	123,297	15,626.60	1,926,714,084	18,138.02	2,236,364,562	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	468,161	4,943.11	2,314,171,882	4,775.03	2,235,486,003	0.47
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	868,844	2,445.69	2,124,930,033	2,520.03	2,189,520,417	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	153,672	14,463.01	2,222,560,840	14,122.55	2,170,241,917	0.46

（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 6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	3.32
	素材	4.12
	資本財	5.94
	商業・専門サービス	1.17
	運輸	1.77
	自動車・自動車部品	1.12
	耐久消費財・アパレル	1.68
	消費者サービス	1.41
	メディア・娯楽	6.26
	小売	5.74
	食品・生活必需品小売り	1.48
	食品・飲料・タバコ	4.42
	家庭用品・パーソナル用品	2.09
	ヘルスケア機器・サービス	5.09
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.64
	銀行	5.25
	各種金融	4.14
	保険	3.06
	不動産	0.47
	ソフトウェア・サービス	11.77
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.48

	電気通信サービス		2.12
	公益事業		3.36
	半導体・半導体製造装置		3.73
	小計		93.64
投資証券	—		2.34
合計			95.97

（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 6月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2009	買建	713	アメリカドル	109,742,349.24	11,823,640,707	108,652,287.5	11,706,197,455	2.48
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602009	買建	37	カナダドル	6,808,645.75	536,521,285	6,830,940	538,278,072	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2009	買建	544	ユーロ	17,465,706.6	2,114,747,755	17,527,680	2,122,251,494	0.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2009	買建	53	オーストラリアドル	7,851,645.75	580,079,588	7,694,275	568,453,037	0.12
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2009	買建	93	イギリスポンド	5,749,516.6	761,868,444	5,768,325	764,360,745	0.16
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS 1X2009	買建	51	スイスフラン	5,129,394.35	580,750,028	5,116,830	579,327,492	0.12

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

新興国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	香港	28,318,324,877	22.93
	アメリカ	19,041,448,089	15.42
	台湾	14,500,055,369	11.74
	韓国	13,768,526,625	11.15
	インド	9,615,400,462	7.78

	ブラジル	6,254,796,375	5.06
	中国	5,288,808,731	4.28
	南アフリカ	4,426,292,009	3.58
	サウジアラビア	3,210,567,619	2.60
	タイ	2,677,255,960	2.17
	マレーシア	2,087,676,406	1.69
	メキシコ	2,014,085,437	1.63
	インドネシア	1,756,112,137	1.42
	フィリピン	983,313,247	0.80
	カタール	978,307,280	0.79
	ポーランド	850,657,158	0.69
	チリ	707,637,242	0.57
	アラブ首長国連邦	611,938,200	0.50
	トルコ	538,502,994	0.44
	ハンガリー	276,645,300	0.22
	コロンビア	221,475,100	0.18
	ギリシャ	162,655,560	0.13
	チェコ	136,960,086	0.11
	イギリス	91,312,101	0.07
	小計	118,518,754,364	95.96
投資証券	メキシコ	52,880,981	0.04
	南アフリカ	46,842,208	0.04
	小計	99,723,189	0.08
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	4,893,458,086	3.96
純資産総額		123,511,935,639	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 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,671,349,978	3.78

（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 6月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	357,887	22,223.67	7,953,562,729	23,166.25	8,290,901,432	6.71
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	1,091,800	6,061.66	6,618,122,730	6,755.40	7,375,545,720	5.97
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	4,691,000	1,099.45	5,157,559,496	1,138.80	5,342,110,800	4.33
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	909,180	4,381.39	3,983,474,589	4,716.00	4,287,692,880	3.47
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	84,574	19,071.56	1,612,958,371	19,396.98	1,640,480,220	1.33
香港	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	677,300	1,914.74	1,296,858,819	2,386.63	1,616,464,499	1.31
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	18,295,550	86.40	1,580,814,391	86.59	1,584,339,743	1.28
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	543,157	2,252.53	1,223,481,283	2,481.33	1,347,755,018	1.09
香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,132,000	1,099.93	1,245,122,582	1,081.42	1,224,167,440	0.99
アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	小売	161,934	5,281.64	855,277,682	6,419.14	1,039,478,507	0.84
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	1,171,000	818.64	958,630,417	720.02	843,143,420	0.68
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	314,092	2,402.01	754,452,417	2,507.25	787,509,052	0.64
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	103,648	7,623.92	790,204,317	7,524.00	779,847,552	0.63
ブラジル	株式	VALE SA	素材	699,330	970.71	678,848,418	1,108.70	775,351,297	0.63
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	11,604,350	71.60	830,975,221	66.02	766,177,209	0.62
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	2,376,272	288.12	684,658,402	310.98	738,973,067	0.60
アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・ 娯楽	15,543	39,510.10	614,105,558	46,612.63	724,500,164	0.59
アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	52,385	10,816.16	566,604,815	13,067.78	684,555,896	0.55
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	649,044	985.82	639,842,901	1,053.72	683,910,644	0.55
アメリカ	株式	GAZPROM PJSC-SPON ADR	エネルギー	1,130,722	540.31	610,945,571	597.52	675,635,839	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	156,279	3,756.24	587,021,557	4,144.50	647,698,316	0.52
アメリカ	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	498,104	1,129.10	562,413,359	1,249.24	622,254,081	0.50
アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	76,498	7,253.32	554,864,588	8,117.13	620,944,333	0.50
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	15,203,000	40.58	617,037,004	40.17	610,719,713	0.49
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	287,236	1,519.43	436,435,243	2,062.25	592,352,441	0.48
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・ 娯楽	23,495	19,478.71	457,652,482	23,760.00	558,241,200	0.45
アメリカ	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サー ビス	73,261	5,902.02	432,388,595	7,265.98	532,313,371	0.43
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	172,110	2,796.93	481,380,502	3,026.37	520,869,573	0.42

韓国	株式	CELLTRION INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	18,115	19,246.98	348,659,170	27,990.00	507,038,850	0.41
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	157,131	2,954.88	464,304,467	3,143.44	493,933,128	0.40

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	5.81
	素材	6.61
	資本財	2.71
	商業・専門サービス	0.27
	運輸	1.47
	自動車・自動車部品	1.84
	耐久消費財・アパレル	1.16
	消費者サービス	1.60
	メディア・娯楽	9.12
	小売	12.09
	食品・生活必需品小売り	1.48
	食品・飲料・タバコ	3.50
	家庭用品・パーソナル用品	1.19
	ヘルスケア機器・サービス	1.25
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.89
	銀行	13.17
	各種金融	1.98
	保険	3.25
	不動産	2.42
	ソフトウェア・サービス	1.86
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.74
	電気通信サービス	3.73
	公益事業	2.20
	半導体・半導体製造装置	6.63
小計		95.96
投資証券	—	0.08
合計		96.04

（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 6月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 2009	買建	876	アメリカドル	43,250,324.6	4,659,789,972	43,357,620	4,671,349,978	3.78

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

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	494,852,062,070	83.25
地方債証券	日本	28,552,258,152	4.80
特殊債券	日本	39,174,883,670	6.59
社債券	日本	29,834,133,500	5.02
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,033,399,162	0.34
純資産総額		594,446,736,554	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 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	607,800,000	0.10

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和 2年 6月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第 1 3 4 回利付国債（ 5 年）	9,360,000,000	100.71	9,427,298,400	100.60	9,416,815,200	0.100000	2022/12/20	1.58
日本	国債証券	第 3 3 9 回利付国債（ 1 0 年）	6,660,000,000	102.72	6,841,351,800	102.52	6,827,965,200	0.400000	2025/6/20	1.15
日本	国債証券	第 3 3 3 回利付国債（ 1 0 年）	6,550,000,000	102.92	6,741,587,500	102.72	6,728,618,500	0.600000	2024/3/20	1.13
日本	国債証券	第 3 4 2 回利付国債（ 1 0 年）	6,440,000,000	101.32	6,525,008,000	101.20	6,517,795,200	0.100000	2026/3/20	1.10
日本	国債証券	第 3 5 8 回利付国債（ 1 0 年）	6,220,000,000	100.98	6,281,084,800	100.72	6,265,219,400	0.100000	2030/3/20	1.05
日本	国債証券	第 3 5 6 回利付国債（ 1 0 年）	6,200,000,000	101.21	6,275,560,000	100.92	6,257,164,000	0.100000	2029/9/20	1.05
日本	国債証券	第 3 2 9 回利付国債（ 1 0 年）	5,860,000,000	103.01	6,036,386,000	102.80	6,024,255,800	0.800000	2023/6/20	1.01
日本	国債証券	第 1 4 2 回利付国債（ 5 年）	5,870,000,000	101.08	5,933,802,500	100.96	5,926,704,200	0.100000	2024/12/20	1.00
日本	国債証券	第 3 5 1 回利付国債（ 1 0 年）	5,510,000,000	101.55	5,595,460,100	101.32	5,582,787,100	0.100000	2028/6/20	0.94
日本	国債証券	第 1 3 7 回利付国債（ 5 年）	5,400,000,000	100.89	5,448,116,000	100.76	5,441,040,000	0.100000	2023/9/20	0.92
日本	国債証券	第 3 5 5 回利付国債（ 1 0 年）	5,350,000,000	101.32	5,420,887,500	100.98	5,402,804,500	0.100000	2029/6/20	0.91
日本	国債証券	第 3 4 3 回利付国債（ 1 0 年）	5,260,000,000	101.38	5,332,741,000	101.26	5,326,328,600	0.100000	2026/6/20	0.90
日本	国債証券	第 1 3 8 回利付国債（ 5 年）	5,150,000,000	100.94	5,198,513,000	100.80	5,191,303,000	0.100000	2023/12/20	0.87
日本	国債証券	第 3 5 3 回利付国債（ 1 0 年）	5,130,000,000	101.41	5,202,689,900	101.19	5,191,047,000	0.100000	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第 3 4 8 回利付国債（ 1 0 年）	5,100,000,000	101.59	5,181,090,000	101.38	5,170,431,000	0.100000	2027/9/20	0.87
日本	国債証券	第 3 3 2 回利付国債（ 1 0 年）	5,040,000,000	102.75	5,178,902,400	102.54	5,168,268,000	0.600000	2023/12/20	0.87
日本	国債証券	第 3 5 0 回利付国債（ 1 0 年）	5,070,000,000	101.58	5,150,207,400	101.35	5,138,850,600	0.100000	2028/3/20	0.86
日本	国債証券	第 3 5 4 回利付国債（ 1 0 年）	5,000,000,000	101.36	5,068,188,000	101.09	5,054,600,000	0.100000	2029/3/20	0.85
日本	国債証券	第 1 3 1 回利付国債（ 5 年）	5,010,000,000	100.51	5,035,551,000	100.43	5,031,543,000	0.100000	2022/3/20	0.85
日本	国債証券	第 1 3 0 回利付国債（ 5 年）	4,950,000,000	100.44	4,971,879,000	100.38	4,968,958,500	0.100000	2021/12/20	0.84
日本	国債証券	第 1 3 3 回利付国債（ 5 年）	4,900,000,000	100.65	4,931,850,000	100.54	4,926,754,000	0.100000	2022/9/20	0.83
日本	国債証券	第 4 0 9 回利付国債（ 2 年）	4,800,000,000	100.48	4,823,160,000	100.41	4,819,872,000	0.100000	2022/2/1	0.81
日本	国債証券	第 3 4 4 回利付国債（ 1 0 年）	4,660,000,000	101.44	4,727,117,000	101.28	4,719,787,800	0.100000	2026/9/20	0.79
日本	国債証券	第 3 4 6 回利付国債（ 1 0 年）	4,590,000,000	101.45	4,656,878,100	101.35	4,652,056,800	0.100000	2027/3/20	0.78
日本	国債証券	第 3 3 5 回利付国債（ 1 0 年）	4,470,000,000	102.82	4,596,366,900	102.65	4,588,544,400	0.500000	2024/9/20	0.77
日本	国債証券	第 3 4 5 回利付国債（ 1 0 年）	4,440,000,000	101.49	4,506,511,200	101.30	4,497,808,800	0.100000	2026/12/20	0.76
日本	国債証券	第 3 3 4 回利付国債（ 1 0 年）	4,330,000,000	103.09	4,464,100,100	102.91	4,456,132,900	0.600000	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第 3 5 7 回利付国債（ 1 0 年）	4,400,000,000	101.06	4,446,889,300	100.80	4,435,332,000	0.100000	2029/12/20	0.75
日本	国債証券	第 3 4 1 回利付国債（ 1 0 年）	4,270,000,000	102.42	4,373,675,600	102.25	4,366,331,200	0.300000	2025/12/20	0.73

日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	4,290,000,000	101.54	4,356,304,000	101.39	4,349,673,900	0.100000	2027/12/20	0.73
----	------	----------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	----------	------------	------

（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 6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	83.25
地方債証券	4.80
特殊債券	6.59
社債券	5.02
合計	99.66

（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 6月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物２０年０９月限	買建	4	円	606,564,400	607,800,000	0.10

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

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	71,741,897,350	44.92
	フランス	16,006,933,049	10.02
	イタリア	14,391,342,443	9.01
	ドイツ	11,632,407,790	7.28
	イギリス	10,297,987,680	6.45
	スペイン	9,559,131,193	5.99
	ベルギー	4,002,947,422	2.51
	オーストラリア	3,358,553,135	2.10
	オランダ	3,083,689,706	1.93

	カナダ	3,016,985,553	1.89
	オーストリア	2,495,634,544	1.56
	メキシコ	1,214,445,954	0.76
	アイルランド	1,196,632,366	0.75
	フィンランド	957,263,733	0.60
	ポーランド	930,158,337	0.58
	デンマーク	800,759,297	0.50
	マレーシア	750,918,988	0.47
	シンガポール	711,696,413	0.45
	イスラエル	579,641,353	0.36
	スウェーデン	432,605,136	0.27
	ノルウェー	311,256,945	0.19
	小計	157,472,888,387	98.60
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,228,774,966	1.40
純資産総額		159,701,663,353	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 6月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 230515	12,700,000	10,756.97	1,366,136,090	10,760.11	1,366,534,177	0.125000	2023/5/15	0.86
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 210815	11,660,000	11,125.41	1,297,223,689	11,086.69	1,292,709,046	2.750000	2021/8/15	0.81
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	9,250,000	12,970.81	1,199,800,721	13,043.27	1,206,502,822	3.125000	2028/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 231115	8,050,000	11,704.09	942,179,986	11,698.20	941,705,678	2.750000	2023/11/15	0.59
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	6,850,000	12,963.15	887,975,975	12,944.50	886,698,620	1.750000	2023/5/25	0.56
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 250131	7,600,000	11,289.97	858,037,993	11,321.95	860,468,877	1.375000	2025/1/31	0.54
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 220831	7,640,000	11,121.62	849,692,520	11,115.73	849,242,369	1.625000	2022/8/31	0.53
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 241115	7,250,000	11,691.47	847,631,824	11,713.35	849,218,464	2.250000	2024/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 240131	7,300,000	11,555.95	843,584,841	11,565.21	844,260,741	2.250000	2024/1/31	0.53
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	6,570,000	11,832.88	777,420,359	11,874.96	780,185,405	2.250000	2025/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 220531	6,760,000	11,144.35	753,358,483	11,127.52	752,220,479	1.875000	2022/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240131	6,400,000	11,652.75	745,776,280	11,656.12	745,991,760	2.500000	2024/1/31	0.47
ドイツ	国債証券	0.25 BUND 290215	5,700,000	13,022.48	742,281,413	12,995.18	740,725,801	0.250000	2029/2/15	0.46

アメリカ	国債証券	3.625 T-BOND 440215	4,550,000	15,648.39	712,001,894	15,862.18	721,729,637	3.625000	2044/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	3 T-BOND 441115	4,900,000	14,302.48	700,821,765	14,507.02	710,844,109	3.000000	2044/11/15	0.45
フランス	国債証券	3 0.A.T 220425	5,500,000	12,950.64	712,285,428	12,911.48	710,131,778	3.000000	2022/4/25	0.44
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 250831	5,840,000	12,096.34	706,426,265	12,123.27	707,999,269	2.750000	2025/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 240215	5,960,000	11,765.54	701,226,463	11,766.38	701,276,629	2.750000	2024/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 221130	6,200,000	11,260.51	698,151,832	11,250.41	697,525,594	2.000000	2022/11/30	0.44
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260515	5,980,000	11,502.08	687,824,449	11,555.11	690,995,877	1.625000	2026/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 290215	5,320,000	12,555.91	667,974,869	12,645.14	672,721,489	2.625000	2029/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 300215	5,750,000	11,538.41	663,458,846	11,665.38	670,759,358	1.500000	2030/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 211031	6,000,000	10,981.48	658,889,020	10,963.80	657,828,454	1.500000	2021/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	3.125 T-BOND 440815	4,450,000	14,564.25	648,109,549	14,778.05	657,623,496	3.125000	2044/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 260815	5,700,000	11,428.85	651,444,860	11,490.30	654,947,251	1.500000	2026/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	3.375 T-BOND 440515	4,240,000	15,113.06	640,793,750	15,323.48	649,715,969	3.375000	2044/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	5,160,000	12,521.54	646,111,608	12,583.69	649,318,678	2.750000	2028/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 211231	5,850,000	11,088.80	648,694,964	11,068.60	647,513,191	2.000000	2021/12/31	0.41
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	5,060,000	12,706.58	642,953,264	12,775.60	646,445,723	2.875000	2028/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	3.75 T-BOND 431115	3,950,000	15,904.57	628,230,862	16,120.59	636,763,601	3.750000	2043/11/15	0.40

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.60
合計	98.60

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

新興国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	インドネシア	3,001,436,490	9.50
	メキシコ	2,957,554,229	9.36
	タイ	2,891,965,163	9.15
	ブラジル	2,804,882,948	8.88
	ロシア	2,700,255,862	8.54
	ポーランド	2,503,382,071	7.92
	南アフリカ	2,295,754,838	7.26
	マレーシア	2,020,577,605	6.39
	コロンビア	1,705,976,436	5.40
	チェコ	1,462,820,800	4.63
	ハンガリー	1,108,281,933	3.51
	ペルー	1,071,182,120	3.39
	トルコ	940,269,401	2.98
	ルーマニア	918,774,106	2.91
	中国	914,240,329	2.89
	チリ	771,088,565	2.44
	フィリピン	53,523,050	0.17
	ドミニカ共和国	40,202,510	0.13
	ウルグアイ	37,271,652	0.12
	小計	30,199,440,108	95.56
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,403,488,192	4.44
純資産総額		31,602,928,300	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 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (％)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (％)
ブラジル	国債証券	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	25,700,000	2,258.41	580,411,545	2,360.26	606,588,785	10.000000	2023/1/1	1.92
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 230701	26,700,000	1,650.45	440,672,394	1,738.52	464,186,709	—	2023/7/1	1.47
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	18,550,000	2,320.22	430,402,535	2,427.38	450,280,123	10.000000	2025/1/1	1.42
南アフリカ	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	61,100,000	697.94	426,445,673	712.15	435,124,445	10.500000	2026/12/21	1.38
ブラジル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	14,770,000	2,377.07	351,094,043	2,453.42	362,370,203	10.000000	2027/1/1	1.15
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 220701	17,800,000	1,782.89	317,356,153	1,857.25	330,591,460	—	2022/7/1	1.05

メキシコ	国債証券	6.5 MEXICAN BONOS 220609	67,200,000	467.16	313,937,795	481.93	323,860,170	6.500000	2022/6/9	1.02
コロンビア	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	8,900,000,000	3.41	303,614,631	3.52	313,804,414	10.000000	2024/7/24	0.99
メキシコ	国債証券	7.5 MEXICAN BONOS 270603	59,700,000	483.06	288,387,574	518.83	309,747,325	7.500000	2027/6/3	0.98
メキシコ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	51,900,000	531.93	276,074,273	560.35	290,822,179	10.000000	2024/12/5	0.92
メキシコ	国債証券	8.5 MEXICAN BONOS 290531	52,200,000	523.82	273,438,229	551.21	287,735,493	8.500000	2029/5/31	0.91
インドネシア	国債証券	5.625 INDONESIA 230515	38,200,000,000	0.75	288,226,200	0.75	287,329,704	5.625000	2023/5/15	0.91
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 260725	9,600,000	2,788.04	267,652,382	2,962.08	284,360,535	2.500000	2026/7/25	0.90
南アフリカ	国債証券	8.75 SOUTH AFRICA 480228	55,300,000	535.44	296,103,401	495.28	273,892,605	8.750000	2048/2/28	0.87
南アフリカ	国債証券	8 SOUTH AFRICA 300131	46,700,000	573.66	267,900,496	577.52	269,705,967	8.000000	2030/1/31	0.85
インドネシア	国債証券	6.125 INDONESIA 280515	37,700,000,000	0.72	273,353,737	0.71	269,472,060	6.125000	2028/5/15	0.85
タイ	国債証券	3.775 THAILAND 320625	61,000,000	435.45	265,625,921	435.53	265,675,990	3.775000	2032/6/25	0.84
インドネシア	国債証券	8.375 INDONESIA 240315	32,700,000,000	0.82	270,787,392	0.81	265,096,284	8.375000	2024/3/15	0.84
タイ	国債証券	3.4 THAILAND 360617	60,000,000	439.84	263,906,955	436.62	261,972,697	3.400000	2036/6/17	0.83
ブラジル	国債証券	BRAZIL-LTN 220101	13,600,000	1,814.86	246,822,302	1,907.09	259,364,816	—	2022/1/1	0.82
コロンビア	国債証券	7.5 TITULOS DE TE 260826	7,770,000,000	3.18	247,383,070	3.24	252,406,658	7.500000	2026/8/26	0.80
タイ	国債証券	4.875 THAILAND 290622	54,800,000	456.01	249,894,107	454.38	249,001,479	4.875000	2029/6/22	0.79
メキシコ	国債証券	8 MEXICAN BONOS 231207	48,300,000	486.03	234,756,354	513.76	248,150,746	8.000000	2023/12/7	0.79
ロシア	国債証券	7.75 RUSSIA OFZ 260916	139,600,000	169.55	236,697,384	175.25	244,651,792	7.750000	2026/9/16	0.77
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 240425	8,100,000	2,813.20	227,869,996	2,927.23	237,106,291	2.500000	2024/4/25	0.75
ポーランド	国債証券	2.5 POLAND 270725	7,700,000	2,785.35	214,472,215	2,961.18	228,011,299	2.500000	2027/7/25	0.72
コロンビア	国債証券	7 TITULOS DE TES0 220504	7,410,000,000	3.00	222,906,126	3.06	227,115,319	7.000000	2022/5/4	0.72
マレーシア	国債証券	3.955 MALAYSIA GOV 250915	8,400,000	2,632.15	221,101,272	2,690.92	226,037,448	3.955000	2025/9/15	0.72
ポーランド	国債証券	2.75 POLAND 291025	7,400,000	2,914.75	215,691,564	3,052.93	225,916,973	2.750000	2029/10/25	0.71
ポーランド	国債証券	2.75 POLAND 280425	7,400,000	2,833.59	209,685,953	3,014.13	223,045,854	2.750000	2028/4/25	0.71

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	95.56
合計	95.56

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

東証REIT指数マザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
投資証券	日本	31,864,720,210	98.58
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	457,583,626	1.42
純資産総額		32,322,303,836	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 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	519,435,000	1.61

（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 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (％)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	3,576	804,635.17	2,877,375,374	614,000	2,195,664,000	6.79
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,693	731,783.14	2,702,475,159	553,000	2,042,229,000	6.32
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	5,557	293,423.51	1,630,554,477	328,000	1,822,696,000	5.64
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	11,921	168,469.27	2,008,322,276	129,400	1,542,577,400	4.77

日本	投資証券	G L P 投資法人	9,556	132,864.26	1,269,650,897	156,500	1,495,514,000	4.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	5,269	271,930.72	1,432,803,011	254,000	1,338,326,000	4.14
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3,502	329,674.84	1,154,521,322	321,500	1,125,893,000	3.48
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	7,358	206,635.74	1,520,425,775	141,400	1,040,421,200	3.22
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	8,291	171,501.32	1,421,917,513	115,800	960,097,800	2.97
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	6,979	202,095.15	1,410,422,120	134,500	938,675,500	2.90
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	4,756	161,560.46	768,381,591	173,600	825,641,600	2.55
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,427	438,713.77	1,064,758,343	316,000	766,932,000	2.37
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,227	664,956.93	815,902,160	624,000	765,648,000	2.37
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	10,797	83,772.81	904,495,072	69,200	747,152,400	2.31
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,413	275,167.63	663,979,504	292,800	706,526,400	2.19
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,850	502,187.65	929,047,163	371,500	687,275,000	2.13
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	1,142	774,595.98	884,588,620	601,000	686,342,000	2.12
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	4,249	168,904.47	717,675,106	136,200	578,713,800	1.79
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,433	159,370.25	547,118,076	166,200	570,564,600	1.77
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,896	62,552.71	744,127,104	44,500	529,372,000	1.64
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,608	337,651.91	542,944,275	322,000	517,776,000	1.60
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	852	780,594.82	665,066,791	597,000	508,644,000	1.57
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,051	503,749.87	529,441,115	480,500	505,005,500	1.56
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,985	136,307.68	543,186,126	114,400	455,884,000	1.41
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	4,521	100,535.81	454,522,398	100,400	453,908,400	1.40
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	16,198	46,494.31	753,114,971	27,790	450,142,420	1.39
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,409	198,867.84	479,072,627	186,100	448,314,900	1.39
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,312	409,893.64	537,780,457	340,500	446,736,000	1.38
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	3,416	173,027.35	591,061,441	125,200	427,683,200	1.32
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	3,140	176,144.63	553,094,158	134,000	420,760,000	1.30

（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 6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.58
合計	98.58

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

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 6月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ ２０年０９月限	買建	315	円	537,925,260	519,435,000	1.61

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

MUAM G - R E I Tマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	24,063,403,295	74.32
	オーストラリア	2,042,478,226	6.31
	イギリス	1,699,014,910	5.25
	シンガポール	1,310,782,048	4.05
	香港	612,518,859	1.89
	カナダ	610,650,021	1.89
	フランス	504,934,510	1.56
	ベルギー	389,906,177	1.20
	オランダ	286,185,797	0.88
	スペイン	167,308,946	0.52
	ニュージーランド	142,175,049	0.44
	ドイツ	88,254,950	0.27
	アイルランド	46,778,781	0.14
	韓国	16,987,275	0.05
	イスラエル	15,480,136	0.05
	イタリア	5,853,094	0.02
小計		32,002,712,074	98.84
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	376,659,494	1.16
純資産総額		32,379,371,568	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 6月30日現在

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

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	204,953	9,385.09	1,923,503,439	9,822.65	2,013,182,774	6.22
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	24,563	64,366.10	1,581,024,706	74,224.24	1,823,170,027	5.63
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	74,508	13,634.40	1,015,872,188	15,097.60	1,124,892,443	3.47
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	41,768	22,347.61	933,415,288	20,589.11	859,966,114	2.66
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	39,102	21,150.03	827,008,813	16,484.21	644,565,970	1.99
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	116,104	7,761.35	901,124,232	5,522.75	641,213,645	1.98
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	85,099	13,307.10	1,132,421,572	7,340.32	624,654,419	1.93
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	95,572	7,370.72	704,435,170	6,440.69	615,550,313	1.90
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	35,077	16,858.32	591,339,294	17,414.01	610,831,446	1.89
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	97,203	8,173.48	794,487,552	6,213.36	603,957,796	1.87
香港	投資証券	LINK REIT	566,100	1,088.73	616,330,332	884.73	500,848,483	1.55
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	446,532	994.32	443,996,381	1,110.41	495,836,456	1.53
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,194	30,470.64	554,382,944	24,395.56	443,852,968	1.37
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	151,234	3,044.95	460,501,085	2,918.67	441,403,137	1.36
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	149,923	3,366.16	504,665,228	2,928.37	439,030,495	1.36
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	103,951	5,353.69	556,522,169	3,954.05	411,028,283	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	27,340	15,530.87	424,614,053	14,484.56	396,008,023	1.22
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	331,557	1,150.81	381,559,987	1,182.78	392,160,401	1.21
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	40,230	13,516.90	543,784,978	9,661.04	388,663,872	1.20
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	102,682	3,670.71	376,916,687	3,725.64	382,557,111	1.18
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	31,823	13,501.78	429,667,332	12,015.16	382,358,589	1.18
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	35,567	10,975.76	390,375,120	9,893.76	351,891,511	1.09
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	47,438	8,096.71	384,091,957	7,204.57	341,770,572	1.06
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	50,156	7,214.43	361,847,383	6,642.17	333,144,729	1.03
アメリカ	投資証券	UDR INC	82,121	4,730.98	388,513,042	3,963.75	325,507,491	1.01
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	147,488	2,131.38	314,353,553	1,986.72	293,018,185	0.90
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	130,794	2,461.58	321,960,002	2,154.79	281,834,911	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	27,149	10,824.41	293,872,107	9,684.74	262,931,240	0.81
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	31,755	6,957.42	220,932,910	8,023.39	254,782,997	0.79
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	47,519	6,129.64	291,274,667	4,936.64	234,584,519	0.72

（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 6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.84
合計	98.84

（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

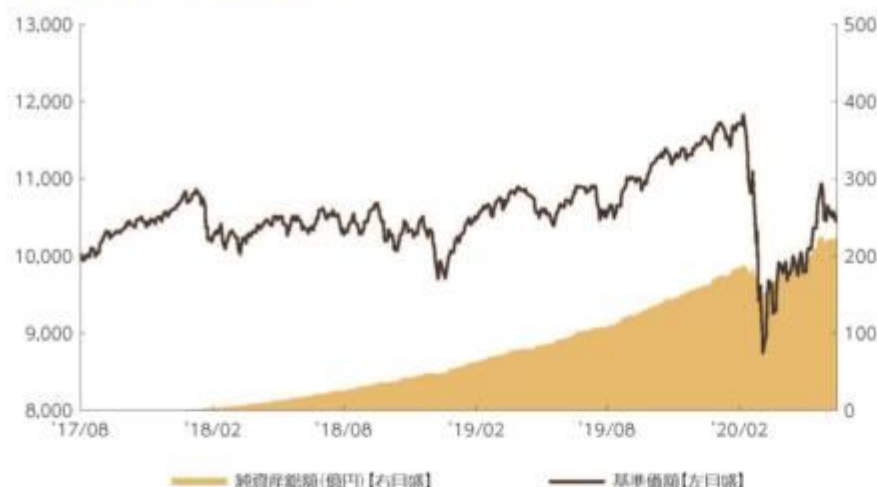


運用実績



2020年6月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年8月16日(設定日)～2020年6月30日



■基準価額・純資産

基準価額	10,510円
純資産総額	224.4億円

■分配の推移

2020年6月	0円
2019年6月	0円
2018年6月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

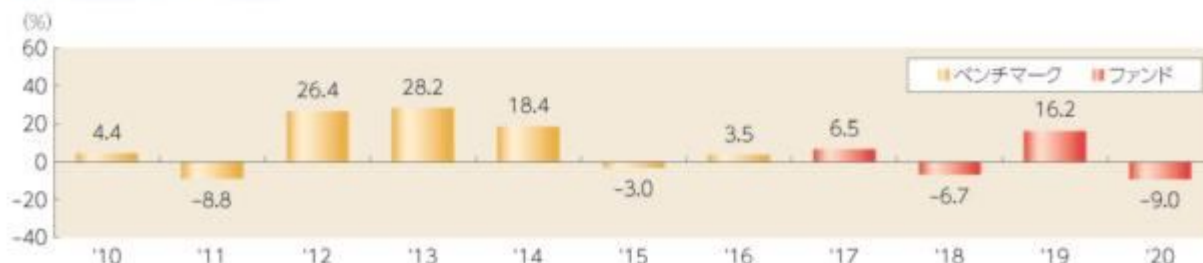
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	12.3%	1 円	37.2%	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株式	小売	アメリカ	0.8%
国内債券	11.5%	2 アメリカドル	26.4%	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	メディア・娯楽	香港	0.8%
国内リート	12.1%	3 ユーロ	7.0%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製造装置	台湾	0.5%
外国株式	23.8%	4 香港ドル	3.3%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェア・機器	アメリカ	0.5%
外国債券	24.4%	5 イギリスポンド	2.1%	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	債券	国債	ブラジル	0.2%
外国リート	12.7%	6 ブラジルレアル	1.9%	BRAZIL-LTN 230701	債券	国債	ブラジル	0.2%
		7 メキシコペソ	1.5%	第134回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.2%
		8 ニュー台湾ドル	1.5%	日本ビルファンド投資法人	リート	ー	日本	0.8%
コールローン他 (負債控除後)	3.2%	9 インドネシアルピア	1.4%	PROLOGIS INC	リート	ー	アメリカ	0.8%
合計	100.0%	10 タイバーツ	1.4%	ジャパンリアルエステイト投資法人	リート	ー	日本	0.8%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.0%
債券先物取引 (買建)	0.0%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.2%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

■年間収益率の推移



- 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6月30日までの収益率を表示
- 2016年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、１円以上１円単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

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、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

申込受付時間

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

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

取得申込みの受付の中止および取消し

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

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

オーストラリア証券取引所の休業日

シドニーの銀行の休業日

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

解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、１口単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

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６営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後３時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものの

を当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。
確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

解約請求受付の中止および取消し

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口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】

無期限（2017年8月16日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年６月26日から翌年６月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

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

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

信託約款の変更等

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

出ます。

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

ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

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

信託事務の再信託

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

の事務を行います。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、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（令和1年6月26日から令和2年6月25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】

【つみたて８資産均等バランス】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 [令和 1年 6月25日現在]	第3期 [令和 2年 6月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	109,176,835	251,395,926
親投資信託受益証券	9,353,416,918	21,899,172,716
未収入金	169,566	22,738
流動資産合計	9,462,763,319	22,150,591,380
資産合計	9,462,763,319	22,150,591,380
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,491,626	6,341,392
未払受託者報酬	769,519	2,011,979
未払委託者報酬	7,695,165	20,119,690
未払利息	212	368
その他未払費用	138,452	362,095
流動負債合計	15,094,974	28,835,524
負債合計	15,094,974	28,835,524
純資産の部		
元本等		
元本	8,821,261,989	21,088,230,955
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	626,406,356	1,033,524,901
（分配準備積立金）	231,224,841	616,299,273
元本等合計	9,447,668,345	22,121,755,856
純資産合計	9,447,668,345	22,121,755,856
負債純資産合計	9,462,763,319	22,150,591,380

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 平成30年 6月26日 至 令和 1年 6月25日	第3期 自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
営業収益		
受取利息	67	1,143
有価証券売買等損益	254,721,418	431,326,323
営業収益合計	254,721,485	431,325,180
営業費用		
支払利息	35,915	68,662
受託者報酬	1,126,045	3,379,641
委託者報酬	11,260,296	33,796,283
その他費用	203,022	608,453
営業費用合計	12,625,278	37,853,039
営業利益又は営業損失（ ）	242,096,207	469,178,219
経常利益又は経常損失（ ）	242,096,207	469,178,219
当期純利益又は当期純損失（ ）	242,096,207	469,178,219
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	5,021,914	8,186,008
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	58,449,283	626,406,356
剰余金増加額又は欠損金減少額	343,400,897	966,435,226
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	343,400,897	966,435,226
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,518,117	81,952,454
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,518,117	81,952,454
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	626,406,356	1,033,524,901

（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 [令和 1年 6月25日現在]	第3期 [令和 2年 6月25日現在]
１．期首元本額	1,661,395,421円	8,821,261,989円
期中追加設定元本額	7,483,220,180円	13,287,635,933円
期中一部解約元本額	323,353,612円	1,020,666,967円
２．受益権の総数	8,821,261,989口	21,088,230,955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 6月26日 至 令和 1年 6月25日	第3期 自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>156,156,533円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>65,534,522円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>395,181,515円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>9,533,786円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>626,406,356円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>8,821,261,989口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>710円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	156,156,533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	65,534,522円	収益調整金額	C	395,181,515円	分配準備積立金額	D	9,533,786円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	626,406,356円	当ファンドの期末残存口数	F	8,821,261,989口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	710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	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>401,361,997円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>525,895,500円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>214,937,276円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>1,142,194,773円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>21,088,230,955口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>541円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	401,361,997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	525,895,500円	分配準備積立金額	D	214,937,276円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,142,194,773円	当ファンドの期末残存口数	F	21,088,230,955口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	541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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	156,156,533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	65,534,522円																																																											
収益調整金額	C	395,181,515円																																																											
分配準備積立金額	D	9,533,786円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	626,406,356円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	8,821,261,989口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	710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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	401,361,997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	525,895,500円																																																											
分配準備積立金額	D	214,937,276円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,142,194,773円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	21,088,230,955口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	541円																																																											
1万口当たり分配金額	H	—円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円																																																											

（金融商品に関する注記）

１ 金融商品の状況に関する事項

区分	第2期 自 平成30年 6月26日 至 令和 1年 6月25日	第3期 自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 [令和 1年 6月25日現在]	第3期 [令和 2年 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

区分	第2期 [令和 1年 6月25日現在]	第3期 [令和 2年 6月25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 [令和 1年 6月25日現在]	第3期 [令和 2年 6月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	255,727,015	314,294,571
合計	255,727,015	314,294,571

（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 [令和 1年 6月25日現在]	第3期 [令和 2年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.0710円	1.0490円
(1万口当たり純資産額)	(10,710円)	(10,490円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益 証券	MUAM G - REITマザーファンド	1,867,039,553	2,693,764,667	
	新興国株式インデックスマザーファンド	1,214,384,890	2,852,104,352	
	東証REIT指数マザーファンド	969,598,069	2,755,791,631	
	新興国債券インデックスマザーファンド	2,094,889,973	2,775,729,214	
	TOPIXマザーファンド	1,573,011,742	2,738,928,045	
	外国株式インデックスマザーファンド	966,190,240	2,736,250,759	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,897,810,794	2,555,592,015	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,276,007,879	2,791,012,033	
合 計		11,858,933,140	21,899,172,716	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	107,199,877,728
株式	284,066,971,990
派生商品評価勘定	4,156,750
未収入金	5,584,576

[令和 2年 6月25日現在]

未収配当金	1,132,488,570
未収利息	3,781,711
前払金	102,525,000
その他未収収益	24,169,116
差入委託証拠金	215,280,000
流動資産合計	392,754,835,441
資産合計	392,754,835,441
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	161,846,650
未払金	3,687,038,368
未払解約金	145,724,842
未払利息	157,246
受入担保金	99,736,249,968
流動負債合計	103,731,017,074
負債合計	103,731,017,074
純資産の部	
元本等	
元本	165,988,250,994
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	123,035,567,373
元本等合計	289,023,818,367
純資産合計	289,023,818,367
負債純資産合計	392,754,835,441

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 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	137,829,963,384円
期中追加設定元本額	213,743,205,433円
期中一部解約元本額	185,584,917,823円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内株式）	583,469,904円
e M A X I S T O P I X インデックス	9,935,587,518円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	2,124,095,439円
e M A X I S バランス（波乗り型）	375,137,773円
コアバランス	252,804円

	[令和 2年 6月25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）	119,681,981円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	205,077,592円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	139,943,652円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）	10,843,642,373円
国内株式セレクション（ラップ向け）	1,448,849,286円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	3,845,245,691円
つみたて日本株式（TOPIX）	3,598,682,543円
つみたて8資産均等バランス	1,573,011,742円
つみたて4資産均等バランス	443,428,535円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,188,776円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,940,591円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	3,343,947円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	83,415,030円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	75,713,780円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	37,970,483円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	340,146,947円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	39,469,971円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	2,985,493,211円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	318,955,733円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	643,019,297円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	725,230,117円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	111,237,231円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	180,476,731円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	31,378,773円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	169,167,284円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	338,091,322円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	101,016,334円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	118,235,462円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	392,834,377円
eMAXIS 最適化バランス（マイフoward）	290,751,821円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	592,981,725円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	39,833,326円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	8,627,069,358円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	219,436,173円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	2,475,367,885円

	[令和 2年 6月25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）	36,160,980,498円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	400,265,004円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	5,301,401円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	3,327,685円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	403,001,645円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	842,512,072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）	1,261,939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）	100,947,464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）	602,724,178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）	241,203,179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）	712,980,219円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	67,619,486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）	23,269,013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）	3,129,702,966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）	671,034,285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）	196,361,472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）	183,590,453円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	7,477,986,531円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	4,214,259円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	15,991,117円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	8,701,760円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	13,843,431円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	1,214,455,542円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	220,251,814円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	26,110,130円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	211,410,887円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	18,722,605円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	119,376,668円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,715,098,455円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	536,198,476円

	[令和 2年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド （安定成長型）	2,027,279,668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）	1,744,408,463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）	1,443,210,746円
三菱ＵＦＪ ＤＣ国内株式インデックスファンド	51,254,308,311円
合計	165,988,250,994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	93,293,359,580円
3. 受益権の総数	165,988,250,994口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	23,583,624,974
合計	23,583,624,974

(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 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,110,365,000	—	4,952,850,000	157,515,000
合計		5,110,365,000	—	4,952,850,000	157,515,000

（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 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.7412円
(1万口当たり純資産額)	(17,412円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表
(1) 株式

（単位：円）

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	6,200	2,682.00	16,628,400	貸付有価証券 2,100株
1332	日本水産	175,900	469.00	82,497,100	貸付有価証券 60,200株
1333	マルハニチロ	25,400	2,152.00	54,660,800	貸付有価証券 8,700株
1376	カネコ種苗	5,300	1,464.00	7,759,200	貸付有価証券 1,800株
1377	サカタのタネ	21,000	3,415.00	71,715,000	貸付有価証券 14,700株（ 7,500株 ）
1379	ホクト	13,400	2,020.00	27,068,000	貸付有価証券 4,600株
1384	ホクリヨウ	2,700	637.00	1,719,900	貸付有価証券 900株
1514	住石ホールディングス	35,500	124.00	4,402,000	貸付有価証券 12,200株
1515	日鉄鉱業	4,000	4,425.00	17,700,000	貸付有価証券 1,800株（ 400株 ）
1518	三井松島ホールディングス	6,800	834.00	5,671,200	貸付有価証券 2,400株
1605	国際石油開発帝石	705,500	690.50	487,147,750	
1662	石油資源開発	23,000	1,846.00	42,458,000	貸付有価証券 7,900株
1663	K & Oエナジーグループ	8,500	1,471.00	12,503,500	
1413	ヒノキヤグループ	4,400	1,732.00	7,620,800	貸付有価証券 500株（ 500株 ）

1414	ショーボンドホールディングス	27,400	4,785.00	131,109,000	貸付有価証券 10,600株（10,600株）
1417	ミライト・ホールディングス	52,300	1,569.00	82,058,700	貸付有価証券 23,400株（5,600株）
1419	タマホーム	9,500	1,302.00	12,369,000	貸付有価証券 3,800株（900株）
1420	サンヨーホームズ	1,500	657.00	985,500	貸付有価証券 1,100株（200株）
1429	日本アクア	7,000	568.00	3,976,000	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	5,400	541.00	2,921,400	貸付有価証券 2,500株（600株）
1433	ベステラ	3,000	998.00	2,994,000	貸付有価証券 1,000株
1435	T A T E R U	36,300	195.00	7,078,500	貸付有価証券 12,200株
1446	キャンディル	2,900	611.00	1,771,900	
1448	スペースバリューホールディングス	21,400	353.00	7,554,200	貸付有価証券 7,300株
1712	ダイセキ環境ソリューション	3,400	949.00	3,226,600	貸付有価証券 1,600株（400株）
1716	第一カッター興業	2,200	2,188.00	4,813,600	
1717	明豊ファシリティワークス	5,700	570.00	3,249,000	
1719	安藤・間	104,700	615.00	64,390,500	貸付有価証券 35,900株
1720	東急建設	51,500	545.00	28,067,500	貸付有価証券 17,600株
1721	コムシスホールディングス	62,400	3,070.00	191,568,000	貸付有価証券 21,300株
1726	ピーアールホールディングス	19,200	542.00	10,406,400	貸付有価証券 8,600株（2,100株）
1762	高松コンストラクショングループ	10,900	2,322.00	25,309,800	貸付有価証券 3,800株
1766	東建コーポレーション	5,400	7,060.00	38,124,000	貸付有価証券 3,800株（2,000株）
1768	ソネック	1,800	859.00	1,546,200	貸付有価証券 800株（200株）
1780	ヤマウラ	7,600	825.00	6,270,000	貸付有価証券 2,500株
1801	大成建設	135,400	3,790.00	513,166,000	貸付有価証券 46,400株
1802	大林組	406,100	982.00	398,790,200	貸付有価証券 139,300株
1803	清水建設	412,100	858.00	353,581,800	貸付有価証券 141,400株
1805	飛鳥建設	11,600	1,035.00	12,006,000	貸付有価証券 4,000株
1808	長谷工コーポレーション	157,200	1,359.00	213,634,800	貸付有価証券 54,200株
1810	松井建設	16,000	641.00	10,256,000	貸付有価証券 5,500株

1811	銭高組	1,800	3,970.00	7,146,000	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	318,800	1,211.00	386,066,800	貸付有価証券 109,400株
1813	不動テトラ	10,600	1,430.00	15,158,000	貸付有価証券 3,600株
1814	大末建設	4,700	816.00	3,835,200	貸付有価証券 2,100株（500株）
1815	鉄建建設	8,800	2,042.00	17,969,600	貸付有価証券 3,000株
1820	西松建設	31,300	2,094.00	65,542,200	貸付有価証券 10,700株
1821	三井住友建設	98,100	463.00	45,420,300	貸付有価証券 33,700株
1822	大豊建設	9,100	2,345.00	21,339,500	貸付有価証券 3,100株
1824	前田建設工業	101,700	810.00	82,377,000	貸付有価証券 45,800株（11,000株）
1826	佐田建設	8,700	417.00	3,627,900	貸付有価証券 3,000株
1827	ナカノフドー建設	11,100	372.00	4,129,200	貸付有価証券 7,300株（3,500株）
1833	奥村組	22,000	2,443.00	53,746,000	貸付有価証券 10,000株（2,400株）
1835	東鉄工業	17,400	2,700.00	46,980,000	貸付有価証券 12,200株（6,200株）
1847	イチケン	2,900	1,477.00	4,283,300	貸付有価証券 1,000株
1848	富士ピー・エス	6,000	562.00	3,372,000	貸付有価証券 2,600株（600株）
1852	浅沼組	4,500	4,160.00	18,720,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
1860	戸田建設	168,600	669.00	112,793,400	貸付有価証券 57,600株
1861	熊谷組	18,800	2,511.00	47,206,800	貸付有価証券 6,500株
1866	北野建設	2,500	2,621.00	6,552,500	貸付有価証券 1,200株（400株）
1867	植木組	1,800	2,417.00	4,350,600	貸付有価証券 600株
1870	矢作建設工業	17,900	759.00	13,586,100	貸付有価証券 8,200株（2,000株）
1871	ピーエス三菱	13,400	520.00	6,968,000	貸付有価証券 6,100株（1,500株）
1873	日本ハウスホールディングス	27,700	276.00	7,645,200	貸付有価証券 9,500株
1878	大東建託	44,300	10,045.00	444,993,500	貸付有価証券 34,200株（17,500株）
1879	新日本建設	17,300	823.00	14,237,900	貸付有価証券 5,900株
1881	N I P P O	33,600	2,603.00	87,460,800	貸付有価証券 11,600株

1882	東亜道路工業	2,500	3,195.00	7,987,500	貸付有価証券 900株
1883	前田道路	35,800	2,010.00	71,958,000	貸付有価証券 20,000株
1884	日本道路	3,900	7,230.00	28,197,000	貸付有価証券 1,400株
1885	東亜建設工業	12,700	1,515.00	19,240,500	貸付有価証券 4,300株
1887	日本国土開発	39,500	552.00	21,804,000	貸付有価証券 10,700株（2,600株）
1888	若築建設	7,300	1,138.00	8,307,400	貸付有価証券 2,500株
1890	東洋建設	45,500	405.00	18,427,500	貸付有価証券 15,700株
1893	五洋建設	161,000	557.00	89,677,000	貸付有価証券 113,400株（58,200株）
1898	世紀東急工業	19,500	744.00	14,508,000	貸付有価証券 6,700株
1899	福田組	4,700	4,905.00	23,053,500	貸付有価証券 500株（500株）
1911	住友林業	102,900	1,308.00	134,593,200	貸付有価証券 44,700株（9,500株）
1914	日本基礎技術	13,600	405.00	5,508,000	貸付有価証券 4,700株
1921	巴コーポレーション	18,000	339.00	6,102,000	貸付有価証券 12,600株（6,400株）
1925	大和ハウス工業	401,800	2,522.50	1,013,540,500	貸付有価証券 137,400株
1926	ライト工業	23,200	1,423.00	33,013,600	貸付有価証券 16,400株（8,400株）
1928	積水ハウス	440,400	2,039.50	898,195,800	貸付有価証券 311,400株（48,000株）
1929	日特建設	10,600	762.00	8,077,200	貸付有価証券 3,600株
1930	北陸電気工事	7,000	928.00	6,496,000	貸付有価証券 2,400株
1934	ユアテック	23,200	639.00	14,824,800	貸付有価証券 7,900株
1938	日本リーテック	8,500	2,443.00	20,765,500	
1939	四電工	2,200	2,485.00	5,467,000	貸付有価証券 800株
1941	中電工	16,400	2,248.00	36,867,200	貸付有価証券 5,600株
1942	関電工	57,800	917.00	53,002,600	貸付有価証券 19,900株
1944	きんでん	96,500	1,746.00	168,489,000	貸付有価証券 33,000株
1945	東京エネシス	13,500	786.00	10,611,000	貸付有価証券 4,700株

1946	トーエネック	4,100	3,590.00	14,719,000	貸付有価証券 1,400株
1949	住友電設	11,500	2,337.00	26,875,500	貸付有価証券 3,900株
1950	日本電設工業	22,300	2,329.00	51,936,700	貸付有価証券 15,700株（8,000株）
1951	協和エクシオ	61,600	2,558.00	157,572,800	貸付有価証券 21,000株
1952	新日本空調	10,700	2,421.00	25,904,700	貸付有価証券 7,500株（3,800株）
1959	九電工	28,500	3,110.00	88,635,000	貸付有価証券 12,800株（3,100株）
1961	三機工業	29,300	1,258.00	36,859,400	貸付有価証券 10,100株
1963	日揮ホールディングス	125,000	1,117.00	139,625,000	貸付有価証券 88,000株（45,300株）
1964	中外炉工業	4,400	1,506.00	6,626,400	貸付有価証券 2,000株（500株）
1967	ヤマト	13,000	661.00	8,593,000	貸付有価証券 9,100株（4,700株）
1968	太平電業	9,800	2,233.00	21,883,400	貸付有価証券 4,400株（1,100株）
1969	高砂熱学工業	35,300	1,593.00	56,232,900	貸付有価証券 15,800株（3,800株）
1972	三晃金属工業	1,800	2,059.00	3,706,200	貸付有価証券 600株
1975	朝日工業社	2,700	3,155.00	8,518,500	貸付有価証券 900株
1976	明星工業	26,300	786.00	20,671,800	貸付有価証券 9,000株
1979	大気社	19,700	2,949.00	58,095,300	貸付有価証券 8,900株（2,100株）
1980	ダイダン	9,700	2,753.00	26,704,100	貸付有価証券 4,300株（1,000株）
1982	日比谷総合設備	13,100	1,861.00	24,379,100	貸付有価証券 5,800株（1,400株）
3267	フィル・カンパニー	2,300	2,501.00	5,752,300	
5912	ＯＳＪＢホールディングス	64,000	231.00	14,784,000	貸付有価証券 21,900株
6330	東洋エンジニアリング	17,100	353.00	6,036,300	貸付有価証券 5,800株
6379	レイズネクスト	21,800	1,228.00	26,770,400	貸付有価証券 9,900株（2,400株）
2001	日本製粉	38,000	1,601.00	60,838,000	貸付有価証券 26,700株（13,600株）
2002	日清製粉グループ本社	146,800	1,584.00	232,531,200	貸付有価証券 50,200株
2003	日東富士製粉	900	6,420.00	5,778,000	貸付有価証券 300株
2004	昭和産業	11,900	3,230.00	38,437,000	貸付有価証券 8,400株（4,300株）
2009	鳥越製粉	11,500	904.00	10,396,000	

2053	中部飼料	15,900	1,613.00	25,646,700	貸付有価証券 7,100株（1,700株）
2060	フィード・ワン	87,300	197.00	17,198,100	貸付有価証券 29,800株
2107	東洋精糖	2,200	1,218.00	2,679,600	貸付有価証券 800株
2108	日本甜菜製糖	6,800	1,680.00	11,424,000	貸付有価証券 2,300株
2109	三井製糖	11,400	2,010.00	22,914,000	貸付有価証券 3,900株
2112	塩水港精糖	14,100	206.00	2,904,600	貸付有価証券 4,800株
2117	日新製糖	6,200	1,855.00	11,501,000	貸付有価証券 2,100株
2201	森永製菓	30,500	4,260.00	129,930,000	貸付有価証券 10,500株
2204	中村屋	3,400	4,005.00	13,617,000	貸付有価証券 1,100株
2206	江崎グリコ	38,500	5,130.00	197,505,000	
2207	名糖産業	6,200	1,284.00	7,960,800	貸付有価証券 2,200株
2209	井村屋グループ	7,400	2,141.00	15,843,400	貸付有価証券 1,900株
2211	不二家	7,300	2,194.00	16,016,200	
2212	山崎製パン	97,400	1,817.00	176,975,800	貸付有価証券 35,300株（35,300株）
2215	第一屋製パン	2,200	961.00	2,114,200	貸付有価証券 800株
2217	モロゾフ	2,200	5,680.00	12,496,000	貸付有価証券 800株
2220	亀田製菓	7,400	5,060.00	37,444,000	貸付有価証券 2,500株
2222	寿スピリッツ	12,500	4,720.00	59,000,000	貸付有価証券 5,700株（1,400株）
2229	カルビー	59,200	2,938.00	173,929,600	貸付有価証券 20,300株
2264	森永乳業	24,000	4,685.00	112,440,000	貸付有価証券 8,300株
2266	六甲バター	8,600	1,472.00	12,659,200	
2267	ヤクルト本社	89,400	6,440.00	575,736,000	貸付有価証券 30,700株
2269	明治ホールディングス	85,900	8,380.00	719,842,000	貸付有価証券 29,500株
2270	雪印メグミルク	31,300	2,478.00	77,561,400	貸付有価証券 10,700株
2281	プリマハム	20,300	2,682.00	54,444,600	貸付有価証券 6,900株
2282	日本ハム	49,700	4,235.00	210,479,500	貸付有価証券 17,100株
2286	林兼産業	4,300	571.00	2,455,300	貸付有価証券 1,500株

2288	丸大食品	13,900	1,875.00	26,062,500	貸付有価証券 4,800株
2292	S F o o d s	10,400	2,653.00	27,591,200	貸付有価証券 3,600株
2294	柿安本店	4,500	2,636.00	11,862,000	
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	83,700	643.00	53,819,100	貸付有価証券 28,600株
2501	サッポロホールディングス	44,400	2,007.00	89,110,800	貸付有価証券 4,800株（4,800株）
2502	アサヒグループホールディングス	272,200	3,880.00	1,056,136,000	
2503	キリンホールディングス	551,200	2,301.00	1,268,311,200	
2531	宝ホールディングス	96,300	977.00	94,085,100	貸付有価証券 43,800株（10,500株）
2533	オエノンホールディングス	34,300	408.00	13,994,400	
2540	養命酒製造	4,000	1,801.00	7,204,000	貸付有価証券 1,400株
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	91,200	2,016.00	183,859,200	
2587	サントリー食品インターナショナル	87,000	4,250.00	369,750,000	
2590	ダイドーグループホールディングス	6,700	4,860.00	32,562,000	貸付有価証券 4,600株（2,300株）
2593	伊藤園	39,500	6,230.00	246,085,000	貸付有価証券 17,800株（4,300株）
2594	キーコーヒー	12,800	2,302.00	29,465,600	貸付有価証券 4,400株
2597	ユニカフェ	3,300	972.00	3,207,600	貸付有価証券 1,100株
2599	ジャパンフーズ	1,800	1,200.00	2,160,000	貸付有価証券 600株
2602	日清オイリオグループ	16,700	3,325.00	55,527,500	貸付有価証券 5,700株
2607	不二製油グループ本社	31,700	2,799.00	88,728,300	貸付有価証券 22,300株（11,500株）
2612	かどや製油	1,400	3,660.00	5,124,000	貸付有価証券 500株
2613	J - オイルミルズ	6,700	3,945.00	26,431,500	貸付有価証券 2,300株
2801	キッコーマン	93,500	5,240.00	489,940,000	貸付有価証券 31,800株
2802	味の素	287,000	1,810.50	519,613,500	貸付有価証券 124,000株（25,900株）
2809	キューピー	72,400	2,066.00	149,578,400	貸付有価証券 24,700株
2810	ハウス食品グループ本社	48,600	3,500.00	170,100,000	貸付有価証券 16,600株
2811	カゴメ	49,300	3,150.00	155,295,000	貸付有価証券 17,800株（17,800株）
2812	焼津水産化学工業	6,300	929.00	5,852,700	貸付有価証券 2,200株

2815	アリアケジャパン	11,900	6,860.00	81,634,000	貸付有価証券 4,100株
2818	ピエトロ	1,700	1,626.00	2,764,200	貸付有価証券 600株
2819	エバラ食品工業	3,200	2,187.00	6,998,400	貸付有価証券 1,100株
2820	やまみ	1,100	2,120.00	2,332,000	貸付有価証券 100株（100株）
2871	ニチレイ	61,900	3,090.00	191,271,000	貸付有価証券 21,200株
2875	東洋水産	66,900	5,940.00	397,386,000	貸付有価証券 22,800株
2882	イートアンド	4,500	1,798.00	8,091,000	貸付有価証券 1,500株
2883	大冷	1,700	2,007.00	3,411,900	貸付有価証券 600株
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,200	1,042.00	7,502,400	貸付有価証券 3,100株（700株）
2897	日清食品ホールディングス	55,200	9,400.00	518,880,000	貸付有価証券 18,900株
2899	永谷園ホールディングス	6,300	2,145.00	13,513,500	貸付有価証券 2,200株
2904	一正蒲鉾	5,000	1,005.00	5,025,000	貸付有価証券 900株
2908	フジッコ	14,100	1,983.00	27,960,300	貸付有価証券 9,900株（5,100株）
2910	ロック・フィールド	14,000	1,340.00	18,760,000	貸付有価証券 9,800株（5,000株）
2914	日本たばこ産業	750,500	2,099.50	1,575,674,750	
2915	ケンコーマヨネーズ	7,300	1,945.00	14,198,500	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	8,500	1,692.00	14,382,000	貸付有価証券 6,000株（3,100株）
2922	なとり	7,300	1,740.00	12,702,000	貸付有価証券 2,500株
2924	イフジ産業	2,300	810.00	1,863,000	貸付有価証券 700株
2925	ビックルスコーポレーション	2,800	2,402.00	6,725,600	貸付有価証券 1,300株（300株）
2930	北の達人コーポレーション	45,400	553.00	25,106,200	貸付有価証券 20,500株（4,900株）
2931	ユーグレナ	56,000	782.00	43,792,000	貸付有価証券 39,100株（20,100株）
4404	ミヨシ油脂	5,000	1,111.00	5,555,000	
4526	理研ビタミン	12,300	2,293.00	28,203,900	貸付有価証券 4,200株
3001	片倉工業	18,400	1,148.00	21,123,200	
3002	ゲンゼ	9,300	3,870.00	35,991,000	貸付有価証券 6,500株（3,300株）
3101	東洋紡	50,100	1,470.00	73,647,000	貸付有価証券 17,200株

3103	ユニチカ	37,200	347.00	12,908,400	貸付有価証券 12,700株
3104	富士紡ホールディングス	6,100	3,185.00	19,428,500	貸付有価証券 2,100株
3106	倉敷紡績	12,600	2,261.00	28,488,600	貸付有価証券 8,800株（4,300株）
3109	シキボウ	6,600	976.00	6,441,600	貸付有価証券 2,300株
3201	日本毛織	41,700	1,018.00	42,450,600	貸付有価証券 18,800株（4,500株）
3202	ダイトウボウ	20,500	120.00	2,460,000	貸付有価証券 9,200株（2,200株）
3204	トーア紡コーポレーション	5,000	489.00	2,445,000	
3205	グイドーリミテッド	16,700	222.00	3,707,400	貸付有価証券 5,700株
3302	帝国繊維	14,300	2,281.00	32,618,300	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
3401	帝人	103,500	1,715.00	177,502,500	貸付有価証券 35,300株
3402	東レ	918,300	498.70	457,956,210	貸付有価証券 315,000株
3408	サカイオーベックス	3,400	2,139.00	7,272,600	貸付有価証券 1,100株
3501	住江織物	2,800	2,047.00	5,731,600	貸付有価証券 1,900株（800株）
3512	日本フェルト	7,200	466.00	3,355,200	貸付有価証券 2,500株
3513	イチカワ	1,800	1,282.00	2,307,600	貸付有価証券 600株
3524	日東製網	1,500	1,365.00	2,047,500	貸付有価証券 500株
3529	アツギ	10,400	607.00	6,312,800	貸付有価証券 3,600株
3551	ダイニツク	4,800	736.00	3,532,800	貸付有価証券 1,600株
3569	セーレン	31,200	1,340.00	41,808,000	貸付有価証券 10,600株
3571	ソトー	5,000	955.00	4,775,000	貸付有価証券 1,700株
3577	東海染工	1,700	1,126.00	1,914,200	貸付有価証券 600株
3580	小松マテーレ	20,800	714.00	14,851,200	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	33,100	2,033.00	67,292,300	貸付有価証券 11,400株
3593	ホギメディカル	14,500	3,345.00	48,502,500	
3607	クラウディアホールディングス	3,100	448.00	1,388,800	貸付有価証券 1,100株
3608	T S Iホールディングス	42,500	462.00	19,635,000	貸付有価証券 30,000株（15,400株）
3611	マツオカコーポレーション	3,600	2,000.00	7,200,000	貸付有価証券 1,600株（400株）

3612	ワールド	18,000	1,670.00	30,060,000	貸付有価証券 6,100株
8011	三陽商会	6,600	817.00	5,392,200	貸付有価証券 2,300株
8013	ナイガイ	4,600	365.00	1,679,000	貸付有価証券 1,600株
8016	オンワードホールディングス	76,200	338.00	25,755,600	貸付有価証券 26,100株
8029	ルックホールディングス	4,300	775.00	3,332,500	
8107	キムラタン	67,000	25.00	1,675,000	貸付有価証券 29,600株（7,100株）
8111	ゴールドウイン	23,000	7,130.00	163,990,000	貸付有価証券 16,200株（8,300株）
8114	デサント	24,700	1,474.00	36,407,800	貸付有価証券 11,300株（2,700株）
8118	キング	6,000	539.00	3,234,000	貸付有価証券 2,100株
8127	ヤマトインターナショナル	11,100	385.00	4,273,500	貸付有価証券 2,700株
3708	特種東海製紙	8,100	4,450.00	36,045,000	貸付有価証券 2,800株
3861	王子ホールディングス	530,200	501.00	265,630,200	貸付有価証券 239,400株（57,500株）
3863	日本製紙	56,100	1,530.00	85,833,000	貸付有価証券 39,500株（20,200株）
3864	三菱製紙	14,400	352.00	5,068,800	貸付有価証券 5,000株
3865	北越コーポレーション	75,600	381.00	28,803,600	貸付有価証券 28,800株
3877	中越パルプ工業	5,400	1,544.00	8,337,600	貸付有価証券 1,900株
3878	巴川製紙所	3,800	925.00	3,515,000	貸付有価証券 1,300株
3880	大王製紙	55,900	1,442.00	80,607,800	貸付有価証券 39,100株（20,000株）
3896	阿波製紙	3,300	501.00	1,653,300	貸付有価証券 1,400株（300株）
3941	レンゴー	119,900	863.00	103,473,700	貸付有価証券 41,200株
3946	トーモク	7,800	1,687.00	13,158,600	貸付有価証券 2,700株
3950	ザ・パックス	9,600	3,090.00	29,664,000	貸付有価証券 3,500株（3,500株）
3405	クラレ	199,700	1,135.00	226,659,500	
3407	旭化成	840,700	859.50	722,581,650	貸付有価証券 290,100株
3553	共和レザー	6,900	692.00	4,774,800	貸付有価証券 2,400株
4004	昭和電工	90,300	2,468.00	222,860,400	

4005	住友化学	931,800	320.00	298,176,000	貸付有価証券 420,500株（100,900株）
4008	住友精化	5,600	3,445.00	19,292,000	貸付有価証券 1,900株
4021	日産化学	70,400	5,320.00	374,528,000	貸付有価証券 32,000株（7,700株）
4022	ラサ工業	4,500	1,532.00	6,894,000	貸付有価証券 3,100株（1,600株）
4023	クレハ	10,900	4,725.00	51,502,500	貸付有価証券 7,500株（3,800株）
4025	多木化学	4,900	7,350.00	36,015,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
4027	テイカ	9,300	1,414.00	13,150,200	貸付有価証券 6,500株（3,300株）
4028	石原産業	22,700	711.00	16,139,700	貸付有価証券 7,800株
4031	片倉コープアグリ	3,300	1,230.00	4,059,000	貸付有価証券 1,100株
4041	日本曹達	18,800	2,773.00	52,132,400	貸付有価証券 8,400株（2,000株）
4042	東ソー	196,100	1,430.00	280,423,000	貸付有価証券 67,000株
4043	トクヤマ	36,600	2,454.00	89,816,400	貸付有価証券 12,500株
4044	セントラル硝子	25,900	1,819.00	47,112,100	貸付有価証券 8,900株
4045	東亜合成	79,600	1,050.00	83,580,000	貸付有価証券 8,600株（8,600株）
4046	大阪ソーダ	12,900	2,381.00	30,714,900	貸付有価証券 4,400株
4047	関東電化工業	30,100	825.00	24,832,500	貸付有価証券 13,600株（3,300株）
4061	デンカ	46,300	2,622.00	121,398,600	貸付有価証券 15,900株
4063	信越化学工業	217,800	12,280.00	2,674,584,000	貸付有価証券 76,400株
4064	日本カーバイド工業	4,300	1,293.00	5,559,900	貸付有価証券 1,500株
4078	堺化学工業	8,200	2,000.00	16,400,000	貸付有価証券 3,700株（900株）
4082	第一稀元素化学工業	13,700	789.00	10,809,300	貸付有価証券 6,200株（1,500株）
4088	エア・ウォーター	118,000	1,497.00	176,646,000	貸付有価証券 35,700株（200株）
4091	大陽日酸	121,900	1,730.00	210,887,000	貸付有価証券 41,400株
4092	日本化学工業	3,900	2,243.00	8,747,700	貸付有価証券 1,400株
4093	東邦アセチレン	1,900	1,247.00	2,369,300	貸付有価証券 600株

4095	日本パーカライジング	64,000	1,069.00	68,416,000	貸付有価証券 28,800株（6,900株）
4097	高压ガス工業	20,100	770.00	15,477,000	貸付有価証券 6,900株
4098	チタン工業	1,600	1,773.00	2,836,800	貸付有価証券 1,100株（600株）
4099	四国化成工業	19,600	1,102.00	21,599,200	貸付有価証券 8,800株（2,100株）
4100	戸田工業	2,900	1,974.00	5,724,600	貸付有価証券 2,000株（1,000株）
4109	ステラ ケミファ	6,900	2,405.00	16,594,500	貸付有価証券 3,100株（700株）
4112	保土谷化学工業	4,700	4,080.00	19,176,000	貸付有価証券 1,600株
4114	日本触媒	19,700	5,640.00	111,108,000	貸付有価証券 8,900株（2,100株）
4116	大日精化工業	11,200	2,287.00	25,614,400	貸付有価証券 3,800株
4118	カネカ	32,800	2,773.00	90,954,400	貸付有価証券 11,200株
4182	三菱瓦斯化学	118,000	1,597.00	188,446,000	貸付有価証券 52,200株（11,100株）
4183	三井化学	115,200	2,253.00	259,545,600	貸付有価証券 49,700株（10,300株）
4185	J S R	118,200	2,027.00	239,591,400	貸付有価証券 40,500株
4186	東京応化工業	21,800	5,220.00	113,796,000	
4187	大阪有機化学工業	11,700	2,450.00	28,665,000	貸付有価証券 4,000株
4188	三菱ケミカルホールディングス	847,900	621.10	526,630,690	貸付有価証券 289,900株
4189	K H ネオケム	22,300	2,026.00	45,179,800	貸付有価証券 8,100株（8,100株）
4202	ダイセル	165,100	817.00	134,886,700	貸付有価証券 59,500株
4203	住友ベークライト	19,900	2,963.00	58,963,700	貸付有価証券 6,800株
4204	積水化学工業	272,700	1,522.00	415,049,400	貸付有価証券 122,600株（29,400株）
4205	日本ゼオン	114,400	974.00	111,425,600	貸付有価証券 39,100株
4206	アイカ工業	38,000	3,490.00	132,620,000	貸付有価証券 17,100株（4,100株）
4208	宇部興産	64,000	1,810.00	115,840,000	貸付有価証券 28,800株（6,900株）
4212	積水樹脂	22,800	2,146.00	48,928,800	貸付有価証券 7,800株
4215	タキロンシーアイ	27,400	672.00	18,412,800	貸付有価証券 9,300株
4216	旭有機材	7,200	1,419.00	10,216,800	貸付有価証券 5,000株（2,600株）

4218	ニチバン	6,700	1,468.00	9,835,600	貸付有価証券 4,600株（2,400株）
4220	リケンテクノス	31,900	432.00	13,780,800	貸付有価証券 10,900株
4221	大倉工業	6,000	1,572.00	9,432,000	
4228	積水化成成品工業	17,000	566.00	9,622,000	貸付有価証券 5,900株
4229	群栄化学工業	2,900	2,616.00	7,586,400	貸付有価証券 1,300株（300株）
4231	タイガースポリマー	6,700	488.00	3,269,600	貸付有価証券 2,200株
4238	ミライアル	4,500	1,016.00	4,572,000	貸付有価証券 2,000株（500株）
4245	ダイキアクシス	4,500	851.00	3,829,500	貸付有価証券 2,000株（500株）
4246	ダイキョーニシカワ	26,700	486.00	12,976,200	貸付有価証券 12,000株（2,900株）
4248	竹本容器	4,500	722.00	3,249,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
4249	森六ホールディングス	6,800	1,742.00	11,845,600	貸付有価証券 2,300株
4272	日本化薬	78,500	1,072.00	84,152,000	貸付有価証券 35,400株（8,500株）
4275	カーリットホールディングス	13,500	501.00	6,763,500	貸付有価証券 6,100株（1,500株）
4362	日本精化	10,200	1,465.00	14,943,000	貸付有価証券 3,500株
4368	扶桑化学工業	12,800	3,785.00	48,448,000	貸付有価証券 5,800株（1,400株）
4369	トリケミカル研究所	2,800	11,470.00	32,116,000	貸付有価証券 1,300株（300株）
4401	A D E K A	58,400	1,411.00	82,402,400	貸付有価証券 26,300株（6,300株）
4403	日油	47,800	3,660.00	174,948,000	貸付有価証券 16,300株
4406	新日本理化	21,000	167.00	3,507,000	貸付有価証券 14,700株（7,500株）
4410	ハリマ化成グループ	10,500	975.00	10,237,500	貸付有価証券 4,700株（1,100株）
4452	花王	310,100	8,684.00	2,692,908,400	
4461	第一工業製薬	4,700	5,090.00	23,923,000	貸付有価証券 3,300株（1,700株）
4462	石原ケミカル	3,400	1,964.00	6,677,600	貸付有価証券 1,500株（400株）
4463	日華化学	4,300	946.00	4,067,800	貸付有価証券 2,900株（1,400株）
4465	ニイタカ	2,600	5,760.00	14,976,000	貸付有価証券 700株
4471	三洋化成工業	7,600	4,690.00	35,644,000	貸付有価証券 2,600株
4531	有機合成薬品工業	9,700	370.00	3,589,000	貸付有価証券 4,300株（1,000株）

4611	大日本塗料	14,300	904.00	12,927,200	貸付有価証券 4,900株
4612	日本ペイントホールディングス	104,700	7,930.00	830,271,000	貸付有価証券 37,900株（37,900株）
4613	関西ペイント	142,500	2,229.00	317,632,500	貸付有価証券 48,700株
4615	神東塗料	10,000	186.00	1,860,000	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	36,100	781.00	28,194,100	貸付有価証券 12,400株
4619	日本特殊塗料	9,500	963.00	9,148,500	貸付有価証券 6,700株（3,500株）
4620	藤倉化成	17,100	535.00	9,148,500	貸付有価証券 5,900株
4626	太陽ホールディングス	9,300	4,905.00	45,616,500	貸付有価証券 3,300株（100株）
4631	D I C	53,600	2,707.00	145,095,200	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
4633	サカタインクス	27,700	1,009.00	27,949,300	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
4634	東洋インキＳＣホールディングス	26,800	2,042.00	54,725,600	
4636	T & K T O K A	9,800	832.00	8,153,600	貸付有価証券 3,300株
4901	富士フイルムホールディングス	248,300	4,651.00	1,154,843,300	貸付有価証券 112,100株（26,900株）
4911	資生堂	257,300	7,023.00	1,807,017,900	貸付有価証券 27,800株（27,800株）
4912	ライオン	168,400	2,569.00	432,619,600	
4914	高砂香料工業	8,100	2,142.00	17,350,200	貸付有価証券 3,700株（900株）
4917	マンダム	29,100	1,975.00	57,472,500	貸付有価証券 9,900株
4919	ミルボン	17,300	5,110.00	88,403,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
4921	ファンケル	52,400	3,190.00	167,156,000	貸付有価証券 18,000株
4922	コーセー	24,400	13,050.00	318,420,000	貸付有価証券 10,900株（2,600株）
4923	コタ	7,500	1,195.00	8,962,500	貸付有価証券 2,500株
4926	シーボン	1,700	2,062.00	3,505,400	貸付有価証券 600株
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	55,300	1,872.00	103,521,600	
4928	ノエビアホールディングス	11,000	4,575.00	50,325,000	貸付有価証券 5,500株（1,300株）
4929	アジュバンコスメジャパン	2,900	943.00	2,734,700	貸付有価証券 1,100株
4951	エステー	8,300	1,698.00	14,093,400	貸付有価証券 2,900株
4955	アグロ カネショウ	5,400	1,277.00	6,895,800	貸付有価証券 1,800株（400株）

4956	コニシ	21,300	1,479.00	31,502,700	貸付有価証券 9,600株（2,300株）
4958	長谷川香料	22,300	2,378.00	53,029,400	貸付有価証券 12,000株（6,100株）
4963	星光ＰＭＣ	7,400	705.00	5,217,000	
4967	小林製薬	36,300	9,820.00	356,466,000	
4968	荒川化学工業	11,600	1,261.00	14,627,600	貸付有価証券 4,000株
4971	メック	8,900	2,122.00	18,885,800	貸付有価証券 3,000株
4973	日本高純度化学	3,600	2,586.00	9,309,600	貸付有価証券 1,200株
4974	タカラバイオ	33,900	3,135.00	106,276,500	貸付有価証券 15,300株（3,700株）
4975	ＪＣＵ	15,700	3,250.00	51,025,000	貸付有価証券 5,400株
4977	新田ゼラチン	8,100	703.00	5,694,300	貸付有価証券 5,600株（2,800株）
4979	ＯＡＴアグリオ	2,200	1,069.00	2,351,800	貸付有価証券 800株
4980	デクセリアルズ	33,400	841.00	28,089,400	貸付有価証券 11,400株
4985	アース製薬	9,800	7,530.00	73,794,000	
4992	北興化学工業	13,300	622.00	8,272,600	貸付有価証券 4,600株
4994	大成ラミック	4,300	2,693.00	11,579,900	貸付有価証券 1,400株
4996	クミアイ化学工業	53,500	982.00	52,537,000	貸付有価証券 37,700株（19,400株）
4997	日本農薬	23,100	464.00	10,718,400	貸付有価証券 10,400株（2,500株）
5142	アキレス	8,900	2,193.00	19,517,700	貸付有価証券 3,100株
5208	有沢製作所	20,500	811.00	16,625,500	貸付有価証券 14,400株（7,400株）
6988	日東電工	89,400	5,860.00	523,884,000	貸付有価証券 30,600株
7874	レック	13,800	1,617.00	22,314,600	貸付有価証券 9,700株（5,000株）
7888	三光合成	14,800	287.00	4,247,600	貸付有価証券 5,100株
7908	きもと	22,000	152.00	3,344,000	貸付有価証券 7,500株
7917	藤森工業	11,600	3,600.00	41,760,000	貸付有価証券 5,300株（1,300株）
7925	前澤化成工業	8,200	998.00	8,183,600	貸付有価証券 2,800株
7931	未来工業	6,900	1,871.00	12,909,900	貸付有価証券 2,400株
7940	ウェーブロックホールディングス	4,500	858.00	3,861,000	貸付有価証券 1,500株

7942	J S P	7,600	1,441.00	10,951,600	貸付有価証券 2,600株
7947	エフピコ	14,200	8,200.00	116,440,000	貸付有価証券 6,400株（1,500株）
7958	天馬	8,600	1,651.00	14,198,600	貸付有価証券 3,000株
7970	信越ポリマー	23,300	886.00	20,643,800	貸付有価証券 7,900株
7971	東リ	32,200	266.00	8,565,200	貸付有価証券 14,500株（3,500株）
7988	ニフコ	47,500	2,299.00	109,202,500	貸付有価証券 16,300株
7995	バルカー	10,500	1,833.00	19,246,500	貸付有価証券 3,600株
8113	ユニ・チャーム	249,600	4,424.00	1,104,230,400	
9385	ショーエイコーポレーション	1,900	932.00	1,770,800	貸付有価証券 600株（100株）
4151	協和キリン	130,300	2,839.00	369,921,700	
4502	武田薬品工業	1,077,400	3,930.00	4,234,182,000	貸付有価証券 459,100株（89,900株）
4503	アステラス製薬	1,122,800	1,818.00	2,041,250,400	貸付有価証券 389,400株
4506	大日本住友製薬	96,000	1,491.00	143,136,000	貸付有価証券 32,800株
4507	塩野義製薬	162,900	6,846.00	1,115,213,400	貸付有価証券 56,600株
4512	わかもと製薬	15,400	278.00	4,281,200	貸付有価証券 6,900株（1,700株）
4514	あすか製薬	14,700	1,216.00	17,875,200	貸付有価証券 5,100株
4516	日本新薬	33,900	8,850.00	300,015,000	貸付有価証券 11,600株
4517	バイオフェルミン製薬	2,200	2,393.00	5,264,600	貸付有価証券 800株
4519	中外製薬	135,000	17,430.00	2,353,050,000	
4521	科研製薬	22,200	5,520.00	122,544,000	貸付有価証券 7,600株
4523	エーザイ	155,000	8,631.00	1,337,805,000	貸付有価証券 53,000株
4527	ロート製薬	66,500	3,475.00	231,087,500	貸付有価証券 22,800株
4528	小野薬品工業	297,400	3,115.00	926,401,000	貸付有価証券 104,500株
4530	久光製薬	34,200	5,760.00	196,992,000	貸付有価証券 24,100株（11,000株）
4534	持田製薬	18,000	4,040.00	72,720,000	貸付有価証券 8,100株（1,900株）
4536	参天製薬	241,300	2,016.00	486,460,800	貸付有価証券 108,400株（26,000株）

4538	扶桑薬品工業	4,600	2,449.00	11,265,400	貸付有価証券 1,600株
4539	日本ケミファ	1,700	2,627.00	4,465,900	貸付有価証券 600株
4540	ツムラ	40,100	2,840.00	113,884,000	貸付有価証券 13,700株
4541	日医工	36,700	1,303.00	47,820,100	貸付有価証券 16,400株（3,900株）
4547	キッセイ薬品工業	22,900	2,589.00	59,288,100	貸付有価証券 7,800株
4548	生化学工業	25,100	1,144.00	28,714,400	貸付有価証券 13,800株（5,200株）
4549	栄研化学	22,800	1,719.00	39,193,200	貸付有価証券 10,300株（2,500株）
4550	日水製薬	5,400	1,186.00	6,404,400	貸付有価証券 1,900株
4551	鳥居薬品	8,100	3,050.00	24,705,000	
4552	ＪＣＲファーマ	9,100	11,980.00	109,018,000	貸付有価証券 3,100株
4553	東和薬品	16,600	2,026.00	33,631,600	貸付有価証券 5,700株
4554	富士製薬工業	8,800	1,191.00	10,480,800	貸付有価証券 3,000株
4555	沢井製薬	26,600	5,590.00	148,694,000	貸付有価証券 9,100株
4559	ゼリア新薬工業	23,500	2,017.00	47,399,500	貸付有価証券 16,500株（8,400株）
4568	第一三共	370,600	8,950.00	3,316,870,000	貸付有価証券 126,700株
4569	キョーリン製薬ホールディングス	28,600	2,158.00	61,718,800	貸付有価証券 12,900株（3,100株）
4574	大幸薬品	15,800	2,606.00	41,174,800	
4577	ダイト	7,900	4,045.00	31,955,500	貸付有価証券 2,600株
4578	大塚ホールディングス	246,700	4,848.00	1,196,001,600	
4581	大正製薬ホールディングス	27,400	6,640.00	181,936,000	貸付有価証券 12,400株（3,000株）
4587	ペプチドリーム	65,800	5,140.00	338,212,000	貸付有価証券 46,100株（23,700株）
3315	日本コークス工業	109,400	65.00	7,111,000	貸付有価証券 49,200株（11,800株）
5011	ニチレキ	15,300	1,553.00	23,760,900	貸付有価証券 5,200株
5013	ユシロ化学工業	7,300	1,303.00	9,511,900	貸付有価証券 2,500株
5015	ビーピー・カストロール	4,600	1,215.00	5,589,000	
5017	富士石油	34,600	171.00	5,916,600	貸付有価証券 11,800株
5018	MORESCO	4,700	1,012.00	4,756,400	貸付有価証券 1,600株

5019	出光興産	143,700	2,265.00	325,480,500	貸付有価証券 65,600株（15,700株）
5020	E N E O S ホールディングス	1,948,100	380.90	742,031,290	貸付有価証券 688,800株
5021	コスモエネルギーホールディングス	37,500	1,594.00	59,775,000	貸付有価証券 12,800株
5101	横浜ゴム	75,000	1,516.00	113,700,000	
5105	T O Y O T I R E	74,400	1,440.00	107,136,000	
5108	ブリヂストン	373,000	3,511.00	1,309,603,000	
5110	住友ゴム工業	116,300	1,085.00	126,185,500	貸付有価証券 12,600株（12,600株）
5121	藤倉コンポジット	11,300	370.00	4,181,000	貸付有価証券 3,800株
5122	オカモト	7,900	3,825.00	30,217,500	貸付有価証券 2,700株
5185	フコク	5,700	681.00	3,881,700	貸付有価証券 1,900株
5186	ニッタ	14,600	2,280.00	33,288,000	貸付有価証券 10,200株（5,200株）
5191	住友理工	25,100	616.00	15,461,600	貸付有価証券 8,600株
5192	三ツ星ベルト	17,000	1,648.00	28,016,000	貸付有価証券 7,600株（1,800株）
5195	バンドー化学	22,800	625.00	14,250,000	貸付有価証券 8,400株（600株）
3110	日東紡績	19,300	5,200.00	100,360,000	貸付有価証券 8,700株（2,100株）
5201	A G C	128,000	3,190.00	408,320,000	
5202	日本板硝子	62,000	395.00	24,490,000	貸付有価証券 43,600株（22,400株）
5204	石塚硝子	2,400	2,045.00	4,908,000	貸付有価証券 800株
5210	日本山村硝子	5,400	861.00	4,649,400	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	52,000	1,771.00	92,092,000	
5218	オハラ	5,100	1,129.00	5,757,900	貸付有価証券 2,300株（600株）
5232	住友大阪セメント	24,500	3,705.00	90,772,500	貸付有価証券 11,100株（2,700株）
5233	太平洋セメント	81,800	2,414.00	197,465,200	貸付有価証券 28,000株
5262	日本ヒューム	13,000	757.00	9,841,000	貸付有価証券 4,400株
5269	日本コンクリート工業	27,900	278.00	7,756,200	貸付有価証券 12,500株（3,000株）
5273	三谷セキサン	6,000	5,310.00	31,860,000	貸付有価証券 2,100株
5288	アジアパイルホールディングス	18,400	463.00	8,519,200	貸付有価証券 6,600株（300株）
5301	東海カーボン	135,700	1,037.00	140,720,900	貸付有価証券 49,200株（49,200株）

5302	日本カーボン	6,700	3,560.00	23,852,000	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
5310	東洋炭素	7,600	1,706.00	12,965,600	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	7,200	3,460.00	24,912,000	貸付有価証券 2,400株
5332	ＴＯＴＯ	92,500	4,115.00	380,637,500	貸付有価証券 41,800株（10,000株）
5333	日本碍子	155,500	1,454.00	226,097,000	貸付有価証券 71,100株（17,100株）
5334	日本特殊陶業	98,500	1,554.00	153,069,000	貸付有価証券 34,600株
5337	ダントーホールディングス	9,600	90.00	864,000	貸付有価証券 4,300株（1,000株）
5344	MARUWA	5,000	8,200.00	41,000,000	貸付有価証券 3,400株（1,700株）
5351	品川リフラクトリーズ	3,400	2,233.00	7,592,200	貸付有価証券 1,200株
5352	黒崎播磨	2,600	3,730.00	9,698,000	貸付有価証券 900株
5357	ヨータイ	10,300	715.00	7,364,500	貸付有価証券 4,600株（1,100株）
5358	イソライト工業	6,600	459.00	3,029,400	貸付有価証券 2,300株
5363	東京窯業	16,500	307.00	5,065,500	貸付有価証券 11,500株（5,900株）
5367	ニッカトー	5,900	705.00	4,159,500	貸付有価証券 4,100株（2,100株）
5384	フジミインコーポレーテッド	11,500	3,135.00	36,052,500	貸付有価証券 4,000株
5388	クニミネ工業	5,200	985.00	5,122,000	貸付有価証券 1,800株
5391	エーアンドエーマテリアル	2,200	1,080.00	2,376,000	貸付有価証券 800株
5393	ニチアス	35,400	2,159.00	76,428,600	貸付有価証券 15,900株（3,800株）
7943	ニチハ	18,000	2,221.00	39,978,000	貸付有価証券 6,200株
5401	日本製鉄	573,100	1,021.00	585,135,100	貸付有価証券 403,900株（207,600株）
5406	神戸製鋼所	234,400	386.00	90,478,400	貸付有価証券 105,400株（25,300株）
5408	中山製鋼所	17,800	359.00	6,390,200	貸付有価証券 8,000株（1,900株）
5410	合同製鐵	6,900	1,896.00	13,082,400	貸付有価証券 2,400株
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	345,900	773.00	267,380,700	貸付有価証券 242,300株（37,300株）
5423	東京製鐵	62,300	636.00	39,622,800	貸付有価証券 21,400株

5440	共英製鋼	14,400	1,322.00	19,036,800	貸付有価証券 4,900株
5444	大和工業	27,200	2,197.00	59,758,400	貸付有価証券 9,300株
5445	東京鐵鋼	5,300	1,619.00	8,580,700	貸付有価証券 2,400株（600株）
5449	大阪製鐵	6,800	1,254.00	8,527,200	貸付有価証券 2,400株
5451	淀川製鋼所	17,300	1,827.00	31,607,100	貸付有価証券 7,800株（1,900株）
5463	丸一鋼管	41,600	2,694.00	112,070,400	貸付有価証券 29,300株（15,000株）
5464	モリ工業	3,800	2,330.00	8,854,000	貸付有価証券 2,700株（1,400株）
5471	大同特殊鋼	21,000	3,380.00	70,980,000	貸付有価証券 12,600株（5,400株）
5476	日本高周波鋼業	4,700	376.00	1,767,200	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	10,600	1,638.00	17,362,800	貸付有価証券 3,600株
5481	山陽特殊製鋼	8,800	929.00	8,175,200	貸付有価証券 6,100株（2,800株）
5482	愛知製鋼	7,200	3,135.00	22,572,000	貸付有価証券 2,500株
5486	日立金属	138,000	1,307.00	180,366,000	貸付有価証券 47,200株
5491	日本金属	3,000	611.00	1,833,000	貸付有価証券 2,100株（1,100株）
5541	大平洋金属	8,700	1,606.00	13,972,200	貸付有価証券 2,900株
5563	新日本電工	82,500	170.00	14,025,000	貸付有価証券 54,700株（26,500株）
5602	栗本鐵工所	6,300	1,706.00	10,747,800	貸付有価証券 2,200株
5603	虹技	1,900	1,254.00	2,382,600	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	1,300	1,312.00	1,705,600	貸付有価証券 500株
5632	三菱製鋼	9,500	690.00	6,555,000	貸付有価証券 3,200株
5658	日亜鋼業	18,700	288.00	5,385,600	貸付有価証券 13,100株（6,700株）
5659	日本精線	2,100	3,185.00	6,688,500	貸付有価証券 700株
5698	エンビプロ・ホールディングス	5,400	593.00	3,202,200	貸付有価証券 2,100株（500株）
6319	シンニッタン	19,900	242.00	4,815,800	貸付有価証券 14,000株（7,200株）
7305	新家工業	2,900	1,171.00	3,395,900	貸付有価証券 1,000株
5702	大紀アルミニウム工業所	21,000	557.00	11,697,000	貸付有価証券 9,500株（2,300株）

5703	日本軽金属ホールディングス	324,000	184.00	59,616,000	貸付有価証券 111,200株
5706	三井金属鉱業	34,600	2,180.00	75,428,000	貸付有価証券 11,800株
5707	東邦亜鉛	6,600	1,454.00	9,596,400	貸付有価証券 2,200株
5711	三菱マテリアル	84,600	2,252.00	190,519,200	貸付有価証券 37,700株（8,700株）
5713	住友金属鉱山	163,700	2,950.00	482,915,000	貸付有価証券 57,000株（800株）
5714	DOWAホールディングス	32,400	3,235.00	104,814,000	貸付有価証券 11,100株
5715	古河機械金属	22,800	1,085.00	24,738,000	貸付有価証券 10,200株（2,400株）
5721	エス・サイエンス	56,600	46.00	2,603,600	貸付有価証券 39,800株（20,500株）
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	13,300	935.00	12,435,500	貸付有価証券 9,300株（4,700株）
5727	東邦チタニウム	22,900	652.00	14,930,800	貸付有価証券 7,800株
5741	UACJ	19,400	1,943.00	37,694,200	貸付有価証券 6,600株
5757	CKサンエツ	2,700	3,430.00	9,261,000	貸付有価証券 1,200株（300株）
5801	古河電気工業	39,800	2,640.00	105,072,000	貸付有価証券 28,000株（14,400株）
5802	住友電気工業	478,800	1,243.00	595,148,400	貸付有価証券 163,700株
5803	フジクラ	154,600	320.00	49,472,000	貸付有価証券 52,900株
5805	昭和電線ホールディングス	14,900	1,149.00	17,120,100	貸付有価証券 5,100株
5807	東京特殊電線	1,900	2,083.00	3,957,700	貸付有価証券 600株
5809	タツタ電線	25,400	579.00	14,706,600	貸付有価証券 8,700株
5819	カナレ電気	2,100	1,860.00	3,906,000	
5821	平河ヒューテック	6,400	1,048.00	6,707,200	貸付有価証券 2,100株（500株）
5851	リョービ	15,800	1,222.00	19,307,600	貸付有価証券 5,700株（5,700株）
5852	アーレスティ	16,800	367.00	6,165,600	貸付有価証券 5,700株
5857	アサヒホールディングス	22,400	2,834.00	63,481,600	貸付有価証券 7,700株
3421	稲葉製作所	7,200	1,379.00	9,928,800	貸付有価証券 2,500株
3431	宮地エンジニアリンググループ	3,900	1,667.00	6,501,300	貸付有価証券 1,300株
3433	トーカロ	35,600	1,155.00	41,118,000	貸付有価証券 12,100株

3434	アルファＣｏ	4,500	941.00	4,234,500	貸付有価証券 1,600株
3436	ＳＵＭＣＯ	152,200	1,604.00	244,128,800	
3443	川田テクノロジーズ	2,600	4,915.00	12,779,000	貸付有価証券 900株
3445	ＲＳ Technologies	3,600	3,400.00	12,240,000	貸付有価証券 1,300株
3447	信和	7,400	744.00	5,505,600	貸付有価証券 1,900株
5901	東洋製罐グループホールディングス	81,600	1,189.00	97,022,400	貸付有価証券 27,900株
5902	ホッカンホールディングス	7,000	1,693.00	11,851,000	貸付有価証券 2,700株（300株）
5909	コロナ	7,100	1,006.00	7,142,600	貸付有価証券 2,400株
5911	横河ブリッジホールディングス	23,800	2,165.00	51,527,000	貸付有価証券 8,200株
5915	駒井ハルテック	2,400	1,474.00	3,537,600	貸付有価証券 800株
5923	高田機工	1,200	2,360.00	2,832,000	貸付有価証券 400株
5929	三和ホールディングス	120,700	951.00	114,785,700	貸付有価証券 42,100株
5930	文化シャッター	37,700	734.00	27,671,800	貸付有価証券 12,900株
5932	三協立山	16,500	964.00	15,906,000	貸付有価証券 6,100株
5933	アルインコ	9,300	932.00	8,667,600	貸付有価証券 3,200株
5936	東洋シャッター	3,100	712.00	2,207,200	貸付有価証券 1,000株
5938	ＬＩＸＩＬグループ	189,000	1,547.00	292,383,000	貸付有価証券 85,000株（20,400株）
5942	日本ファイルコン	9,800	529.00	5,184,200	貸付有価証券 4,400株（1,100株）
5943	ノーリツ	26,600	1,300.00	34,580,000	貸付有価証券 9,700株（9,700株）
5946	長府製作所	13,000	2,227.00	28,951,000	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
5947	リンナイ	24,900	8,960.00	223,104,000	貸付有価証券 11,200株（2,700株）
5951	ダイニチ工業	6,900	659.00	4,547,100	貸付有価証券 2,400株
5957	日東精工	17,700	454.00	8,035,800	
5958	三洋工業	1,700	1,906.00	3,240,200	貸付有価証券 600株
5959	岡部	26,000	815.00	21,190,000	貸付有価証券 11,700株（2,800株）
5970	ジーテクト	15,900	1,012.00	16,090,800	貸付有価証券 5,400株
5975	東プレ	23,900	1,242.00	29,683,800	貸付有価証券 10,800株（2,600株）

5976	高周波熱錬	24,600	544.00	13,382,400	貸付有価証券 8,400株
5981	東京製綱	9,200	582.00	5,354,400	貸付有価証券 3,100株
5985	サンコール	9,600	436.00	4,185,600	貸付有価証券 2,900株（400株）
5986	モリテック スチール	10,000	326.00	3,260,000	貸付有価証券 4,500株（1,100株）
5988	パイオラックス	18,900	1,612.00	30,466,800	貸付有価証券 13,300株（6,800株）
5989	エイチワン	12,600	565.00	7,119,000	貸付有価証券 5,700株（1,400株）
5991	日本発條	137,400	687.00	94,393,800	貸付有価証券 54,400株（7,600株）
5992	中央発條	1,500	2,853.00	4,279,500	貸付有価証券 500株
5998	アドバネクス	1,800	1,316.00	2,368,800	貸付有価証券 800株（200株）
7989	立川ブラインド工業	5,600	1,269.00	7,106,400	貸付有価証券 1,900株
8155	三益半導体工業	10,000	2,310.00	23,100,000	貸付有価証券 5,100株（1,200株）
1909	日本ドライケミカル	3,200	1,673.00	5,353,600	貸付有価証券 1,100株
5631	日本製鋼所	38,900	1,525.00	59,322,500	貸付有価証券 13,400株（100株）
6005	三浦工業	55,400	4,470.00	247,638,000	貸付有価証券 39,000株（20,000株）
6013	タクマ	43,400	1,463.00	63,494,200	貸付有価証券 19,600株（4,700株）
6101	ツガミ	26,500	896.00	23,744,000	貸付有価証券 9,100株
6103	オークマ	14,900	4,530.00	67,497,000	貸付有価証券 6,700株（1,600株）
6104	芝浦機械	14,500	2,358.00	34,191,000	
6113	アマダ	158,800	884.00	140,379,200	貸付有価証券 56,100株
6118	アイダエンジニアリング	33,500	734.00	24,589,000	貸付有価証券 11,800株
6121	滝澤鉄工所	4,000	1,015.00	4,060,000	貸付有価証券 1,800株（400株）
6134	F U J I	55,100	1,874.00	103,257,400	貸付有価証券 18,800株
6135	牧野フライス製作所	15,000	3,340.00	50,100,000	貸付有価証券 6,800株（1,600株）
6136	オーエスジー	59,200	1,571.00	93,003,200	貸付有価証券 26,600株（6,400株）
6138	ダイジェット工業	1,400	1,247.00	1,745,800	貸付有価証券 500株
6140	旭ダイヤモンド工業	33,600	492.00	16,531,200	貸付有価証券 15,100株（3,600株）

6141	D M G 森精機	81,000	1,284.00	104,004,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
6143	ソディック	30,100	813.00	24,471,300	
6146	ディスコ	17,300	25,800.00	446,340,000	貸付有価証券 6,000株
6151	日東工器	7,000	1,813.00	12,691,000	貸付有価証券 2,400株
6157	日進工具	5,000	2,704.00	13,520,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
6165	パンチ工業	11,600	440.00	5,104,000	貸付有価証券 5,100株（1,200株）
6167	富士ダイス	5,600	641.00	3,589,600	貸付有価証券 2,500株（600株）
6203	豊和工業	7,100	802.00	5,694,200	貸付有価証券 2,400株
6205	ＯＫＫ	5,200	416.00	2,163,200	貸付有価証券 3,600株（1,800株）
6208	石川製作所	3,100	1,656.00	5,133,600	貸付有価証券 2,200株（1,200株）
6210	東洋機械金属	9,200	417.00	3,836,400	貸付有価証券 3,100株
6217	津田駒工業	2,500	899.00	2,247,500	貸付有価証券 1,100株（300株）
6218	エンシュウ	3,100	921.00	2,855,100	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	20,200	1,528.00	30,865,600	貸付有価証券 14,100株（7,100株）
6235	オプトラン	14,300	2,565.00	36,679,500	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
6236	N C ホールディングス	3,900	538.00	2,098,200	貸付有価証券 1,700株（400株）
6237	イワキポンプ	8,100	988.00	8,002,800	貸付有価証券 2,700株（600株）
6238	フリー	12,500	1,026.00	12,825,000	貸付有価証券 4,300株
6240	ヤマシンフィルタ	27,800	1,090.00	30,302,000	貸付有価証券 12,400株（3,000株）
6247	日阪製作所	15,800	735.00	11,613,000	貸付有価証券 7,100株（1,700株）
6250	やまびこ	24,800	900.00	22,320,000	
6258	平田機工	6,100	5,600.00	34,160,000	貸付有価証券 2,100株
6262	ベガサスミシン製造	13,000	329.00	4,277,000	貸付有価証券 4,400株
6264	マルマエ	4,700	993.00	4,667,100	貸付有価証券 1,800株
6266	タツモ	6,000	1,663.00	9,978,000	貸付有価証券 2,000株
6268	ナプテスコ	75,500	3,325.00	251,037,500	
6269	三井海洋開発	13,600	1,506.00	20,481,600	

6272	レオン自動機	12,600	1,272.00	16,027,200	貸付有価証券 8,800株（4,500株）
6273	S M C	40,600	55,710.00	2,261,826,000	貸付有価証券 15,300株（1,500株）
6277	ホソカワミクロン	4,500	5,580.00	25,110,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
6278	ユニオンツール	4,800	2,680.00	12,864,000	
6282	オイレス工業	16,500	1,414.00	23,331,000	貸付有価証券 7,500株（1,800株）
6284	日精エー・エス・ビー機械	3,700	3,230.00	11,951,000	貸付有価証券 3,000株（1,500株）
6287	サトーホールディングス	18,300	2,294.00	41,980,200	貸付有価証券 6,200株
6289	技研製作所	11,300	4,945.00	55,878,500	貸付有価証券 3,800株
6291	日本エアーテック	4,600	1,074.00	4,940,400	貸付有価証券 2,800株（1,500株）
6292	カワタ	3,800	719.00	2,732,200	貸付有価証券 1,700株（400株）
6293	日精樹脂工業	10,700	799.00	8,549,300	貸付有価証券 4,800株（1,200株）
6294	オカダアイヨン	4,000	931.00	3,724,000	貸付有価証券 1,800株（400株）
6298	ワイエイシイホールディングス	5,500	649.00	3,569,500	貸付有価証券 3,900株（2,000株）
6301	小松製作所	586,500	2,136.50	1,253,057,250	貸付有価証券 200,500株
6302	住友重機械工業	74,100	2,362.00	175,024,200	貸付有価証券 33,300株（8,000株）
6305	日立建機	51,900	2,913.00	151,184,700	貸付有価証券 20,300株（2,500株）
6306	日工	17,700	620.00	10,974,000	貸付有価証券 6,000株
6309	巴工業	5,500	1,917.00	10,543,500	貸付有価証券 1,900株
6310	井関農機	12,900	1,133.00	14,615,700	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
6315	T O W A	13,100	1,166.00	15,274,600	貸付有価証券 4,400株
6316	丸山製作所	2,600	1,168.00	3,036,800	貸付有価証券 1,000株
6317	北川鉄工所	5,800	1,590.00	9,222,000	貸付有価証券 2,000株
6323	ローツェ	5,700	5,480.00	31,236,000	貸付有価証券 1,900株
6325	タカキタ	4,500	577.00	2,596,500	貸付有価証券 2,100株（500株）
6326	クボタ	687,000	1,628.50	1,118,779,500	貸付有価証券 74,200株（74,200株）
6328	荏原実業	3,200	2,830.00	9,056,000	
6331	三菱化工機	4,500	1,702.00	7,659,000	貸付有価証券 1,500株

6332	月島機械	23,800	1,156.00	27,512,800	貸付有価証券 10,800株（2,600株）
6333	帝国電機製作所	10,700	1,240.00	13,268,000	貸付有価証券 3,600株
6335	東京機械製作所	5,300	279.00	1,478,700	貸付有価証券 2,400株（600株）
6339	新東工業	30,700	802.00	24,621,400	貸付有価証券 13,800株（3,300株）
6340	澁谷工業	11,300	2,850.00	32,205,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
6345	アイチ コーポレーション	22,400	746.00	16,710,400	貸付有価証券 7,600株
6349	小森コーポレーション	32,800	740.00	24,272,000	貸付有価証券 14,700株（3,500株）
6351	鶴見製作所	10,000	1,798.00	17,980,000	貸付有価証券 4,500株（1,100株）
6355	住友精密工業	1,900	2,255.00	4,284,500	貸付有価証券 800株（200株）
6356	日本ギア工業	5,200	282.00	1,466,400	貸付有価証券 1,700株（400株）
6358	酒井重工業	2,400	2,139.00	5,133,600	貸付有価証券 800株
6361	荏原製作所	53,600	2,531.00	135,661,600	
6362	石井鐵工所	1,700	2,415.00	4,105,500	貸付有価証券 600株
6363	酉島製作所	13,100	792.00	10,375,200	貸付有価証券 4,500株
6364	北越工業	13,300	1,064.00	14,151,200	貸付有価証券 4,600株
6367	ダイキン工業	165,000	16,860.00	2,781,900,000	貸付有価証券 74,400株（17,800株）
6368	オルガノ	4,700	5,560.00	26,132,000	貸付有価証券 1,600株
6369	トーヨーカネツ	5,600	2,049.00	11,474,400	貸付有価証券 1,900株
6370	栗田工業	70,100	3,010.00	211,001,000	貸付有価証券 23,900株
6371	椿本チエイン	18,500	2,638.00	48,803,000	貸付有価証券 6,300株
6373	大同工業	6,100	670.00	4,087,000	貸付有価証券 2,800株（700株）
6378	木村化工機	10,800	433.00	4,676,400	貸付有価証券 3,600株
6381	アネスト岩田	20,100	833.00	16,743,300	貸付有価証券 6,900株
6383	ダイフク	66,200	9,440.00	624,928,000	貸付有価証券 29,900株（7,200株）
6387	サムコ	3,200	2,046.00	6,547,200	貸付有価証券 1,600株（400株）
6390	加藤製作所	7,100	1,183.00	8,399,300	貸付有価証券 2,400株

6393	油研工業	2,200	1,471.00	3,236,200	貸付有価証券 1,500株（700株）
6395	タダノ	62,500	895.00	55,937,500	貸付有価証券 44,000株（22,700株）
6406	フジテック	47,100	1,869.00	88,029,900	貸付有価証券 21,200株（5,100株）
6407	C K D	35,500	1,849.00	65,639,500	貸付有価証券 12,300株
6409	キトー	9,800	1,323.00	12,965,400	貸付有価証券 3,400株
6412	平和	36,100	1,803.00	65,088,300	貸付有価証券 12,400株
6413	理想科学工業	11,400	1,387.00	15,811,800	貸付有価証券 5,100株（1,200株）
6417	S A N K Y O	28,800	2,676.00	77,068,800	貸付有価証券 9,900株
6418	日本金銭機械	14,300	596.00	8,522,800	貸付有価証券 10,100株（5,200株）
6419	マースグループホールディングス	8,200	1,623.00	13,308,600	貸付有価証券 2,800株
6420	フクシマガリレイ	8,000	3,445.00	27,560,000	貸付有価証券 5,600株（2,900株）
6428	オーイズミ	5,400	399.00	2,154,600	貸付有価証券 1,900株
6430	ダイコク電機	5,900	1,291.00	7,616,900	貸付有価証券 2,100株
6432	竹内製作所	21,700	1,764.00	38,278,800	貸付有価証券 8,000株（600株）
6436	アマノ	33,900	2,294.00	77,766,600	貸付有価証券 15,300株（3,700株）
6440	J U K I	18,000	567.00	10,206,000	
6444	サンデンホールディングス	16,900	361.00	6,100,900	貸付有価証券 5,800株
6445	蛇の目ミシン工業	11,800	459.00	5,416,200	貸付有価証券 4,000株
6454	マックス	19,800	1,525.00	30,195,000	貸付有価証券 6,800株
6457	グローリー	33,300	2,480.00	82,584,000	貸付有価証券 12,300株
6458	新晃工業	12,000	1,432.00	17,184,000	貸付有価証券 4,100株
6459	大和冷機工業	18,700	933.00	17,447,100	
6460	セガサミーホールディングス	128,400	1,296.00	166,406,400	貸付有価証券 90,500株（46,600株）
6461	日本ピストンリング	4,700	1,248.00	5,865,600	貸付有価証券 1,600株
6462	リケン	6,000	3,125.00	18,750,000	貸付有価証券 2,000株
6463	T P R	17,400	1,301.00	22,637,400	貸付有価証券 6,000株
6464	ツバキ・ナカシマ	26,400	871.00	22,994,400	

6465	ホシザキ	37,900	9,180.00	347,922,000	貸付有価証券 4,100株（4,100株）
6470	大豊工業	10,600	543.00	5,755,800	貸付有価証券 4,700株（1,100株）
6471	日本精工	243,800	794.00	193,577,200	貸付有価証券 83,700株
6472	N T N	299,700	215.00	64,435,500	貸付有価証券 134,300株（32,200株）
6473	ジェイテクト	124,200	828.00	102,837,600	貸付有価証券 42,400株
6474	不二越	12,000	3,325.00	39,900,000	貸付有価証券 8,500株（4,400株）
6480	日本トムソン	38,400	341.00	13,094,400	貸付有価証券 17,300株（4,200株）
6481	T H K	75,300	2,674.00	201,352,200	
6482	ユーシン精機	10,000	715.00	7,150,000	貸付有価証券 4,600株（1,100株）
6485	前澤給装工業	4,700	1,982.00	9,315,400	貸付有価証券 1,600株
6486	イーグル工業	16,000	724.00	11,584,000	貸付有価証券 5,500株
6489	前澤工業	8,600	347.00	2,984,200	貸付有価証券 3,000株
6490	日本ビラー工業	13,100	1,377.00	18,038,700	貸付有価証券 4,400株
6498	キッツ	52,500	677.00	35,542,500	貸付有価証券 18,000株
6586	マキタ	168,900	3,890.00	657,021,000	貸付有価証券 75,800株（18,200株）
7004	日立造船	102,700	391.00	40,155,700	貸付有価証券 35,100株
7011	三菱重工業	217,000	2,520.50	546,948,500	貸付有価証券 74,200株
7013	I H I	93,300	1,510.00	140,883,000	貸付有価証券 42,100株（10,100株）
7718	スター精密	19,900	1,232.00	24,516,800	
3105	日清紡ホールディングス	86,300	788.00	68,004,400	貸付有価証券 9,700株（9,700株）
4062	イビデン	79,300	3,115.00	247,019,500	貸付有価証券 27,100株
4902	コニカミノルタ	282,900	379.00	107,219,100	貸付有価証券 96,700株
6448	ブラザー工業	158,100	1,965.00	310,666,500	貸付有価証券 54,200株
6479	ミネベアミツミ	240,400	1,954.00	469,741,600	貸付有価証券 108,200株（26,000株）
6501	日立製作所	622,200	3,400.00	2,115,480,000	貸付有価証券 212,000株
6503	三菱電機	1,294,900	1,377.00	1,783,077,300	貸付有価証券 442,700株

6504	富士電機	78,000	2,864.00	223,392,000	貸付有価証券 26,800株
6505	東洋電機製造	4,700	1,167.00	5,484,900	貸付有価証券 1,700株
6506	安川電機	139,400	3,710.00	517,174,000	貸付有価証券 97,700株（15,100株）
6507	シンフォニアテクノロジー	16,800	1,058.00	17,774,400	貸付有価証券 5,800株
6508	明電舎	23,800	1,732.00	41,221,600	貸付有価証券 8,200株
6513	オリジン	3,500	1,461.00	5,113,500	貸付有価証券 2,400株（1,200株）
6516	山洋電気	6,300	4,645.00	29,263,500	貸付有価証券 2,200株
6517	デンヨー	11,000	1,827.00	20,097,000	貸付有価証券 3,800株
6588	東芝テック	16,200	4,150.00	67,230,000	貸付有価証券 5,500株
6590	芝浦メカトロニクス	2,300	2,789.00	6,414,700	貸付有価証券 800株
6592	マブチモーター	35,800	3,455.00	123,689,000	
6594	日本電産	311,700	6,965.00	2,170,990,500	貸付有価証券 33,600株（33,600株）
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,800	480.00	3,744,000	
6616	トレックス・セミコンダクター	7,400	1,299.00	9,612,600	貸付有価証券 2,500株
6617	東光高岳	7,200	1,007.00	7,250,400	貸付有価証券 2,500株
6619	ダブル・スコープ	20,500	771.00	15,805,500	貸付有価証券 13,900株（7,900株）
6620	宮越ホールディングス	4,800	727.00	3,489,600	貸付有価証券 3,400株（1,800株）
6622	ダイヘン	14,200	3,720.00	52,824,000	貸付有価証券 4,800株
6630	ヤーマン	21,100	1,044.00	22,028,400	貸付有価証券 8,400株（2,000株）
6632	JVCケンウッド	105,500	169.00	17,829,500	貸付有価証券 35,900株
6638	ミマキエンジニアリング	11,600	379.00	4,396,400	貸付有価証券 5,200株（1,200株）
6640	第一精工	5,300	2,198.00	11,649,400	
6641	日新電機	30,300	1,029.00	31,178,700	貸付有価証券 21,400株（11,000株）
6644	大崎電気工業	25,800	502.00	12,951,600	貸付有価証券 8,800株
6645	オムロン	116,100	7,160.00	831,276,000	貸付有価証券 41,500株
6651	日東工業	19,000	1,849.00	35,131,000	貸付有価証券 6,500株
6652	I D E C	18,700	1,694.00	31,677,800	貸付有価証券 13,100株（6,800株）

6653	正興電機製作所	3,000	1,056.00	3,168,000	貸付有価証券 300株（300株）
6654	不二電機工業	2,100	1,319.00	2,769,900	貸付有価証券 600株
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	43,200	1,861.00	80,395,200	貸付有価証券 14,800株
6675	サクサホールディングス	3,000	1,710.00	5,130,000	貸付有価証券 1,400株（300株）
6676	メルコホールディングス	4,500	3,005.00	13,522,500	貸付有価証券 1,600株
6678	テクノメディカ	2,900	1,800.00	5,220,000	貸付有価証券 1,000株
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	2,800	585.00	1,638,000	貸付有価証券 900株（200株）
6701	日本電気	157,100	5,170.00	812,207,000	貸付有価証券 53,900株
6702	富士通	124,800	12,570.00	1,568,736,000	貸付有価証券 42,700株
6703	沖電気工業	52,600	1,022.00	53,757,200	貸付有価証券 18,100株
6704	岩崎通信機	5,700	836.00	4,765,200	貸付有価証券 2,000株
6706	電気興業	6,200	2,636.00	16,343,200	貸付有価証券 2,100株
6707	サンケン電気	14,100	2,223.00	31,344,300	貸付有価証券 4,800株
6715	ナカヨ	2,500	1,481.00	3,702,500	貸付有価証券 800株
6718	アイホン	7,300	1,565.00	11,424,500	貸付有価証券 2,500株
6723	ルネサスエレクトロニクス	619,500	602.00	372,939,000	貸付有価証券 210,900株
6724	セイコーエプソン	160,700	1,224.00	196,696,800	貸付有価証券 113,200株（58,300株）
6727	ワコム	87,000	561.00	48,807,000	貸付有価証券 61,300株（31,400株）
6728	アルバック	23,800	3,210.00	76,398,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
6730	アクセル	5,400	789.00	4,260,600	貸付有価証券 2,900株（1,100株）
6737	E I Z O	10,100	4,060.00	41,006,000	貸付有価証券 7,000株（3,500株）
6740	ジャパンディスプレイ	374,200	48.00	17,961,600	貸付有価証券 263,700株（136,900株）
6741	日本信号	33,000	1,130.00	37,290,000	貸付有価証券 23,200株（11,900株）
6742	京三製作所	30,300	526.00	15,937,800	貸付有価証券 21,300株（11,000株）
6744	能美防災	17,100	2,036.00	34,815,600	貸付有価証券 5,900株

6745	ホーチキ	9,400	1,243.00	11,684,200	貸付有価証券 3,200株
6748	星和電機	6,400	584.00	3,737,600	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	14,300	5,210.00	74,503,000	貸付有価証券 4,800株
6752	パナソニック	1,479,600	924.80	1,368,334,080	貸付有価証券 540,500株（34,700株）
6753	シャープ	149,800	1,163.00	174,217,400	貸付有価証券 67,000株（16,100株）
6754	アンリツ	83,400	2,554.00	213,003,600	貸付有価証券 37,500株（9,000株）
6755	富士通ゼネラル	35,100	2,170.00	76,167,000	貸付有価証券 24,700株（12,600株）
6758	ソニー	811,200	7,555.00	6,128,616,000	貸付有価証券 280,600株
6762	T D K	62,500	10,640.00	665,000,000	貸付有価証券 21,500株
6763	帝国通信工業	5,700	1,211.00	6,902,700	貸付有価証券 2,000株
6768	タムラ製作所	43,300	449.00	19,441,700	貸付有価証券 14,900株
6770	アルプスアルパイン	114,600	1,431.00	163,992,600	貸付有価証券 39,500株
6771	池上通信機	4,100	874.00	3,583,400	貸付有価証券 2,800株（1,400株）
6779	日本電波工業	11,700	357.00	4,176,900	貸付有価証券 4,000株
6785	鈴木	6,400	752.00	4,812,800	貸付有価証券 700株（700株）
6788	日本トリム	1,700	3,255.00	5,533,500	貸付有価証券 600株
6789	ローランド ディー．ジー．	7,100	1,261.00	8,953,100	
6794	フォスター電機	13,600	1,115.00	15,164,000	貸付有価証券 4,600株
6798	S M K	3,300	2,511.00	8,286,300	貸付有価証券 1,100株
6800	ヨコオ	8,400	2,572.00	21,604,800	貸付有価証券 2,900株
6803	ティアック	9,300	140.00	1,302,000	貸付有価証券 3,200株
6804	ホシデン	35,400	962.00	34,054,800	貸付有価証券 12,100株
6806	ヒロセ電機	20,100	11,860.00	238,386,000	貸付有価証券 9,000株（2,200株）
6807	日本航空電子工業	29,700	1,459.00	43,332,300	貸付有価証券 10,100株
6809	T O A	13,900	733.00	10,188,700	貸付有価証券 4,800株
6810	マクセルホールディングス	27,900	1,017.00	28,374,300	貸付有価証券 9,500株

6814	古野電気	16,700	953.00	15,915,100	貸付有価証券 5,700株
6815	ユニデンホールディングス	3,600	1,843.00	6,634,800	貸付有価証券 2,400株（1,200株）
6817	スミダコーポレーション	9,900	754.00	7,464,600	貸付有価証券 3,400株
6820	アイコム	7,200	3,025.00	21,780,000	貸付有価証券 2,400株
6823	リオン	5,400	2,297.00	12,403,800	貸付有価証券 1,900株
6826	本多通信工業	11,100	443.00	4,917,300	貸付有価証券 3,800株
6839	船井電機	13,100	507.00	6,641,700	貸付有価証券 4,400株
6841	横河電機	118,800	1,656.00	196,732,800	貸付有価証券 53,700株（12,900株）
6844	新電元工業	4,600	2,207.00	10,152,200	貸付有価証券 1,600株
6845	アズビル	81,700	3,290.00	268,793,000	貸付有価証券 27,900株
6848	東亜ディーケーケー	6,400	888.00	5,683,200	貸付有価証券 2,900株（700株）
6849	日本光電工業	53,500	3,535.00	189,122,500	貸付有価証券 18,400株
6850	チノー	4,500	1,345.00	6,052,500	貸付有価証券 3,100株（1,600株）
6853	共和電業	13,500	412.00	5,562,000	
6855	日本電子材料	5,100	959.00	4,890,900	貸付有価証券 1,700株
6856	堀場製作所	25,700	5,550.00	142,635,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
6857	アドバンテスト	96,300	5,980.00	575,874,000	貸付有価証券 32,800株
6858	小野測器	5,400	534.00	2,883,600	
6859	エスベック	11,500	1,740.00	20,010,000	貸付有価証券 5,100株（1,200株）
6861	キーエンス	117,300	44,740.00	5,248,002,000	貸付有価証券 40,200株
6866	日置電機	6,800	2,970.00	20,196,000	貸付有価証券 700株（700株）
6869	シスメックス	92,600	8,249.00	763,857,400	貸付有価証券 31,800株
6871	日本マイクロニクス	22,500	1,065.00	23,962,500	
6875	メガチップス	12,000	2,205.00	26,460,000	貸付有価証券 4,100株
6877	O B A R A G R O U P	7,600	3,250.00	24,700,000	貸付有価証券 2,300株
6901	澤藤電機	1,600	1,638.00	2,620,800	貸付有価証券 700株（200株）
6904	原田工業	6,100	814.00	4,965,400	貸付有価証券 2,800株（700株）

6905	コーセル	17,200	933.00	16,047,600	貸付有価証券 12,100株（6,700株）
6908	イリソ電子工業	10,900	3,490.00	38,041,000	貸付有価証券 4,900株（1,200株）
6914	オブテックスグループ	21,200	1,224.00	25,948,800	貸付有価証券 7,600株（7,600株）
6915	千代田インテグレ	6,000	1,655.00	9,930,000	
6916	アイ・オー・データ機器	4,200	1,136.00	4,771,200	貸付有価証券 1,600株
6920	レーザーテック	56,900	10,480.00	596,312,000	
6923	スタンレー電気	91,000	2,549.00	231,959,000	貸付有価証券 41,100株（9,900株）
6924	岩崎電気	5,000	2,008.00	10,040,000	貸付有価証券 1,700株
6925	ウシオ電機	71,500	1,329.00	95,023,500	貸付有価証券 33,800株（8,100株）
6926	岡谷電機産業	10,100	328.00	3,312,800	貸付有価証券 4,600株（1,100株）
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	331.00	3,938,900	貸付有価証券 4,100株
6928	エノモト	3,900	1,031.00	4,020,900	貸付有価証券 1,300株
6929	日本セラミック	13,100	2,272.00	29,763,200	
6932	遠藤照明	6,500	602.00	3,913,000	貸付有価証券 2,200株
6937	古河電池	9,200	1,481.00	13,625,200	貸付有価証券 4,200株（1,000株）
6938	双信電機	6,300	387.00	2,438,100	貸付有価証券 4,400株（2,200株）
6941	山一電機	9,400	1,422.00	13,366,800	貸付有価証券 3,200株
6947	図研	8,400	2,782.00	23,368,800	貸付有価証券 3,800株（900株）
6951	日本電子	25,500	2,969.00	75,709,500	貸付有価証券 18,000株（9,300株）
6952	カシオ計算機	114,600	1,828.00	209,488,800	貸付有価証券 51,600株（12,400株）
6954	ファナック	123,000	19,370.00	2,382,510,000	貸付有価証券 55,400株（13,300株）
6958	日本シイエムケイ	30,400	425.00	12,920,000	貸付有価証券 13,800株（3,300株）
6961	エンプラス	6,600	2,361.00	15,582,600	貸付有価証券 2,200株
6962	大真空	4,700	1,991.00	9,357,700	貸付有価証券 1,600株
6963	ローム	57,500	7,130.00	409,975,000	貸付有価証券 19,700株
6965	浜松ホトニクス	92,900	4,825.00	448,242,500	貸付有価証券 41,800株（10,000株）
6966	三井ハイテック	14,300	1,640.00	23,452,000	貸付有価証券 4,900株

6967	新光電気工業	43,500	1,469.00	63,901,500	貸付有価証券 14,900株
6971	京セラ	182,200	5,989.00	1,091,195,800	貸付有価証券 62,500株
6976	太陽誘電	57,600	3,350.00	192,960,000	貸付有価証券 40,500株（20,900株）
6981	村田製作所	380,400	6,387.00	2,429,614,800	貸付有価証券 130,500株
6986	双葉電子工業	20,500	997.00	20,438,500	貸付有価証券 7,000株
6989	北陸電気工業	5,200	902.00	4,690,400	貸付有価証券 3,600株（1,800株）
6996	ニチコン	43,900	734.00	32,222,600	貸付有価証券 14,900株
6997	日本ケミコン	9,800	1,745.00	17,101,000	貸付有価証券 4,400株（1,100株）
6999	K O A	19,500	1,001.00	19,519,500	貸付有価証券 6,700株
7244	市光工業	19,400	494.00	9,583,600	
7276	小糸製作所	77,600	4,300.00	333,680,000	貸付有価証券 31,900株（5,400株）
7280	ミツバ	23,800	452.00	10,757,600	貸付有価証券 16,800株（8,600株）
7735	S C R E E Nホールディングス	22,500	5,030.00	113,175,000	貸付有価証券 15,800株（8,200株）
7739	キャノン電子	13,600	1,650.00	22,440,000	
7751	キャノン	697,100	2,253.50	1,570,914,850	貸付有価証券 253,000株（253,000株）
7752	リコー	329,400	795.00	261,873,000	貸付有価証券 232,100株（118,500株）
7965	象印マホービン	37,900	1,477.00	55,978,300	貸付有価証券 4,100株（4,100株）
7999	M U T O Hホールディングス	1,600	1,537.00	2,459,200	貸付有価証券 600株
8035	東京エレクトロン	82,200	25,545.00	2,099,799,000	貸付有価証券 29,500株
3116	トヨタ紡織	37,700	1,448.00	54,589,600	貸付有価証券 13,000株
3526	芦森工業	2,700	1,049.00	2,832,300	貸付有価証券 1,800株（900株）
5949	ユニプレス	25,100	968.00	24,296,800	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
6201	豊田自動織機	104,800	5,810.00	608,888,000	貸付有価証券 47,100株（11,300株）
6455	モリタホールディングス	22,600	1,784.00	40,318,400	貸付有価証券 15,900株（8,100株）
6584	三櫻工業	16,400	811.00	13,300,400	貸付有価証券 5,600株
6902	デンソー	285,100	4,104.00	1,170,050,400	貸付有価証券 97,500株

6995	東海理化電機製作所	34,100	1,560.00	53,196,000	貸付有価証券 15,400株（3,700株）
7003	三井Ｅ＆Ｓホールディングス	46,800	428.00	20,030,400	貸付有価証券 16,000株
7012	川崎重工業	100,800	1,564.00	157,651,200	貸付有価証券 45,300株（10,900株）
7014	名村造船所	41,700	161.00	6,713,700	貸付有価証券 29,400株（15,200株）
7022	サノヤスホールディングス	15,700	169.00	2,653,300	貸付有価証券 5,400株
7102	日本車輛製造	4,700	2,584.00	12,144,800	貸付有価証券 1,600株
7105	三菱ロジスネクスト	17,100	915.00	15,646,500	貸付有価証券 5,900株
7122	近畿車輛	1,900	1,226.00	2,329,400	貸付有価証券 1,300株（600株）
7201	日産自動車	1,527,300	404.90	618,403,770	貸付有価証券 905,400株
7202	いすゞ自動車	375,200	961.80	360,867,360	貸付有価証券 128,800株
7203	トヨタ自動車	1,444,900	6,795.00	9,818,095,500	
7205	日野自動車	161,700	718.00	116,100,600	貸付有価証券 55,300株
7211	三菱自動車工業	479,300	277.00	132,766,100	貸付有価証券 337,700株（173,800株）
7212	エフテック	9,000	513.00	4,617,000	貸付有価証券 3,100株
7213	レシップホールディングス	5,100	571.00	2,912,100	貸付有価証券 1,600株
7214	G M B	2,300	692.00	1,591,600	貸付有価証券 800株
7215	ファルテック	2,300	674.00	1,550,200	貸付有価証券 700株
7220	武蔵精密工業	28,800	938.00	27,014,400	貸付有価証券 13,000株（3,100株）
7222	日産車体	25,300	889.00	22,491,700	貸付有価証券 17,800株（9,100株）
7224	新明和工業	34,900	1,009.00	35,214,100	貸付有価証券 12,200株
7226	極東開発工業	24,100	1,302.00	31,378,200	貸付有価証券 16,900株（8,700株）
7230	日信工業	26,300	2,189.00	57,570,700	貸付有価証券 8,900株
7231	トピー工業	10,600	1,268.00	13,440,800	貸付有価証券 7,400株（3,800株）
7236	ティラド	4,700	1,409.00	6,622,300	貸付有価証券 1,600株
7238	曙ブレーキ工業	71,100	181.00	12,869,100	貸付有価証券 50,000株（25,700株）
7239	タチエス	21,300	875.00	18,637,500	貸付有価証券 14,900株（7,600株）

7240	N O K	69,600	1,326.00	92,289,600	貸付有価証券 30,900株（7,100株）
7241	フタバ産業	36,000	446.00	16,056,000	貸付有価証券 12,300株
7242	K Y B	14,500	2,079.00	30,145,500	貸付有価証券 4,900株
7245	大同メタル工業	24,800	543.00	13,466,400	貸付有価証券 11,100株（2,700株）
7246	プレス工業	64,200	279.00	17,911,800	貸付有価証券 22,000株
7247	ミクニ	16,400	278.00	4,559,200	貸付有価証券 7,400株（1,800株）
7250	太平洋工業	27,100	944.00	25,582,400	貸付有価証券 9,200株
7251	ケーヒン	28,100	2,525.00	70,952,500	貸付有価証券 10,200株
7256	河西工業	17,500	453.00	7,927,500	貸付有価証券 7,900株（1,900株）
7259	アイシン精機	106,600	3,150.00	335,790,000	貸付有価証券 36,500株
7261	マツダ	381,000	648.00	246,888,000	貸付有価証券 171,900株（41,300株）
7266	今仙電機製作所	12,000	735.00	8,820,000	貸付有価証券 5,400株（1,300株）
7267	本田技研工業	1,019,600	2,779.50	2,833,978,200	
7269	スズキ	256,700	3,733.00	958,261,100	
7270	S U B A R U	402,000	2,295.50	922,791,000	貸付有価証券 137,400株
7271	安永	6,200	1,102.00	6,832,400	貸付有価証券 2,800株（700株）
7272	ヤマハ発動機	168,900	1,681.00	283,920,900	貸付有価証券 61,300株（61,300株）
7274	ショーワ	30,600	2,224.00	68,054,400	貸付有価証券 10,500株
7277	T B K	15,400	441.00	6,791,400	貸付有価証券 5,200株
7278	エクセディ	17,600	1,621.00	28,529,600	貸付有価証券 6,000株
7282	豊田合成	41,800	2,245.00	93,841,000	貸付有価証券 14,300株
7283	愛三工業	20,300	538.00	10,921,400	貸付有価証券 6,900株
7284	盟和産業	2,000	935.00	1,870,000	貸付有価証券 700株
7291	日本プラスト	10,100	456.00	4,605,600	貸付有価証券 4,600株（1,100株）
7294	ヨロズ	12,100	1,082.00	13,092,200	貸付有価証券 8,500株（4,400株）
7296	エフ・シー・シー	21,200	1,880.00	39,856,000	貸付有価証券 7,300株
7309	シマノ	48,500	20,520.00	995,220,000	

7313	テイ・エス テック	30,100	2,978.00	89,637,800	貸付有価証券 13,600株（3,300株）
7408	ジャムコ	6,500	769.00	4,998,500	貸付有価証券 2,900株（700株）
4543	テルモ	366,400	4,172.00	1,528,620,800	貸付有価証券 125,300株
5187	クリエートメディック	4,300	980.00	4,214,000	
6376	日機装	38,800	1,038.00	40,274,400	貸付有価証券 14,000株（14,000株）
7600	日本エム・ディ・エム	7,500	1,699.00	12,742,500	貸付有価証券 3,300株（800株）
7701	島津製作所	154,700	2,852.00	441,204,400	貸付有価証券 69,900株（16,800株）
7702	J M S	10,900	826.00	9,003,400	貸付有価証券 3,800株
7709	クボテック	3,300	333.00	1,098,900	貸付有価証券 2,300株（1,200株）
7715	長野計器	9,400	992.00	9,324,800	貸付有価証券 3,200株
7717	ブイ・テクノロジー	6,100	3,765.00	22,966,500	貸付有価証券 4,200株（2,100株）
7721	東京計器	8,200	960.00	7,872,000	貸付有価証券 2,900株
7723	愛知時計電機	1,700	4,460.00	7,582,000	貸付有価証券 600株
7725	インターアクション	6,900	2,030.00	14,007,000	貸付有価証券 3,100株（700株）
7727	オーバル	11,600	230.00	2,668,000	貸付有価証券 4,000株
7729	東京精密	23,500	3,435.00	80,722,500	貸付有価証券 8,000株
7730	マニー	51,600	2,853.00	147,214,800	貸付有価証券 23,200株（5,600株）
7731	ニコン	197,700	924.00	182,674,800	貸付有価証券 94,600株（22,700株）
7732	トプコン	65,200	866.00	56,463,200	貸付有価証券 29,500株（7,100株）
7733	オリンパス	716,500	2,132.50	1,527,936,250	
7734	理研計器	11,400	2,444.00	27,861,600	貸付有価証券 4,200株（300株）
7740	タムロン	10,400	1,853.00	19,271,200	
7741	ＨＯＹＡ	258,600	10,540.00	2,725,644,000	貸付有価証券 103,400株（14,300株）
7743	シード	5,500	719.00	3,954,500	貸付有価証券 2,500株（600株）
7744	ノーリツ鋼機	8,700	1,506.00	13,102,200	貸付有価証券 3,000株
7745	エー・アンド・デイ	11,800	709.00	8,366,200	貸付有価証券 4,000株
7747	朝日インテック	146,600	3,070.00	450,062,000	

7762	シチズン時計	151,700	355.00	53,853,500	貸付有価証券 67,900株（16,300株）
7769	リズム時計工業	4,000	605.00	2,420,000	貸付有価証券 1,800株（400株）
7775	大研医器	9,000	603.00	5,427,000	貸付有価証券 3,100株
7780	メニコン	18,300	5,320.00	97,356,000	貸付有価証券 8,000株（1,900株）
7782	シンシア	1,400	440.00	616,000	貸付有価証券 500株
7979	松風	5,800	1,535.00	8,903,000	貸付有価証券 2,000株
8050	セイコーホールディングス	18,300	1,718.00	31,439,400	貸付有価証券 12,900株（6,600株）
8086	ニプロ	89,600	1,174.00	105,190,400	貸付有価証券 30,600株
7811	中本パックス	3,300	1,528.00	5,042,400	貸付有価証券 1,100株
7816	スノーピーク	6,900	1,089.00	7,514,100	貸付有価証券 2,100株
7817	パラマウントベッドホールディングス	13,700	4,405.00	60,348,500	貸付有価証券 6,200株（1,500株）
7818	トランザクション	7,100	1,042.00	7,398,200	貸付有価証券 2,900株
7819	粧美堂	3,800	341.00	1,295,800	貸付有価証券 1,300株
7820	ニホンフラッシュ	12,100	1,404.00	16,988,400	貸付有価証券 4,200株
7821	前田工織	14,300	2,440.00	34,892,000	貸付有価証券 6,400株（1,500株）
7822	永大産業	16,900	308.00	5,205,200	貸付有価証券 5,800株
7823	アートネイチャー	13,800	595.00	8,211,000	貸付有価証券 4,700株
7832	バンダイナムコホールディングス	133,900	5,803.00	777,021,700	貸付有価証券 84,100株（38,300株）
7833	アイフィスジャパン	3,300	721.00	2,379,300	貸付有価証券 1,500株（400株）
7838	共立印刷	21,600	140.00	3,024,000	貸付有価証券 7,400株
7839	ＳＨＯＥＩ	11,300	2,599.00	29,368,700	貸付有価証券 5,600株（1,400株）
7840	フランスベッドホールディングス	18,300	844.00	15,445,200	貸付有価証券 6,300株
7846	パイロットコーポレーション	21,100	3,130.00	66,043,000	
7856	萩原工業	7,200	1,423.00	10,245,600	貸付有価証券 2,500株
7862	トッパン・フォームズ	27,700	1,064.00	29,472,800	貸付有価証券 9,500株
7864	フジシールインターナショナル	29,000	2,040.00	59,160,000	貸付有価証券 13,100株（3,100株）

7867	タカトミー	58,100	849.00	49,326,900	貸付有価証券 26,100株（6,300株）
7868	廣済堂	9,000	777.00	6,993,000	貸付有価証券 4,100株（1,000株）
7872	エステールホールディングス	3,500	600.00	2,100,000	貸付有価証券 1,200株
7873	アーク	49,400	114.00	5,631,600	貸付有価証券 16,900株
7885	タカノ	5,100	695.00	3,544,500	貸付有価証券 1,700株
7893	プロネクサス	11,100	1,169.00	12,975,900	貸付有価証券 5,000株（1,200株）
7897	ホクシン	8,000	124.00	992,000	貸付有価証券 2,700株
7898	ウッドワン	4,400	1,140.00	5,016,000	貸付有価証券 1,400株
7905	大建工業	8,700	1,776.00	15,451,200	貸付有価証券 3,000株
7911	凸版印刷	182,800	1,814.00	331,599,200	貸付有価証券 62,600株
7912	大日本印刷	169,500	2,431.00	412,054,500	貸付有価証券 58,100株
7914	共同印刷	4,000	2,790.00	11,160,000	貸付有価証券 1,400株
7915	N I S S H A	26,600	990.00	26,334,000	
7916	光村印刷	1,100	1,502.00	1,652,200	貸付有価証券 400株
7921	T A K A R A & C O M P A N Y	6,200	1,831.00	11,352,200	貸付有価証券 2,100株
7936	アシックス	106,900	1,280.00	136,832,000	貸付有価証券 75,300株（38,800株）
7937	ツツミ	4,000	1,853.00	7,412,000	貸付有価証券 1,400株
7949	小松ウオール工業	3,900	1,765.00	6,883,500	貸付有価証券 1,400株
7951	ヤマハ	77,000	5,030.00	387,310,000	貸付有価証券 26,300株
7952	河合楽器製作所	4,000	2,710.00	10,840,000	貸付有価証券 1,400株
7955	クリナップ	12,000	535.00	6,420,000	貸付有価証券 4,700株（600株）
7956	ビジョン	78,300	4,210.00	329,643,000	貸付有価証券 8,400株（8,400株）
7959	オリバー	2,700	2,480.00	6,696,000	
7961	兼松サステック	800	1,450.00	1,160,000	貸付有価証券 300株
7962	キングジム	10,800	869.00	9,385,200	貸付有価証券 3,600株
7966	リンテック	30,800	2,479.00	76,353,200	貸付有価証券 13,900株（3,300株）
7972	イトーキ	27,500	349.00	9,597,500	貸付有価証券 3,000株（3,000株）

7974	任天堂	79,400	48,270.00	3,832,638,000	貸付有価証券 27,100株
7976	三菱鉛筆	21,300	1,325.00	28,222,500	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
7981	タカスタンダード	26,800	1,478.00	39,610,400	貸付有価証券 9,100株
7984	コクヨ	62,100	1,267.00	78,680,700	
7987	ナカバヤシ	12,700	581.00	7,378,700	貸付有価証券 4,300株
7990	グローブライド	5,800	2,122.00	12,307,600	貸付有価証券 2,000株
7994	オカムラ	45,200	750.00	33,900,000	貸付有価証券 20,300株（4,900株）
8022	美津濃	11,800	2,161.00	25,499,800	貸付有価証券 4,000株
9501	東京電力ホールディングス	1,033,800	334.00	345,289,200	貸付有価証券 353,400株
9502	中部電力	396,200	1,372.00	543,586,400	貸付有価証券 135,500株
9503	関西電力	490,600	1,015.50	498,204,300	貸付有価証券 180,400株（12,100株）
9504	中国電力	186,800	1,441.00	269,178,800	貸付有価証券 61,200株
9505	北陸電力	118,400	672.00	79,564,800	貸付有価証券 83,400株（42,800株）
9506	東北電力	323,500	1,009.00	326,411,500	貸付有価証券 110,300株
9507	四国電力	116,600	780.00	90,948,000	貸付有価証券 39,900株
9508	九州電力	266,900	878.00	234,338,200	貸付有価証券 91,200株
9509	北海道電力	121,200	409.00	49,570,800	貸付有価証券 41,400株
9511	沖縄電力	25,200	1,761.00	44,377,200	
9513	電源開発	103,000	2,035.00	209,605,000	貸付有価証券 35,300株
9514	エフオン	7,000	582.00	4,074,000	貸付有価証券 700株（700株）
9517	イーレックス	18,500	1,375.00	25,437,500	貸付有価証券 6,400株
9519	レノバ	21,600	924.00	19,958,400	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	249,000	2,508.50	624,616,500	貸付有価証券 175,500株（90,300株）
9532	大阪瓦斯	251,300	2,109.00	529,991,700	貸付有価証券 85,900株
9533	東邦瓦斯	63,700	5,380.00	342,706,000	貸付有価証券 26,500株（4,600株）
9534	北海道瓦斯	7,000	1,587.00	11,109,000	貸付有価証券 2,400株

9535	広島ガス	26,700	356.00	9,505,200	貸付有価証券 9,100株
9536	西部瓦斯	14,600	2,607.00	38,062,200	貸付有価証券 6,600株（1,600株）
9543	静岡ガス	36,800	975.00	35,880,000	
9551	メタウォーター	6,300	4,780.00	30,114,000	貸付有価証券 2,200株
2384	S B S ホールディングス	11,200	2,304.00	25,804,800	
9001	東武鉄道	135,000	3,690.00	498,150,000	貸付有価証券 61,400株（14,700株）
9003	相鉄ホールディングス	41,400	2,893.00	119,770,200	貸付有価証券 18,700株（4,500株）
9005	東急	326,600	1,533.00	500,677,800	貸付有価証券 112,000株
9006	京浜急行電鉄	166,300	1,703.00	283,208,900	貸付有価証券 75,000株（18,000株）
9007	小田急電鉄	192,600	2,701.00	520,212,600	貸付有価証券 86,900株（20,900株）
9008	京王電鉄	67,200	6,280.00	422,016,000	貸付有価証券 30,400株（7,300株）
9009	京成電鉄	90,100	3,400.00	306,340,000	貸付有価証券 30,900株
9010	富士急行	17,700	3,155.00	55,843,500	貸付有価証券 12,400株（6,400株）
9014	新京成電鉄	3,300	2,235.00	7,375,500	貸付有価証券 1,100株
9020	東日本旅客鉄道	227,900	7,600.00	1,732,040,000	
9021	西日本旅客鉄道	115,400	6,119.00	706,132,600	
9022	東海旅客鉄道	107,700	16,860.00	1,815,822,000	
9024	西武ホールディングス	173,800	1,221.00	212,209,800	貸付有価証券 77,900株（18,700株）
9025	鴻池運輸	20,600	1,115.00	22,969,000	貸付有価証券 9,300株（2,200株）
9031	西日本鉄道	35,900	2,919.00	104,792,100	貸付有価証券 25,300株（13,000株）
9037	ハマキョウレックス	9,900	3,085.00	30,541,500	貸付有価証券 3,400株
9039	サカイ引越センター	6,800	5,630.00	38,284,000	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	122,700	4,890.00	600,003,000	貸付有価証券 86,400株（44,500株）
9042	阪急阪神ホールディングス	163,600	3,635.00	594,686,000	貸付有価証券 115,200株（59,300株）
9044	南海電気鉄道	58,100	2,488.00	144,552,800	貸付有価証券 26,100株（6,300株）
9045	京阪ホールディングス	54,600	4,810.00	262,626,000	貸付有価証券 24,600株（5,900株）
9046	神戸電鉄	2,900	3,725.00	10,802,500	貸付有価証券 1,000株

9048	名古屋鉄道	100,800	3,050.00	307,440,000	貸付有価証券 45,400株（10,900株）
9052	山陽電気鉄道	8,800	2,173.00	19,122,400	貸付有価証券 3,000株
9062	日本通運	42,500	5,480.00	232,900,000	貸付有価証券 14,900株
9064	ヤマトホールディングス	215,000	2,345.00	504,175,000	貸付有価証券 73,500株
9065	山九	34,100	4,090.00	139,469,000	貸付有価証券 11,700株
9067	丸運	7,000	230.00	1,610,000	貸付有価証券 2,900株（500株）
9068	丸全昭和運輸	9,900	3,215.00	31,828,500	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	67,600	796.00	53,809,600	貸付有価証券 23,100株
9070	トナミホールディングス	2,900	5,700.00	16,530,000	貸付有価証券 1,200株（200株）
9072	ニッコンホールディングス	43,900	2,118.00	92,980,200	貸付有価証券 19,800株（4,800株）
9074	日本石油輸送	1,300	3,080.00	4,004,000	貸付有価証券 400株
9075	福山通運	15,700	3,705.00	58,168,500	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	91,800	1,396.00	128,152,800	貸付有価証券 41,300株（9,900株）
9078	エスライン	3,700	991.00	3,666,700	貸付有価証券 1,300株
9081	神奈川中央交通	3,000	4,165.00	12,495,000	貸付有価証券 1,100株
9086	日立物流	22,500	2,882.00	64,845,000	貸付有価証券 10,200株（2,400株）
9090	丸和運輸機関	12,900	2,998.00	38,674,200	貸付有価証券 4,400株
9099	C & F ロジホールディングス	12,400	1,529.00	18,959,600	貸付有価証券 5,500株（1,300株）
9142	九州旅客鉄道	107,500	2,867.00	308,202,500	貸付有価証券 37,300株
9143	S Gホールディングス	128,700	3,560.00	458,172,000	貸付有価証券 57,600株（13,800株）
9101	日本郵船	102,600	1,500.00	153,900,000	貸付有価証券 72,200株（37,100株）
9104	商船三井	77,600	1,898.00	147,284,800	貸付有価証券 26,400株
9107	川崎汽船	37,800	1,070.00	40,446,000	貸付有価証券 26,600株（13,700株）
9110	N S ユナイテッド海運	6,700	1,508.00	10,103,600	貸付有価証券 2,300株
9115	明治海運	13,000	331.00	4,303,000	貸付有価証券 5,900株（1,400株）
9119	飯野海運	58,100	338.00	19,637,800	貸付有価証券 40,800株（21,000株）

9130	共栄タンカー	2,200	809.00	1,779,800	貸付有価証券 800株
9308	乾汽船	7,100	872.00	6,191,200	貸付有価証券 5,000株（2,500株）
9201	日本航空	216,900	1,975.50	428,485,950	貸付有価証券 76,800株
9202	A N Aホールディングス	224,200	2,475.00	554,895,000	貸付有価証券 158,000株（81,400株）
9232	パスコ	2,400	1,533.00	3,679,200	貸付有価証券 800株
9058	トランコム	3,400	7,050.00	23,970,000	貸付有価証券 1,100株
9066	日新	10,600	1,602.00	16,981,200	貸付有価証券 3,600株
9301	三菱倉庫	38,900	2,674.00	104,018,600	貸付有価証券 27,400株（14,100株）
9302	三井倉庫ホールディングス	14,000	1,492.00	20,888,000	貸付有価証券 4,800株
9303	住友倉庫	44,100	1,274.00	56,183,400	貸付有価証券 20,400株（4,900株）
9304	澁澤倉庫	6,700	2,005.00	13,433,500	貸付有価証券 2,700株（400株）
9306	東陽倉庫	22,100	329.00	7,270,900	貸付有価証券 10,000株（2,400株）
9310	日本トランスシティ	27,000	482.00	13,014,000	貸付有価証券 9,200株
9312	ケイヒン	2,400	1,291.00	3,098,400	貸付有価証券 800株
9319	中央倉庫	7,500	942.00	7,065,000	貸付有価証券 2,600株
9322	川西倉庫	2,200	1,021.00	2,246,200	貸付有価証券 800株
9324	安田倉庫	10,100	896.00	9,049,600	貸付有価証券 3,400株
9325	ファイズホールディングス	2,600	1,096.00	2,849,600	貸付有価証券 1,200株（300株）
9351	東洋埠頭	3,700	1,344.00	4,972,800	貸付有価証券 1,300株
9358	宇徳	10,500	551.00	5,785,500	貸付有価証券 3,600株
9364	上組	68,400	2,074.00	141,861,600	貸付有価証券 24,100株
9366	サンリツ	2,900	593.00	1,719,700	貸付有価証券 1,000株
9368	キムラユニティー	3,300	1,020.00	3,366,000	貸付有価証券 1,100株
9369	キューソー流通システム	3,100	1,605.00	4,975,500	貸付有価証券 1,100株
9375	近鉄エクスプレス	26,100	1,849.00	48,258,900	貸付有価証券 8,900株

9380	東海運	7,000	276.00	1,932,000	貸付有価証券 2,400株
9381	エーアイテイー	8,700	751.00	6,533,700	貸付有価証券 3,900株（900株）
9384	内外トランスライン	4,300	970.00	4,171,000	貸付有価証券 1,800株（500株）
9386	日本コンセプト	3,900	1,240.00	4,836,000	
1973	NECネットエスアイ	36,000	2,156.00	77,616,000	貸付有価証券 12,300株
2307	クロスキャット	3,300	1,297.00	4,280,100	貸付有価証券 1,500株（400株）
2317	システナ	45,300	1,479.00	66,998,700	貸付有価証券 20,400株（4,900株）
2326	デジタルアーツ	6,300	9,000.00	56,700,000	貸付有価証券 2,200株
2327	日鉄ソリューションズ	19,000	2,922.00	55,518,000	貸付有価証券 8,600株（2,100株）
2335	キューブシステム	6,800	861.00	5,854,800	貸付有価証券 3,000株（700株）
2352	エイジア	2,300	1,525.00	3,507,500	貸付有価証券 1,100株（300株）
2359	コア	5,400	1,212.00	6,544,800	貸付有価証券 2,500株（600株）
3031	ラクーンホールディングス	5,700	983.00	5,603,100	貸付有価証券 2,100株
3040	ソリトンシステムズ	5,600	1,534.00	8,590,400	貸付有価証券 2,500株（600株）
3371	ソフトクリエイイトホールディングス	5,500	2,292.00	12,606,000	貸付有価証券 1,900株
3626	T I S	127,100	2,265.00	287,881,500	貸付有価証券 57,300株（13,800株）
3627	ネオス	5,100	724.00	3,692,400	貸付有価証券 1,700株
3630	電算システム	4,800	3,835.00	18,408,000	貸付有価証券 1,800株（100株）
3632	グリー	77,900	492.00	38,326,800	
3635	コーエーテクモホールディングス	26,000	3,475.00	90,350,000	貸付有価証券 8,900株
3636	三菱総合研究所	5,400	4,110.00	22,194,000	貸付有価証券 1,900株
3639	ボルテージ	3,000	469.00	1,407,000	貸付有価証券 1,100株（300株）
3640	電算	1,400	2,252.00	3,152,800	貸付有価証券 500株
3648	A G S	7,200	864.00	6,220,800	貸付有価証券 2,400株
3649	ファインデックス	10,700	1,087.00	11,630,900	貸付有価証券 4,900株（1,200株）
3655	ブレインパッド	3,300	4,715.00	15,559,500	貸付有価証券 1,100株（300株）
3656	K L a b	24,600	747.00	18,376,200	貸付有価証券 8,400株

3657	ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	15,300	927.00	14,183,100	貸付有価証券 8,600株（3,300株）
3658	イーブックイニシアティブジャパン	1,800	3,170.00	5,706,000	貸付有価証券 600株
3659	ネクソン	354,500	2,560.00	907,520,000	
3660	アイスタイル	35,600	286.00	10,181,600	貸付有価証券 11,100株
3661	エムアップホールディングス	3,700	2,423.00	8,965,100	貸付有価証券 2,500株（1,200株）
3662	エイチーム	8,700	880.00	7,656,000	貸付有価証券 3,900株（900株）
3665	エニグモ	12,000	1,230.00	14,760,000	貸付有価証券 3,000株
3666	テクノスジャパン	9,800	719.00	7,046,200	貸付有価証券 3,400株
3667	e n i s h	6,100	611.00	3,727,100	貸付有価証券 3,900株（2,000株）
3668	コロブラ	41,700	1,005.00	41,908,500	貸付有価証券 14,200株
3672	オルトプラス	7,700	453.00	3,488,100	貸付有価証券 5,600株（3,200株）
3673	ブロードリーフ	63,000	544.00	34,272,000	貸付有価証券 6,800株（6,800株）
3675	クロス・マーケティンググループ	5,600	375.00	2,100,000	貸付有価証券 2,500株（600株）
3676	デジタルハーツホールディングス	6,700	888.00	5,949,600	貸付有価証券 3,000株（700株）
3677	システム情報	9,500	1,551.00	14,734,500	貸付有価証券 2,200株
3678	メディアドゥ	4,000	4,625.00	18,500,000	貸付有価証券 1,400株
3679	じげん	31,400	358.00	11,241,200	貸付有価証券 10,500株
3681	バイキューブ	7,800	1,360.00	10,608,000	貸付有価証券 3,500株（800株）
3682	エンカレッジ・テクノロジー	2,800	848.00	2,374,400	貸付有価証券 700株
3683	サイバーリンクス	2,000	2,309.00	4,618,000	貸付有価証券 700株
3686	ディー・エル・イー	10,200	625.00	6,375,000	貸付有価証券 4,000株（1,000株）
3687	フィックスターズ	13,500	1,362.00	18,387,000	貸付有価証券 6,100株（1,500株）
3688	C A R T A H O L D I N G S	6,100	1,318.00	8,039,800	貸付有価証券 700株（700株）
3694	オプティム	6,600	3,410.00	22,506,000	貸付有価証券 2,200株
3696	セレス	4,200	1,142.00	4,796,400	貸付有価証券 1,900株（500株）
3697	S H I F T	5,100	11,150.00	56,865,000	
3738	ティーガイア	11,300	2,051.00	23,176,300	貸付有価証券 3,800株

3741	セック	1,900	3,155.00	5,994,500	貸付有価証券 600株
3751	日本アジアグループ	13,400	305.00	4,087,000	貸付有価証券 6,000株（1,400株）
3762	テクマトリックス	8,900	3,795.00	33,775,500	貸付有価証券 3,100株
3763	プロシップ	3,700	1,373.00	5,080,100	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	30,600	1,971.00	60,312,600	貸付有価証券 11,000株（11,000株）
3769	GMOペイメントゲートウェイ	26,900	11,780.00	316,882,000	貸付有価証券 7,100株
3770	ザッパラス	5,500	394.00	2,167,000	貸付有価証券 3,900株（1,700株）
3771	システムリサーチ	3,400	2,105.00	7,157,000	貸付有価証券 1,100株
3774	インターネットイニシアティブ	18,800	3,700.00	69,560,000	貸付有価証券 6,500株
3778	さくらインターネット	13,600	697.00	9,479,200	貸付有価証券 6,200株（1,500株）
3784	ヴィンクス	3,600	1,384.00	4,982,400	
3788	GMOクラウド	2,400	10,660.00	25,584,000	貸付有価証券 1,600株（800株）
3817	SRAホールディングス	6,700	2,391.00	16,019,700	貸付有価証券 2,300株
3826	システムインテグレータ	4,000	1,001.00	4,004,000	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	9,000	1,354.00	12,186,000	貸付有価証券 3,100株
3835	eBASE	15,200	1,392.00	21,158,400	貸付有価証券 5,200株
3836	アバント	12,100	1,052.00	12,729,200	
3837	アドソル日進	4,500	2,460.00	11,070,000	貸付有価証券 1,500株
3843	フリービット	6,600	748.00	4,936,800	貸付有価証券 2,600株
3844	コムチュア	14,300	2,873.00	41,083,900	
3852	サイバーコム	2,300	1,837.00	4,225,100	貸付有価証券 800株
3853	アステリア	7,700	528.00	4,065,600	貸付有価証券 3,400株（800株）
3854	アイル	7,000	1,636.00	11,452,000	貸付有価証券 2,000株（400株）
3901	マークライنز	6,400	2,314.00	14,809,600	貸付有価証券 700株（700株）
3902	メディカル・データ・ビジョン	9,700	1,302.00	12,629,400	貸付有価証券 3,300株
3903	gumi	16,300	998.00	16,267,400	貸付有価証券 5,500株
3909	ショーケース	3,000	742.00	2,226,000	貸付有価証券 1,300株（300株）

3912	モバイルファクトリー	2,800	1,147.00	3,211,600	貸付有価証券 1,300株（300株）
3915	テラスカイ	4,600	3,035.00	13,961,000	貸付有価証券 2,000株（500株）
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,000	1,455.00	7,275,000	
3918	P C I ホールディングス	4,800	1,218.00	5,846,400	貸付有価証券 1,800株
3919	パイブドHD	1,600	1,678.00	2,684,800	貸付有価証券 600株
3920	アイピーシー	2,100	1,018.00	2,137,800	貸付有価証券 1,100株（300株）
3921	ネオジャパン	2,400	2,400.00	5,760,000	貸付有価証券 800株
3922	P R T I M E S	1,100	2,950.00	3,245,000	貸付有価証券 400株
3924	ランドコンピュータ	1,900	1,102.00	2,093,800	貸付有価証券 600株
3925	ダブルスタンダード	1,600	5,030.00	8,048,000	貸付有価証券 600株
3926	オーブンドア	6,300	1,446.00	9,109,800	貸付有価証券 2,900株（700株）
3928	マイネット	4,100	1,143.00	4,686,300	貸付有価証券 1,400株
3932	アカツキ	4,500	4,055.00	18,247,500	貸付有価証券 2,000株（500株）
3934	ベネフィットジャパン	900	1,492.00	1,342,800	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	2,800	2,278.00	6,378,400	貸付有価証券 1,000株
3938	L I N E	29,100	5,390.00	156,849,000	貸付有価証券 9,900株
3939	カナミックネットワーク	11,600	1,126.00	13,061,600	貸付有価証券 2,600株
3940	ノムラシステムコーポレーション	2,800	692.00	1,937,600	貸付有価証券 1,300株（300株）
3962	チェンジ	4,400	7,760.00	34,144,000	貸付有価証券 900株
3963	シンクロ・フード	5,400	363.00	1,960,200	貸付有価証券 2,400株（600株）
3964	オークネット	7,800	1,067.00	8,322,600	貸付有価証券 2,800株（900株）
3968	セグエグループ	2,800	866.00	2,424,800	貸付有価証券 800株（200株）
3969	エイトレッド	2,100	2,095.00	4,399,500	貸付有価証券 500株
3975	A O I T Y O H o l d i n g s	12,800	473.00	6,054,400	貸付有価証券 100株（100株）
3978	マクロミル	25,900	769.00	19,917,100	
3981	ビーグリー	2,500	1,929.00	4,822,500	貸付有価証券 800株

3983	オロ	3,300	2,825.00	9,322,500	貸付有価証券 1,500株（400株）
3984	ユーザーローカル	1,300	3,560.00	4,628,000	
3985	テモナ	2,700	1,010.00	2,727,000	貸付有価証券 600株
3992	ニーズウェル	2,400	748.00	1,795,200	貸付有価証券 500株
3996	サインポスト	2,600	1,859.00	4,833,400	貸付有価証券 900株（200株）
4284	ソルクシーズ	5,400	761.00	4,109,400	貸付有価証券 2,500株（600株）
4295	フェイス	4,400	683.00	3,005,200	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	11,400	1,066.00	12,152,400	貸付有価証券 3,900株
4299	ハイマックス	1,500	2,000.00	3,000,000	貸付有価証券 500株
4307	野村総合研究所	180,100	2,930.00	527,693,000	貸付有価証券 86,300株（13,200株）
4312	サイバネットシステム	9,000	704.00	6,336,000	
4320	C E ホールディングス	6,700	593.00	3,973,100	貸付有価証券 2,500株
4323	日本システム技術	2,000	1,862.00	3,724,000	貸付有価証券 800株（200株）
4326	インテージホールディングス	15,800	886.00	13,998,800	
4333	東邦システムサイエンス	3,300	972.00	3,207,600	貸付有価証券 1,200株
4344	ソースネクスト	60,300	280.00	16,884,000	貸付有価証券 26,800株（6,400株）
4348	インフォコム	13,900	3,035.00	42,186,500	貸付有価証券 4,800株
4382	H E R O Z	1,800	3,795.00	6,831,000	
4384	ラクスル	10,200	3,075.00	31,365,000	貸付有価証券 3,000株（700株）
4392	F I G	13,700	284.00	3,890,800	貸付有価証券 6,200株（1,500株）
4396	システムサポート	2,800	2,276.00	6,372,800	
4420	イーソル	6,000	1,291.00	7,746,000	
4423	アルテリア・ネットワークス	14,100	1,990.00	28,059,000	貸付有価証券 4,800株
4430	東海ソフト	900	1,520.00	1,368,000	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	2,200	1,014.00	2,230,800	貸付有価証券 800株
4441	トビラシステムズ	1,500	1,897.00	2,845,500	
4662	フォーカスシステムズ	7,900	897.00	7,086,300	貸付有価証券 2,700株
4674	クレスコ	7,700	1,538.00	11,842,600	貸付有価証券 2,600株
4676	フジ・メディア・ホールディングス	122,400	1,040.00	127,296,000	貸付有価証券 42,000株

4684	オービック	44,000	19,310.00	849,640,000	貸付有価証券 15,000株
4686	ジャストシステム	20,700	7,690.00	159,183,000	貸付有価証券 7,000株
4687	T D C ソフト	11,100	919.00	10,200,900	貸付有価証券 3,800株
4689	Zホールディングス	1,745,000	540.00	942,300,000	貸付有価証券 581,600株
4704	トレンドマイクロ	56,500	5,940.00	335,610,000	
4709	I D ホールディングス	4,800	1,469.00	7,051,200	貸付有価証券 2,100株（500株）
4716	日本オラクル	25,800	12,260.00	316,308,000	貸付有価証券 8,800株
4719	アルファシステムズ	4,000	3,820.00	15,280,000	貸付有価証券 1,600株（200株）
4722	フューチャー	15,300	1,743.00	26,667,900	貸付有価証券 5,500株（5,500株）
4725	C A C H o l d i n g s	8,300	1,269.00	10,532,700	
4726	S B テクノロジー	4,600	3,440.00	15,824,000	貸付有価証券 1,600株
4728	トーセ	3,400	853.00	2,900,200	貸付有価証券 2,300株（1,200株）
4733	オービックビジネスコンサルタント	13,000	5,880.00	76,440,000	貸付有価証券 9,100株（4,700株）
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	57,900	4,110.00	237,969,000	貸付有価証券 26,100株（6,300株）
4743	アイティフォー	15,400	741.00	11,411,400	貸付有価証券 6,900株（1,700株）
4746	東計電算	1,900	4,440.00	8,436,000	
4762	エックスネット	2,000	970.00	1,940,000	貸付有価証券 700株
4768	大塚商会	68,800	5,600.00	385,280,000	貸付有価証券 7,400株（7,400株）
4776	サイボウズ	14,800	3,470.00	51,356,000	
4779	ソフトブレーン	7,500	458.00	3,435,000	貸付有価証券 2,600株
4812	電通国際情報サービス	7,900	4,990.00	39,421,000	
4813	A C C E S S	11,900	1,022.00	12,161,800	
4819	デジタルガレージ	22,900	3,580.00	81,982,000	貸付有価証券 10,400株（2,500株）
4820	E M システムズ	17,900	995.00	17,810,500	
4825	ウェザーニューズ	4,300	3,635.00	15,630,500	貸付有価証券 1,500株
4826	C I J	8,600	890.00	7,654,000	
4828	ビジネスエンジニアリング	1,400	2,651.00	3,711,400	貸付有価証券 500株
4829	日本エンタープライズ	12,900	258.00	3,328,200	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	6,100	2,408.00	14,688,800	貸付有価証券 2,100株

4845	スカラ	8,400	738.00	6,199,200	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
4847	インテリジェント ウェイブ	7,400	836.00	6,186,400	貸付有価証券 2,100株（500株）
6879	I M A G I C A G R O U P	10,800	385.00	4,158,000	貸付有価証券 4,800株（1,200株）
7518	ネットワンシステムズ	48,400	3,685.00	178,354,000	貸付有価証券 22,400株（5,900株）
7527	システムソフト	27,400	101.00	2,767,400	貸付有価証券 21,100株（10,800株）
7595	アルゴグラフィックス	10,800	3,560.00	38,448,000	貸付有価証券 3,700株
7844	マーベラス	19,400	740.00	14,356,000	貸付有価証券 7,200株（500株）
7860	エイベックス	21,800	854.00	18,617,200	貸付有価証券 7,400株
8056	日本ユニシス	39,700	3,395.00	134,781,500	貸付有価証券 13,600株
8096	兼松エレクトロニクス	6,900	3,795.00	26,185,500	貸付有価証券 2,400株
8157	都築電気	3,100	1,717.00	5,322,700	
9401	東京放送ホールディングス	77,300	1,739.00	134,424,700	貸付有価証券 54,400株（27,900株）
9404	日本テレビホールディングス	106,100	1,181.00	125,304,100	貸付有価証券 36,500株（100株）
9405	朝日放送グループホールディングス	12,600	773.00	9,739,800	貸付有価証券 4,300株
9409	テレビ朝日ホールディングス	34,900	1,569.00	54,758,100	貸付有価証券 15,700株（3,800株）
9412	スカパーＪＳＡＴホールディングス	83,600	446.00	37,285,600	貸付有価証券 28,600株
9413	テレビ東京ホールディングス	10,400	2,384.00	24,793,600	貸付有価証券 6,500株（3,000株）
9414	日本ＢＳ放送	4,300	1,066.00	4,583,800	貸付有価証券 1,500株
9416	ビジョン	11,800	746.00	8,802,800	貸付有価証券 4,000株
9417	スマートバリュー	3,300	1,236.00	4,078,800	貸付有価証券 1,700株（400株）
9418	USEN - N E X T H O L D I N G S	4,800	1,286.00	6,172,800	貸付有価証券 1,600株
9419	ワイヤレスゲート	6,000	719.00	4,314,000	貸付有価証券 2,600株（600株）
9422	コネクシオ	7,200	1,415.00	10,188,000	貸付有価証券 2,500株
9424	日本通信	99,100	174.00	17,243,400	貸付有価証券 44,500株（10,700株）
9428	クロップス	2,300	725.00	1,667,500	貸付有価証券 1,100株（300株）
9432	日本電信電話	1,698,600	2,491.00	4,231,212,600	貸付有価証券 581,400株

9433	K D D I	947,000	3,170.00	3,001,990,000	貸付有価証券 325,300株
9434	ソフトバンク	1,154,800	1,382.50	1,596,511,000	貸付有価証券 523,600株（125,700株）
9435	光通信	13,100	24,440.00	320,164,000	
9437	N T T ドコモ	908,700	2,899.50	2,634,775,650	貸付有価証券 318,700株
9438	エムティーアイ	12,300	663.00	8,154,900	貸付有価証券 4,200株
9449	G M O インターネット	50,100	3,100.00	155,310,000	
9450	ファイバーゲート	4,100	1,519.00	6,227,900	
9466	アйдママーケティングコミュニケーション	3,800	475.00	1,805,000	貸付有価証券 1,300株
9468	K A D O K A W A	34,200	2,049.00	70,075,800	貸付有価証券 15,400株（3,700株）
9470	学研ホールディングス	17,000	1,459.00	24,803,000	貸付有価証券 6,000株
9474	ゼンリン	25,300	1,228.00	31,068,400	貸付有価証券 8,600株
9475	昭文社ホールディングス	5,800	406.00	2,354,800	貸付有価証券 2,000株
9479	インプレスホールディングス	10,500	153.00	1,606,500	貸付有価証券 4,700株（1,100株）
9600	アイネット	6,500	1,508.00	9,802,000	貸付有価証券 2,900株（700株）
9601	松竹	8,400	14,880.00	124,992,000	貸付有価証券 5,900株（3,000株）
9602	東宝	75,000	3,840.00	288,000,000	貸付有価証券 52,800株（26,700株）
9605	東映	4,800	14,500.00	69,600,000	貸付有価証券 3,300株（1,700株）
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	338,300	1,210.00	409,343,000	貸付有価証券 115,700株
9629	ピー・シー・エー	2,200	4,585.00	10,087,000	貸付有価証券 800株（200株）
9658	ビジネスブレイン太田昭和	2,200	2,532.00	5,570,400	貸付有価証券 1,000株（200株）
9682	D T S	28,400	2,295.00	65,178,000	貸付有価証券 9,700株
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,200	5,450.00	295,390,000	貸付有価証券 24,500株（5,900株）
9692	シーイーシー	13,600	1,782.00	24,235,200	貸付有価証券 4,700株
9697	カプコン	59,900	4,005.00	239,899,500	貸付有価証券 20,400株
9702	アイ・エス・ビー	2,500	2,263.00	5,657,500	貸付有価証券 800株
9717	ジャステック	8,100	1,187.00	9,614,700	貸付有価証券 2,700株
9719	S C S K	29,300	5,260.00	154,118,000	貸付有価証券 13,300株（3,200株）

9739	日本システムウェア	4,200	2,300.00	9,660,000	貸付有価証券 1,400株
9742	アイネス	12,500	1,388.00	17,350,000	貸付有価証券 4,300株
9746	T K C	10,700	5,640.00	60,348,000	貸付有価証券 4,800株（1,200株）
9749	富士ソフト	16,300	4,315.00	70,334,500	
9759	N S D	40,800	1,841.00	75,112,800	貸付有価証券 14,200株
9766	コナミホールディングス	46,200	3,540.00	163,548,000	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	5,000	2,792.00	13,960,000	貸付有価証券 1,700株
9889	J B C C ホールディングス	8,600	1,530.00	13,158,000	貸付有価証券 3,000株
9928	ミロク情報サービス	11,200	2,360.00	26,432,000	貸付有価証券 5,000株（1,200株）
9984	ソフトバンクグループ	1,008,300	5,370.00	5,414,571,000	貸付有価証券 344,700株
1352	ハウスイ	1,000	884.00	884,000	貸付有価証券 300株
2676	高千穂交易	4,900	949.00	4,650,100	貸付有価証券 2,200株（500株）
2689	カワニシホールディングス	1,500	1,450.00	2,175,000	
2692	伊藤忠食品	3,100	5,210.00	16,151,000	貸付有価証券 1,100株
2715	エレマテック	11,900	883.00	10,507,700	貸付有価証券 4,100株
2729	J A L U X	3,600	1,762.00	6,343,200	貸付有価証券 1,700株（400株）
2733	あらた	10,100	4,645.00	46,914,500	貸付有価証券 4,600株（1,100株）
2737	トーメンデバイス	1,900	3,680.00	6,992,000	貸付有価証券 600株
2760	東京エレクトロン デバイス	4,600	2,863.00	13,169,800	貸付有価証券 1,600株
2767	フィールズ	9,800	344.00	3,371,200	貸付有価証券 3,400株
2768	双日	704,400	236.00	166,238,400	貸付有価証券 240,800株
2784	アルフレッサ ホールディングス	141,700	2,194.00	310,889,800	貸付有価証券 48,500株
2874	横浜冷凍	33,400	889.00	29,692,600	貸付有価証券 12,200株
3004	神栄	1,800	510.00	918,000	貸付有価証券 1,200株（600株）
3023	ラサ商事	6,700	892.00	5,976,400	貸付有価証券 2,300株
3036	アルコニックス	13,500	1,134.00	15,309,000	貸付有価証券 6,100株（1,500株）
3038	神戸物産	44,000	6,180.00	271,920,000	貸付有価証券 15,000株

3054	ハイパー	1,900	592.00	1,124,800	
3076	あい ホールディングス	18,200	1,548.00	28,173,600	
3079	ディーブイエックス	4,500	780.00	3,510,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
3107	ダイワボウホールディングス	10,800	7,310.00	78,948,000	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	30,400	1,523.00	46,299,200	貸付有価証券 10,500株
3139	ラクト・ジャパン	4,800	3,690.00	17,712,000	貸付有価証券 1,600株
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,000	1,025.00	24,600,000	貸付有価証券 8,200株
3153	八洲電機	9,900	922.00	9,127,800	貸付有価証券 3,300株
3154	メディアスホールディングス	7,200	907.00	6,530,400	貸付有価証券 3,300株（800株）
3156	レスターホールディングス	13,300	2,068.00	27,504,400	貸付有価証券 9,300株（4,700株）
3157	ジューテックホールディングス	2,900	1,055.00	3,059,500	貸付有価証券 1,000株
3160	大光	5,400	670.00	3,618,000	貸付有価証券 1,800株
3166	ＯＣＨＩホールディングス	3,700	1,477.00	5,464,900	貸付有価証券 1,300株
3167	ＴＯＫＡＩホールディングス	67,400	993.00	66,928,200	貸付有価証券 23,000株
3168	黒谷	3,500	518.00	1,813,000	貸付有価証券 1,300株（300株）
3173	Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,200	722.00	1,588,400	貸付有価証券 1,200株（200株）
3176	三洋貿易	12,800	1,010.00	12,928,000	貸付有価証券 4,400株
3180	ビューティガレージ	2,100	1,675.00	3,517,500	貸付有価証券 700株
3183	ウイン・パートナーズ	9,200	961.00	8,841,200	貸付有価証券 3,200株
3321	ミタチ産業	3,800	603.00	2,291,400	貸付有価証券 2,400株（1,100株）
3360	シップヘルスケアホールディングス	20,400	4,335.00	88,434,000	貸付有価証券 9,300株（2,200株）
3388	明治電機工業	4,000	1,367.00	5,468,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
3392	デリカフーズホールディングス	4,500	620.00	2,790,000	貸付有価証券 1,500株
3393	スターティアホールディングス	2,900	624.00	1,809,600	貸付有価証券 1,000株
3543	コメダホールディングス	27,800	1,836.00	51,040,800	貸付有価証券 9,500株
3559	ピーバンドットコム	1,300	1,002.00	1,302,600	
3565	アセンテック	1,400	3,270.00	4,578,000	貸付有価証券 400株（100株）

5009	富士興産	3,900	448.00	1,747,200	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	1,400	1,133.00	1,586,200	貸付有価証券 600株（100株）
7414	小野建	11,400	1,224.00	13,953,600	貸付有価証券 5,100株（1,200株）
7417	南陽	2,800	1,451.00	4,062,800	貸付有価証券 1,000株
7420	佐鳥電機	8,700	829.00	7,212,300	貸付有価証券 4,200株（1,000株）
7427	エコートレーディング	2,900	528.00	1,531,200	貸付有価証券 1,000株
7433	伯東	7,800	998.00	7,784,400	貸付有価証券 5,400株（2,700株）
7438	コンドーテック	9,900	1,118.00	11,068,200	貸付有価証券 3,400株
7442	中山福	7,300	511.00	3,730,300	貸付有価証券 2,500株
7447	ナガイレーベン	16,900	2,600.00	43,940,000	貸付有価証券 11,200株（4,900株）
7451	三菱食品	14,000	2,687.00	37,618,000	貸付有価証券 4,800株
7456	松田産業	9,300	1,334.00	12,406,200	貸付有価証券 3,200株
7458	第一興商	19,000	3,250.00	61,750,000	貸付有価証券 6,500株
7459	メディパルホールディングス	137,600	2,039.00	280,566,400	貸付有価証券 47,000株
7466	S P K	5,500	1,407.00	7,738,500	貸付有価証券 1,800株
7467	萩原電気ホールディングス	4,700	2,050.00	9,635,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
7476	アズワン	8,300	11,740.00	97,442,000	貸付有価証券 3,800株（900株）
7480	スズデン	4,400	1,190.00	5,236,000	貸付有価証券 1,900株（400株）
7481	尾家産業	3,700	1,514.00	5,601,800	貸付有価証券 1,300株
7482	シモジマ	7,800	1,179.00	9,196,200	貸付有価証券 2,700株
7483	ドウシシャ	12,000	1,546.00	18,552,000	貸付有価証券 4,100株
7487	小津産業	2,800	1,782.00	4,989,600	貸付有価証券 1,000株
7504	高速	7,600	1,469.00	11,164,400	貸付有価証券 3,400株（800株）
7510	たけびし	4,500	1,499.00	6,745,500	貸付有価証券 1,700株（200株）
7525	リックス	2,900	1,542.00	4,471,800	貸付有価証券 1,300株（300株）
7537	丸文	11,300	474.00	5,356,200	貸付有価証券 3,900株

7552	ハピネット	10,600	1,149.00	12,179,400	貸付有価証券 3,600株
7570	橋本総業ホールディングス	2,600	2,051.00	5,332,600	貸付有価証券 1,200株（300株）
7575	日本ライフライン	37,800	1,401.00	52,957,800	貸付有価証券 17,000株（4,100株）
7590	タカショー	8,300	483.00	4,008,900	貸付有価証券 2,100株
7594	マルカ	4,500	1,920.00	8,640,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
7599	I D O M	34,400	492.00	16,924,800	貸付有価証券 11,900株
7607	進和	7,500	1,940.00	14,550,000	貸付有価証券 3,400株（800株）
7608	エスケイジャパン	2,700	310.00	837,000	貸付有価証券 1,000株
7609	ダイトロン	5,400	1,675.00	9,045,000	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
7613	シークス	16,200	1,009.00	16,345,800	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
7619	田中商事	3,900	697.00	2,718,300	貸付有価証券 1,300株
7628	オーハシテクニカ	7,200	1,570.00	11,304,000	貸付有価証券 2,500株
7637	白銅	4,600	1,379.00	6,343,400	貸付有価証券 1,600株
8001	伊藤忠商事	892,100	2,296.00	2,048,261,600	貸付有価証券 305,000株
8002	丸紅	1,327,600	489.60	649,992,960	貸付有価証券 452,700株
8007	高島	2,000	1,784.00	3,568,000	貸付有価証券 700株
8012	長瀬産業	71,700	1,317.00	94,428,900	貸付有価証券 32,200株（7,700株）
8014	蝶理	8,100	1,815.00	14,701,500	貸付有価証券 3,500株（700株）
8015	豊田通商	142,400	2,691.00	383,198,400	貸付有価証券 48,700株
8018	三共生興	19,300	435.00	8,395,500	貸付有価証券 6,600株
8020	兼松	47,600	1,252.00	59,595,200	貸付有価証券 18,600株（2,300株）
8025	ツカモトコーポレーション	2,300	1,125.00	2,587,500	貸付有価証券 800株
8031	三井物産	1,104,300	1,591.50	1,757,493,450	貸付有価証券 382,100株
8032	日本紙パルプ商事	7,200	3,875.00	27,900,000	貸付有価証券 3,300株（800株）
8037	カメイ	16,600	1,025.00	17,015,000	貸付有価証券 11,200株（5,500株）
8038	東都水産	1,600	3,280.00	5,248,000	貸付有価証券 600株

8041	ＯＵＧホールディングス	2,000	2,656.00	5,312,000	貸付有価証券 700株
8043	スターゼン	4,700	4,190.00	19,693,000	貸付有価証券 1,600株
8051	山善	49,800	900.00	44,820,000	貸付有価証券 17,000株
8052	椿本興業	2,400	3,785.00	9,084,000	貸付有価証券 1,600株（800株）
8053	住友商事	804,700	1,235.50	994,206,850	貸付有価証券 274,200株
8057	内田洋行	5,000	6,090.00	30,450,000	貸付有価証券 2,500株（600株）
8058	三菱商事	895,000	2,263.50	2,025,832,500	貸付有価証券 402,600株（96,600株）
8059	第一実業	6,200	3,650.00	22,630,000	貸付有価証券 2,100株
8060	キャノンマーケティングジャパン	31,600	2,225.00	70,310,000	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
8061	西華産業	7,200	1,224.00	8,812,800	貸付有価証券 3,300株（800株）
8065	佐藤商事	10,500	837.00	8,788,500	貸付有価証券 4,700株（1,100株）
8068	菱洋エレクトロ	12,900	2,779.00	35,849,100	貸付有価証券 9,000株（4,600株）
8070	東京産業	11,500	520.00	5,980,000	貸付有価証券 5,300株（1,300株）
8074	ユアサ商事	12,100	2,876.00	34,799,600	貸付有価証券 8,500株（4,300株）
8075	神鋼商事	3,200	2,001.00	6,403,200	貸付有価証券 1,100株
8077	トルク	7,600	316.00	2,401,600	貸付有価証券 3,400株（800株）
8078	阪和興業	23,800	1,935.00	46,053,000	貸付有価証券 8,100株
8079	正栄食品工業	8,300	4,185.00	34,735,500	貸付有価証券 3,800株（900株）
8081	カナデン	10,300	1,306.00	13,451,800	貸付有価証券 3,600株
8084	菱電商事	9,200	1,480.00	13,616,000	貸付有価証券 3,200株
8087	フルサト工業	7,000	1,380.00	9,660,000	貸付有価証券 2,400株
8088	岩谷産業	28,300	3,755.00	106,266,500	貸付有価証券 9,700株
8089	ナイス	5,400	808.00	4,363,200	貸付有価証券 1,800株
8090	昭光通商	4,100	618.00	2,533,800	貸付有価証券 2,800株（1,400株）
8091	ニチモウ	2,000	1,867.00	3,734,000	貸付有価証券 700株

8093	極東貿易	3,700	1,360.00	5,032,000	貸付有価証券 1,200株
8095	イワキ	16,700	500.00	8,350,000	貸付有価証券 5,700株
8097	三愛石油	31,400	984.00	30,897,600	貸付有価証券 14,200株（3,400株）
8098	稲畑産業	28,100	1,275.00	35,827,500	貸付有価証券 9,700株
8101	G S I クレオス	3,100	1,235.00	3,828,500	貸付有価証券 1,100株
8103	明和産業	11,800	465.00	5,487,000	貸付有価証券 5,300株（1,300株）
8104	クワザワ	4,500	529.00	2,380,500	貸付有価証券 1,600株
8108	ヤマエ久野	9,300	1,174.00	10,918,200	
8125	ワキタ	27,200	943.00	25,649,600	貸付有価証券 9,300株
8129	東邦ホールディングス	40,900	1,989.00	81,350,100	貸付有価証券 18,300株（4,400株）
8130	サンゲツ	34,800	1,495.00	52,026,000	貸付有価証券 12,000株
8131	ミツウロコグループホールディングス	18,800	1,160.00	21,808,000	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	5,200	2,746.00	14,279,200	貸付有価証券 2,400株（600株）
8133	伊藤忠エネクス	28,200	847.00	23,885,400	貸付有価証券 9,700株
8136	サンリオ	35,800	1,693.00	60,609,400	貸付有価証券 16,200株（3,900株）
8137	サンワテクノス	9,000	892.00	8,028,000	貸付有価証券 4,000株（1,000株）
8140	リョーサン	14,100	2,190.00	30,879,000	貸付有価証券 4,800株
8141	新光商事	20,000	834.00	16,680,000	貸付有価証券 6,900株
8142	トーヨー	5,800	1,898.00	11,008,400	貸付有価証券 1,900株
8150	三信電気	6,800	1,485.00	10,098,000	貸付有価証券 3,200株（800株）
8151	東陽テクニカ	13,600	1,007.00	13,695,200	貸付有価証券 5,000株
8153	モスフードサービス	16,700	3,010.00	50,267,000	貸付有価証券 5,700株
8154	加賀電子	12,700	1,978.00	25,120,600	貸付有価証券 4,400株
8158	ソーダニッカ	13,200	511.00	6,745,200	貸付有価証券 4,500株
8159	立花エレテック	9,400	1,739.00	16,346,600	貸付有価証券 4,200株（1,000株）
8275	フォーバル	5,600	980.00	5,488,000	貸付有価証券 2,500株（600株）

8283	P A L T A C	20,400	4,955.00	101,082,000	貸付有価証券 14,300株（7,300株）
8285	三谷産業	16,800	336.00	5,644,800	貸付有価証券 5,700株
8835	太平洋興発	5,000	604.00	3,020,000	貸付有価証券 1,700株
9260	西本W i s m e t t a c ホールディングス	2,300	2,071.00	4,763,300	
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,855.00	2,040,500	貸付有価証券 300株
9274	国際紙パルプ商事	30,200	276.00	8,335,200	貸付有価証券 10,300株
9305	ヤマタネ	6,400	1,177.00	7,532,800	貸付有価証券 2,200株
9763	丸紅建材リース	1,200	1,575.00	1,890,000	貸付有価証券 400株
9810	日鉄物産	9,100	3,425.00	31,167,500	貸付有価証券 6,300株（3,200株）
9824	泉州電業	3,900	2,884.00	11,247,600	貸付有価証券 1,300株
9830	トラスコ中山	26,500	2,773.00	73,484,500	貸付有価証券 9,700株（9,700株）
9832	オートバックスセブン	47,300	1,381.00	65,321,300	貸付有価証券 16,200株
9837	モリト	9,300	663.00	6,165,900	貸付有価証券 3,200株
9869	加藤産業	18,400	3,495.00	64,308,000	貸付有価証券 6,800株
9872	北恵	3,200	938.00	3,001,600	貸付有価証券 1,100株（300株）
9880	イノテック	6,600	971.00	6,408,600	貸付有価証券 2,600株
9882	イエローハット	24,100	1,487.00	35,836,700	貸付有価証券 10,800株（2,600株）
9896	J K ホールディングス	11,500	785.00	9,027,500	貸付有価証券 8,100株（4,100株）
9902	日伝	11,500	2,361.00	27,151,500	貸付有価証券 4,100株（100株）
9930	北沢産業	9,600	277.00	2,659,200	貸付有価証券 6,700株（3,400株）
9932	杉本商事	6,900	1,802.00	12,433,800	貸付有価証券 2,400株
9934	因幡電機産業	36,300	2,370.00	86,031,000	貸付有価証券 16,400株（4,000株）
9960	東テック	4,200	2,137.00	8,975,400	貸付有価証券 1,400株
9962	ミスミグループ本社	159,900	2,750.00	439,725,000	貸付有価証券 112,600株（58,000株）
9972	アルテック	10,100	228.00	2,302,800	貸付有価証券 3,500株

9982	タキヒヨー	3,900	1,840.00	7,176,000	貸付有価証券 1,300株
9986	蔵王産業	2,500	1,416.00	3,540,000	貸付有価証券 800株
9987	スズケン	54,000	3,915.00	211,410,000	貸付有価証券 18,500株
9991	ジェコス	8,800	914.00	8,043,200	貸付有価証券 3,000株
9995	グローセル	12,800	455.00	5,824,000	貸付有価証券 5,700株（1,400株）
2651	ローソン	32,300	5,530.00	178,619,000	貸付有価証券 11,000株
2659	サンエー	10,600	4,000.00	42,400,000	貸付有価証券 7,400株（3,800株）
2664	カワチ薬品	9,900	2,674.00	26,472,600	貸付有価証券 3,400株
2670	エービーシー・マート	19,900	6,410.00	127,559,000	貸付有価証券 6,800株
2674	ハードオフコーポレーション	5,000	702.00	3,510,000	貸付有価証券 1,700株
2678	アスクル	13,300	3,580.00	47,614,000	貸付有価証券 4,600株
2681	ゲオホールディングス	23,000	1,312.00	30,176,000	貸付有価証券 10,300株（2,500株）
2685	アダストリア	17,700	1,851.00	32,762,700	貸付有価証券 7,900株（1,900株）
2686	ジーフット	7,700	490.00	3,773,000	貸付有価証券 2,700株
2687	シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1,800	509.00	916,200	貸付有価証券 600株
2695	くら寿司	6,700	5,340.00	35,778,000	貸付有価証券 2,300株
2698	キャンドウ	6,100	2,131.00	12,999,100	貸付有価証券 2,100株
2726	パルグループホールディングス	13,000	1,336.00	17,368,000	貸付有価証券 4,400株
2730	エディオン	58,500	1,113.00	65,110,500	貸付有価証券 41,200株（21,200株）
2734	サーラコーポレーション	25,900	555.00	14,374,500	貸付有価証券 8,900株
2735	ワッツ	5,600	926.00	5,185,600	貸付有価証券 1,900株
2742	ハローズ	4,800	3,580.00	17,184,000	貸付有価証券 1,600株
2752	フジオフードシステム	10,700	1,582.00	16,927,400	貸付有価証券 5,000株（1,200株）
2753	あみやき亭	2,800	3,160.00	8,848,000	貸付有価証券 1,000株
2764	ひらまつ	23,400	183.00	4,282,200	貸付有価証券 8,100株
2791	大黒天物産	3,100	4,595.00	14,244,500	貸付有価証券 1,100株

2792	ハニーズホールディングス	11,200	1,095.00	12,264,000	貸付有価証券 3,800株
2796	ファーマライズホールディングス	3,100	675.00	2,092,500	貸付有価証券 1,300株（300株）
3028	アルペン	9,800	1,768.00	17,326,400	貸付有価証券 4,400株（1,100株）
3030	ハブ	3,600	715.00	2,574,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
3034	クオールホールディングス	18,800	1,134.00	21,319,200	貸付有価証券 8,400株（2,000株）
3046	ジンズホールディングス	6,700	6,750.00	45,225,000	貸付有価証券 3,000株（700株）
3048	ビックカメラ	75,600	1,168.00	88,300,800	貸付有価証券 34,100株（8,200株）
3050	D C Mホールディングス	70,700	1,158.00	81,870,600	貸付有価証券 23,600株
3053	ペッパーフードサービス	11,100	663.00	7,359,300	貸付有価証券 7,400株（3,900株）
3064	M o n o t a R O	90,700	4,370.00	396,359,000	
3067	東京一番フーズ	3,200	506.00	1,619,200	貸付有価証券 1,100株
3073	D Dホールディングス	5,000	1,005.00	5,025,000	貸付有価証券 1,700株
3082	きちりホールディングス	3,400	629.00	2,138,600	
3085	アークランドサービスホールディングス	9,300	1,984.00	18,451,200	貸付有価証券 3,200株
3086	J . フロント リテイリング	152,300	810.00	123,363,000	貸付有価証券 52,300株
3087	ドトール・日レスホールディングス	18,300	1,726.00	31,585,800	貸付有価証券 7,000株
3088	マツモトキヨシホールディングス	52,700	3,920.00	206,584,000	貸付有価証券 23,700株（5,700株）
3091	ブロンコビリー	6,700	2,585.00	17,319,500	貸付有価証券 700株（700株）
3092	Z O Z O	87,700	2,411.00	211,444,700	貸付有価証券 56,700株（13,600株）
3093	トレジャー・ファクトリー	3,700	796.00	2,945,200	貸付有価証券 1,300株
3097	物語コーポレーション	3,400	8,490.00	28,866,000	貸付有価証券 1,400株（300株）
3098	ココカラファイン	13,300	5,790.00	77,007,000	貸付有価証券 4,600株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	223,000	658.00	146,734,000	貸付有価証券 100,500株（24,100株）
3134	H a m e e	4,500	1,697.00	7,636,500	貸付有価証券 1,300株
3141	ウエルシアホールディングス	37,900	8,840.00	335,036,000	貸付有価証券 17,000株（4,100株）
3148	クリエイトS Dホールディングス	21,500	3,275.00	70,412,500	貸付有価証券 6,400株

3159	丸善ＣＨＩホールディングス	14,900	394.00	5,870,600	貸付有価証券 5,100株
3169	ミサワ	2,600	537.00	1,396,200	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	1,900	1,015.00	1,928,500	貸付有価証券 600株
3175	エー・ピーカンパニー	2,400	504.00	1,209,600	貸付有価証券 800株
3178	チムニー	3,900	1,480.00	5,772,000	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	8,700	716.00	6,229,200	貸付有価証券 6,100株（3,200株）
3182	オイシックス・ラ・大地	12,600	2,174.00	27,392,400	
3186	ネクステージ	18,300	852.00	15,591,600	貸付有価証券 8,200株（2,000株）
3191	ジョイフル本田	37,400	1,391.00	52,023,400	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
3193	鳥貴族	3,700	1,587.00	5,871,900	貸付有価証券 1,400株
3194	麒麟堂ホールディングス	5,000	2,445.00	12,225,000	貸付有価証券 1,700株
3196	ホットランド	8,500	1,231.00	10,463,500	貸付有価証券 2,900株
3197	すかいらーくホールディングス	142,900	1,796.00	256,648,400	貸付有価証券 64,300株（15,400株）
3198	S F Pホールディングス	7,300	1,601.00	11,687,300	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	4,800	1,881.00	9,028,800	貸付有価証券 2,500株（900株）
3221	ヨシックス	2,100	2,025.00	4,252,500	貸付有価証券 700株
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	37,100	1,111.00	41,218,100	貸付有価証券 26,000株（13,300株）
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	5,900	569.00	3,357,100	貸付有価証券 2,000株
3328	B E E N O S	5,900	1,032.00	6,088,800	貸付有価証券 1,500株
3333	あさひ	9,500	1,469.00	13,955,500	貸付有価証券 3,200株
3341	日本調剤	7,700	1,589.00	12,235,300	貸付有価証券 2,600株
3349	コスモス薬品	11,300	16,710.00	188,823,000	貸付有価証券 3,800株
3361	トーエル	6,200	701.00	4,346,200	貸付有価証券 2,100株
3376	オンリー	2,200	602.00	1,324,400	貸付有価証券 800株
3382	セブン＆アイ・ホールディングス	499,000	3,482.00	1,737,518,000	貸付有価証券 295,700株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	68,600	749.00	51,381,400	貸付有価証券 30,800株（7,400株）

3391	ツルハホールディングス	27,700	14,880.00	412,176,000	貸付有価証券 9,500株
3395	サンマルクホールディングス	10,100	1,673.00	16,897,300	貸付有価証券 3,400株
3396	フェリシモ	2,800	1,083.00	3,032,400	貸付有価証券 1,000株
3397	トリドールホールディングス	31,500	1,258.00	39,627,000	貸付有価証券 12,000株
3415	T O K Y O B A S E	11,500	377.00	4,335,500	貸付有価証券 3,900株
3538	ウイルプラスホールディングス	1,600	710.00	1,136,000	
3539	J Mホールディングス	9,700	2,884.00	27,974,800	貸付有価証券 2,200株
3544	サツドラホールディングス	1,900	1,972.00	3,746,800	貸付有価証券 600株
3546	アレンザホールディングス	6,400	959.00	6,137,600	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	2,600	1,705.00	4,433,000	貸付有価証券 700株
3548	バロックジャパンリミテッド	8,800	681.00	5,992,800	貸付有価証券 3,000株
3549	クスリのアオキホールディングス	11,400	8,920.00	101,688,000	貸付有価証券 4,400株
3561	力の源ホールディングス	5,800	700.00	4,060,000	貸付有価証券 1,900株
3563	スシログローバルホールディングス	70,000	2,431.00	170,170,000	貸付有価証券 19,200株
3564	L I X I L ピバ	12,600	2,596.00	32,709,600	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	12,300	503.00	6,186,900	貸付有価証券 4,300株
7416	はるやまホールディングス	6,000	745.00	4,470,000	貸付有価証券 2,100株
7419	ノジマ	22,700	2,596.00	58,929,200	貸付有価証券 7,700株
7421	カップ・クリエイト	17,900	1,491.00	26,688,900	貸付有価証券 6,100株
7445	ライトオン	9,500	582.00	5,529,000	貸付有価証券 3,300株
7448	ジーンズメイト	3,900	226.00	881,400	貸付有価証券 2,700株（1,400株）
7453	良品計画	169,300	1,550.00	262,415,000	貸付有価証券 100,400株
7455	三城ホールディングス	13,500	295.00	3,982,500	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァン	19,500	1,314.00	25,623,000	貸付有価証券 8,800株（2,100株）
7475	アルビス	4,800	2,120.00	10,176,000	貸付有価証券 1,600株
7494	コナカ	15,000	301.00	4,515,000	貸付有価証券 5,100株

7506	ハウス オブ ローゼ	1,600	1,606.00	2,569,600	貸付有価証券 500株
7508	G - 7ホールディングス	7,500	2,415.00	18,112,500	貸付有価証券 2,600株
7512	イオン北海道	16,800	798.00	13,406,400	貸付有価証券 4,400株
7513	コジマ	21,900	574.00	12,570,600	貸付有価証券 7,500株
7514	ヒマラヤ	4,500	819.00	3,685,500	貸付有価証券 1,500株
7516	コーナン商事	18,100	3,265.00	59,096,500	貸付有価証券 6,200株
7520	エコス	4,700	1,866.00	8,770,200	貸付有価証券 1,600株
7522	ワタミ	15,100	1,002.00	15,130,200	貸付有価証券 5,200株
7524	マルシェ	3,400	604.00	2,053,600	貸付有価証券 1,100株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	280,300	2,390.00	669,917,000	
7545	西松屋チェーン	28,000	1,147.00	32,116,000	貸付有価証券 9,600株
7550	ゼンショーホールディングス	61,100	2,227.00	136,069,700	貸付有価証券 43,000株（22,100株）
7554	幸楽苑ホールディングス	8,100	1,595.00	12,919,500	貸付有価証券 5,600株（2,900株）
7561	ハークスレイ	2,700	1,107.00	2,988,900	貸付有価証券 900株
7581	サイゼリヤ	18,900	2,134.00	40,332,600	貸付有価証券 9,500株（2,300株）
7593	V Tホールディングス	52,800	347.00	18,321,600	貸付有価証券 23,800株（5,700株）
7596	魚力	3,500	1,610.00	5,635,000	貸付有価証券 1,200株
7601	ポブラ	3,300	432.00	1,425,600	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	3,400	1,993.00	6,776,200	貸付有価証券 1,200株
7606	ユナイテッドアローズ	13,400	1,865.00	24,991,000	貸付有価証券 4,600株
7611	ハイデイ日高	18,400	1,788.00	32,899,200	貸付有価証券 13,000株（6,700株）
7615	京都きもの友禅	8,100	281.00	2,276,100	貸付有価証券 2,700株
7616	コロワイド	42,400	1,527.00	64,744,800	貸付有価証券 29,800株（15,300株）
7618	ピーシーデポコーポレーション	16,900	762.00	12,877,800	貸付有価証券 7,600株（1,800株）
7630	壱番屋	9,000	5,010.00	45,090,000	貸付有価証券 3,100株
7640	トップカルチャー	4,600	350.00	1,610,000	貸付有価証券 1,600株

7646	P L A N T	3,300	570.00	1,881,000	貸付有価証券 1,100株
7649	スギホールディングス	25,500	7,330.00	186,915,000	貸付有価証券 11,300株（2,600株）
7679	薬王堂ホールディングス	5,600	2,565.00	14,364,000	貸付有価証券 1,900株
7918	ヴィア・ホールディングス	15,600	467.00	7,285,200	貸付有価証券 5,300株
8005	スクロール	19,600	452.00	8,859,200	貸付有価証券 6,700株
8008	ヨンドシーホールディングス	13,000	1,772.00	23,036,000	貸付有価証券 9,000株（4,600株）
8028	ファミリーマート	101,900	1,841.00	187,597,900	貸付有価証券 46,700株（11,200株）
8160	木曽路	16,700	2,507.00	41,866,900	貸付有価証券 5,700株
8163	S R S ホールディングス	15,000	919.00	13,785,000	貸付有価証券 5,100株
8165	千趣会	23,000	390.00	8,970,000	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
8166	タカキュー	9,800	139.00	1,362,200	貸付有価証券 3,300株
8167	リテールパートナーズ	16,900	1,659.00	28,037,100	
8168	ケーヨー	26,200	673.00	17,632,600	貸付有価証券 8,900株
8173	上新電機	15,000	2,122.00	31,830,000	貸付有価証券 6,700株（1,600株）
8174	日本瓦斯	20,200	4,460.00	90,092,000	貸付有価証券 6,900株
8179	ロイヤルホールディングス	22,300	1,980.00	44,154,000	貸付有価証券 15,700株（8,100株）
8181	東天紅	900	970.00	873,000	貸付有価証券 300株
8182	いなげや	15,800	1,721.00	27,191,800	貸付有価証券 5,400株
8184	島忠	24,000	2,920.00	70,080,000	貸付有価証券 9,200株
8185	チヨダ	13,400	1,182.00	15,838,800	貸付有価証券 4,600株
8194	ライフコーポレーション	9,700	3,330.00	32,301,000	貸付有価証券 3,300株
8200	リンガーハット	15,700	2,440.00	38,308,000	貸付有価証券 7,100株（1,700株）
8203	M r M a x H D	17,500	548.00	9,590,000	貸付有価証券 7,900株（1,900株）
8207	テンアライド	11,800	384.00	4,531,200	貸付有価証券 6,900株
8214	A O K I ホールディングス	25,500	639.00	16,294,500	貸付有価証券 11,500株（2,800株）
8217	オークワ	20,000	1,655.00	33,100,000	貸付有価証券 6,800株

8218	コメリ	19,700	2,721.00	53,603,700	貸付有価証券 6,700株
8219	青山商事	26,300	763.00	20,066,900	貸付有価証券 9,000株
8227	しまむら	14,800	7,680.00	113,664,000	貸付有価証券 6,300株（1,200株）
8230	はせがわ	6,700	331.00	2,217,700	貸付有価証券 2,300株
8233	高島屋	92,900	935.00	86,861,500	貸付有価証券 42,000株（10,100株）
8237	松屋	25,700	702.00	18,041,400	貸付有価証券 18,100株（9,300株）
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	60,400	762.00	46,024,800	貸付有価証券 20,700株
8244	近鉄百貨店	4,900	3,060.00	14,994,000	貸付有価証券 2,200株（500株）
8252	丸井グループ	116,900	2,020.00	236,138,000	貸付有価証券 82,300株（42,400株）
8255	アクシアル リテイリング	10,600	4,155.00	44,043,000	貸付有価証券 3,600株
8260	井筒屋	6,900	190.00	1,311,000	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	490,800	2,458.50	1,206,631,800	貸付有価証券 343,900株（53,000株）
8273	イズミ	25,900	3,445.00	89,225,500	貸付有価証券 11,700株（2,800株）
8276	平和堂	25,900	1,845.00	47,785,500	貸付有価証券 11,700株（2,800株）
8278	フジ	15,400	1,867.00	28,751,800	貸付有価証券 6,900株（1,700株）
8279	ヤオコー	14,500	7,800.00	113,100,000	貸付有価証券 6,500株（1,600株）
8281	ゼビオホールディングス	15,400	850.00	13,090,000	貸付有価証券 5,200株
8282	ケーズホールディングス	123,100	1,490.00	183,419,000	貸付有価証券 42,200株
8289	O l y m p i c グループ	6,600	853.00	5,629,800	貸付有価証券 4,500株（2,300株）
8291	日産東京販売ホールディングス	18,800	248.00	4,662,400	貸付有価証券 6,400株
9262	シルバーライフ	1,700	2,223.00	3,779,100	
9266	一家ダイニングプロジェクト	1,300	609.00	791,700	
9267	G e n k y D r u g S t o r e s	5,600	3,570.00	19,992,000	貸付有価証券 2,100株
9275	ナルミヤ・インターナショナル	2,800	677.00	1,895,600	貸付有価証券 700株
9278	ブックオフグループホールディングス	7,400	841.00	6,223,400	貸付有価証券 5,200株（2,700株）
9627	アインホールディングス	15,700	7,150.00	112,255,000	貸付有価証券 7,700株（1,800株）

9828	元気寿司	3,200	2,405.00	7,696,000	貸付有価証券 1,100株
9831	ヤマダ電機	388,600	530.00	205,958,000	貸付有価証券 273,800株（141,000株）
9842	アークランドサカモト	20,000	1,839.00	36,780,000	貸付有価証券 6,800株
9843	ニトリホールディングス	55,200	20,715.00	1,143,468,000	貸付有価証券 32,700株
9850	グルメ杵屋	9,100	1,026.00	9,336,600	貸付有価証券 3,100株
9854	愛眼	10,200	223.00	2,274,600	貸付有価証券 4,600株（1,100株）
9856	ケーユーホールディングス	6,700	830.00	5,561,000	貸付有価証券 2,300株
9861	吉野家ホールディングス	41,900	2,313.00	96,914,700	貸付有価証券 18,900株（4,500株）
9887	松屋フーズホールディングス	6,100	3,715.00	22,661,500	貸付有価証券 2,100株
9900	サガミホールディングス	17,000	1,265.00	21,505,000	貸付有価証券 5,800株
9919	関西スーパーマーケット	10,600	1,092.00	11,575,200	貸付有価証券 3,600株
9936	王将フードサービス	9,400	6,080.00	57,152,000	貸付有価証券 3,200株
9945	プレナス	14,300	1,810.00	25,883,000	貸付有価証券 4,900株
9946	ミニストップ	9,400	1,490.00	14,006,000	貸付有価証券 3,300株
9948	アークス	26,100	2,115.00	55,201,500	貸付有価証券 8,900株
9956	バローホールディングス	28,200	2,078.00	58,599,600	貸付有価証券 9,700株
9966	藤久	1,400	1,085.00	1,519,000	貸付有価証券 300株
9974	ベルク	6,300	7,100.00	44,730,000	貸付有価証券 2,200株
9979	大庄	6,800	1,307.00	8,887,600	貸付有価証券 2,300株
9983	ファーストリテイリング	17,100	62,090.00	1,061,739,000	貸付有価証券 5,800株
9989	サンドラッグ	48,000	3,510.00	168,480,000	貸付有価証券 16,400株
9990	サックスパー ホールディングス	10,800	622.00	6,717,600	貸付有価証券 3,700株
9993	ヤマザワ	3,000	1,743.00	5,229,000	貸付有価証券 1,000株
9994	やまや	2,600	2,242.00	5,829,200	貸付有価証券 900株
9997	ベルーナ	27,400	611.00	16,741,400	貸付有価証券 19,200株（9,800株）

7150	島根銀行	3,400	525.00	1,785,000	貸付有価証券 900株
7161	じもとホールディングス	86,300	95.00	8,198,500	貸付有価証券 29,500株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	663,700	246.00	163,270,200	貸付有価証券 226,900株
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,300	1,132.00	19,583,600	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	279,500	448.00	125,216,000	貸付有価証券 94,300株（22,600株）
7182	ゆうちょ銀行	361,800	840.00	303,912,000	貸付有価証券 255,000株（131,300株）
7184	富山第一銀行	30,400	263.00	7,995,200	貸付有価証券 10,400株
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	729,500	349.00	254,595,500	貸付有価証券 257,600株
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	85,000	738.00	62,730,000	貸付有価証券 39,000株（9,400株）
7321	関西みらいフィナンシャルグループ	75,000	420.00	31,500,000	貸付有価証券 50,500株（25,100株）
7322	三十三フィナンシャルグループ	11,800	1,327.00	15,658,600	貸付有価証券 4,000株
7327	第四北越フィナンシャルグループ	22,200	2,188.00	48,573,600	貸付有価証券 10,000株（2,400株）
8303	新生銀行	93,700	1,310.00	122,747,000	貸付有価証券 32,000株
8304	あおぞら銀行	76,100	1,919.00	146,035,900	貸付有価証券 8,200株（8,200株）
8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,737,100	426.70	3,728,120,570	貸付有価証券 3,005,600株
8308	りそなホールディングス	1,401,600	368.10	515,928,960	貸付有価証券 479,100株
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	241,400	2,964.00	715,509,600	貸付有価証券 82,700株
8316	三井住友フィナンシャルグループ	883,300	3,022.00	2,669,332,600	貸付有価証券 302,300株
8331	千葉銀行	426,300	514.00	219,118,200	貸付有価証券 300,300株（150,100株）
8334	群馬銀行	245,400	339.00	83,190,600	貸付有価証券 112,900株（27,100株）
8336	武蔵野銀行	19,000	1,523.00	28,937,000	貸付有価証券 8,600株（2,100株）
8337	千葉興業銀行	35,000	234.00	8,190,000	
8338	筑波銀行	53,100	175.00	9,292,500	貸付有価証券 37,400株（19,200株）
8341	七十七銀行	43,100	1,552.00	66,891,200	貸付有価証券 19,400株（4,700株）
8342	青森銀行	9,900	2,261.00	22,383,900	貸付有価証券 4,500株（1,100株）

8343	秋田銀行	8,200	1,487.00	12,193,400	貸付有価証券 2,800株
8344	山形銀行	14,400	1,293.00	18,619,200	貸付有価証券 6,000株（1,100株）
8345	岩手銀行	8,400	2,524.00	21,201,600	貸付有価証券 3,800株（900株）
8346	東邦銀行	114,200	221.00	25,238,200	貸付有価証券 51,400株（12,300株）
8349	東北銀行	6,100	942.00	5,746,200	貸付有価証券 2,100株
8350	みちのく銀行	8,200	1,084.00	8,888,800	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	107,600	1,713.00	184,318,800	貸付有価証券 75,800株（38,900株）
8355	静岡銀行	316,300	690.00	218,247,000	貸付有価証券 197,100株（89,000株）
8356	十六銀行	16,000	1,988.00	31,808,000	貸付有価証券 7,200株（1,700株）
8358	スルガ銀行	130,700	382.00	49,927,400	貸付有価証券 44,700株
8359	八十二銀行	308,200	398.00	122,663,600	貸付有価証券 138,700株（33,300株）
8360	山梨中央銀行	14,800	851.00	12,594,800	貸付有価証券 5,100株
8361	大垣共立銀行	25,200	2,249.00	56,674,800	貸付有価証券 11,400株（2,700株）
8362	福井銀行	10,900	1,623.00	17,690,700	貸付有価証券 3,800株
8363	北國銀行	12,700	2,864.00	36,372,800	貸付有価証券 9,200株（4,700株）
8364	清水銀行	5,300	1,748.00	9,264,400	貸付有価証券 2,400株（600株）
8365	富山銀行	2,500	2,212.00	5,530,000	貸付有価証券 1,100株（300株）
8366	滋賀銀行	25,600	2,375.00	60,800,000	貸付有価証券 11,500株（2,800株）
8367	南都銀行	21,200	2,069.00	43,862,800	貸付有価証券 7,200株
8368	百五銀行	114,900	322.00	36,997,800	貸付有価証券 51,700株（12,400株）
8369	京都銀行	45,700	3,800.00	173,660,000	貸付有価証券 20,600株（4,900株）
8370	紀陽銀行	45,200	1,658.00	74,941,600	貸付有価証券 31,800株（16,400株）
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	85,000	883.00	75,055,000	貸付有価証券 38,200株（9,200株）
8379	広島銀行	188,500	503.00	94,815,500	貸付有価証券 70,700株（6,300株）
8381	山陰合同銀行	75,700	541.00	40,953,700	貸付有価証券 25,900株

8382	中国銀行	109,900	986.00	108,361,400	貸付有価証券 49,500株（11,900株）
8383	鳥取銀行	4,400	1,204.00	5,297,600	貸付有価証券 1,400株
8385	伊予銀行	182,200	645.00	117,519,000	貸付有価証券 81,700株（19,600株）
8386	百十四銀行	13,600	1,917.00	26,071,200	貸付有価証券 6,100株（1,500株）
8387	四国銀行	19,400	807.00	15,655,800	貸付有価証券 8,700株（2,100株）
8388	阿波銀行	20,900	2,456.00	51,330,400	貸付有価証券 9,300株（2,200株）
8392	大分銀行	7,300	2,414.00	17,622,200	貸付有価証券 2,500株
8393	宮崎銀行	8,500	2,328.00	19,788,000	貸付有価証券 2,900株
8395	佐賀銀行	7,800	1,173.00	9,149,400	貸付有価証券 2,600株
8397	沖縄銀行	11,700	3,080.00	36,036,000	貸付有価証券 5,300株（1,300株）
8399	琉球銀行	29,500	955.00	28,172,500	貸付有価証券 12,100株（2,000株）
8410	セブン銀行	426,700	296.00	126,303,200	貸付有価証券 145,900株
8411	みずほフィナンシャルグループ	17,355,600	131.80	2,287,468,080	貸付有価証券 7,106,500株 （1,173,600株）
8416	高知銀行	4,600	680.00	3,128,000	貸付有価証券 1,600株
8418	山口フィナンシャルグループ	159,400	646.00	102,972,400	貸付有価証券 54,500株
8521	長野銀行	4,200	1,101.00	4,624,200	貸付有価証券 1,400株
8522	名古屋銀行	9,500	2,395.00	22,752,500	貸付有価証券 3,500株
8524	北洋銀行	192,500	208.00	40,040,000	貸付有価証券 86,700株（20,800株）
8527	愛知銀行	4,600	2,783.00	12,801,800	貸付有価証券 1,600株
8530	中京銀行	5,200	2,026.00	10,535,200	貸付有価証券 1,800株
8537	大光銀行	4,400	1,470.00	6,468,000	貸付有価証券 1,500株
8541	愛媛銀行	17,800	1,180.00	21,004,000	貸付有価証券 12,500株（6,400株）
8542	トマト銀行	4,900	1,012.00	4,958,800	貸付有価証券 1,700株
8544	京葉銀行	54,500	508.00	27,686,000	貸付有価証券 18,600株
8550	栃木銀行	61,700	166.00	10,242,200	貸付有価証券 21,200株

8551	北日本銀行	4,000	1,820.00	7,280,000	貸付有価証券 1,400株
8558	東和銀行	22,400	700.00	15,680,000	貸付有価証券 7,700株
8562	福島銀行	12,000	173.00	2,076,000	貸付有価証券 4,200株（100株）
8563	大東銀行	6,600	606.00	3,999,600	貸付有価証券 2,200株
8600	トモニホールディングス	98,700	344.00	33,952,800	貸付有価証券 34,600株（800株）
8713	フィデアホールディングス	124,000	104.00	12,896,000	貸付有価証券 42,400株
8714	池田泉州ホールディングス	146,900	163.00	23,944,700	貸付有価証券 50,000株
7148	F P G	39,400	619.00	24,388,600	貸付有価証券 18,000株（4,300株）
7190	マーキュリアインベストメント	5,700	589.00	3,357,300	貸付有価証券 1,900株
8473	S B Iホールディングス	142,700	2,276.00	324,785,200	貸付有価証券 64,300株（15,400株）
8518	日本アジア投資	10,800	234.00	2,527,200	貸付有価証券 4,900株（1,200株）
8595	ジャフコ	19,600	3,595.00	70,462,000	貸付有価証券 6,700株
8601	大和証券グループ本社	1,024,900	448.30	459,462,670	貸付有価証券 350,400株
8604	野村ホールディングス	2,247,400	475.50	1,068,638,700	貸付有価証券 768,200株
8609	岡三証券グループ	108,800	325.00	35,360,000	貸付有価証券 48,900株（11,700株）
8613	丸三証券	37,900	413.00	15,652,700	貸付有価証券 26,700株（13,700株）
8614	東洋証券	45,700	123.00	5,621,100	貸付有価証券 32,200株（16,600株）
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	146,700	240.00	35,208,000	貸付有価証券 66,000株（15,800株）
8617	光世証券	3,100	522.00	1,618,200	貸付有価証券 2,100株（1,000株）
8622	水戸証券	36,900	197.00	7,269,300	貸付有価証券 12,600株
8624	いちよし証券	23,900	436.00	10,420,400	貸付有価証券 8,200株
8628	松井証券	73,000	830.00	60,590,000	貸付有価証券 24,800株
8698	マネックスグループ	93,700	219.00	20,520,300	貸付有価証券 67,900株（34,600株）
8706	極東証券	17,100	512.00	8,755,200	貸付有価証券 5,900株
8707	岩井コスモホールディングス	12,100	1,057.00	12,789,700	貸付有価証券 4,100株
8708	藍澤證券	22,900	668.00	15,297,200	貸付有価証券 10,300株（2,500株）

8732	マネーパートナーズグループ	13,600	200.00	2,720,000	貸付有価証券 6,100株（1,500株）
8739	スパークス・グループ	59,000	215.00	12,685,000	貸付有価証券 20,000株（4,800株）
8742	小林洋行	3,700	250.00	925,000	貸付有価証券 1,300株
7181	かんぽ生命保険	45,200	1,393.00	62,963,600	貸付有価証券 15,500株
8630	S O M P Oホールディングス	240,200	3,654.00	877,690,800	貸付有価証券 81,900株
8715	アニコム ホールディングス	10,600	4,595.00	48,707,000	貸付有価証券 4,500株（900株）
8725	M S & A Dインシュアランスグループ ホール	334,000	2,998.00	1,001,332,000	貸付有価証券 114,100株
8729	ソニーフィナンシャルホールディング ス	105,000	2,593.00	272,265,000	貸付有価証券 35,900株
8750	第一生命ホールディングス	722,800	1,313.00	949,036,400	貸付有価証券 247,100株
8766	東京海上ホールディングス	451,600	4,660.00	2,104,456,000	貸付有価証券 205,400株（49,300 株）
8795	T & Dホールディングス	381,800	946.00	361,182,800	貸付有価証券 135,100株
8798	アドバンスクリエイト	2,700	2,132.00	5,756,400	貸付有価証券 1,000株
7164	全国保証	36,000	4,130.00	148,680,000	貸付有価証券 25,300株（13,000株）
7187	ジェイリース	3,500	386.00	1,351,000	貸付有価証券 1,600株（400株）
7191	イントラスト	4,500	754.00	3,393,000	貸付有価証券 2,000株（500株）
7192	日本モーゲージサービス	2,600	1,998.00	5,194,800	貸付有価証券 900株
7196	C a s a	4,500	1,085.00	4,882,500	貸付有価証券 1,600株
7198	アルヒ	20,300	1,549.00	31,444,700	貸付有価証券 8,900株（2,100株）
7199	プレミアグループ	6,900	1,971.00	13,599,900	貸付有価証券 2,400株
8253	クレディセゾン	89,500	1,282.00	114,739,000	貸付有価証券 63,000株（32,400株）
8424	芙蓉総合リース	13,400	6,010.00	80,534,000	貸付有価証券 6,100株（1,500株）
8425	みずほリース	19,700	2,325.00	45,802,500	貸付有価証券 6,800株
8439	東京センチュリー	25,700	5,370.00	138,009,000	貸付有価証券 11,600株（2,800株）
8511	日本証券金融	56,300	506.00	28,487,800	貸付有価証券 19,200株
8515	アイフル	194,800	241.00	46,946,800	貸付有価証券 137,200株（70,600 株）

8566	リコーリース	10,000	3,010.00	30,100,000	貸付有価証券 3,400株
8570	イオンフィナンシャルサービス	78,200	1,192.00	93,214,400	貸付有価証券 26,800株
8572	アコム	256,700	421.00	108,070,700	貸付有価証券 114,300株（26,600株）
8584	ジャックス	14,100	1,777.00	25,055,700	貸付有価証券 4,800株
8585	オリエントコーポレーション	345,500	122.00	42,151,000	貸付有価証券 243,400株（125,300株）
8586	日立キャピタル	30,100	2,354.00	70,855,400	貸付有価証券 13,600株（3,300株）
8589	アプラスフィナンシャル	61,300	68.00	4,168,400	貸付有価証券 27,600株（6,600株）
8591	オリックス	798,900	1,355.00	1,082,509,500	貸付有価証券 273,900株
8593	三菱ＵＦＪリース	324,200	514.00	166,638,800	貸付有価証券 110,200株
8596	九州リースサービス	6,300	501.00	3,156,300	貸付有価証券 2,900株（700株）
8697	日本取引所グループ	366,600	2,437.00	893,404,200	貸付有価証券 125,000株
8771	イー・ギャランティ	13,700	2,522.00	34,551,400	貸付有価証券 4,600株
8772	アサックス	6,600	703.00	4,639,800	貸付有価証券 2,200株
8793	NECキャピタルソリューション	5,200	1,985.00	10,322,000	貸付有価証券 1,800株
2337	いちご	162,500	270.00	43,875,000	貸付有価証券 55,500株
2353	日本駐車場開発	126,100	135.00	17,023,500	貸付有価証券 47,900株
2975	スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,323.00	8,731,800	貸付有価証券 2,300株
2982	A Dワークスグループ	23,700	187.00	4,431,900	貸付有価証券 8,000株
3003	ヒューリック	272,700	1,004.00	273,790,800	
3228	三栄建築設計	5,100	1,271.00	6,482,100	貸付有価証券 1,700株
3231	野村不動産ホールディングス	77,500	1,930.00	149,575,000	貸付有価証券 35,000株（8,400株）
3232	三重交通グループホールディングス	25,900	471.00	12,198,900	貸付有価証券 8,900株
3244	サムティ	18,100	1,362.00	24,652,200	貸付有価証券 6,200株
3245	ディア・ライフ	18,000	492.00	8,856,000	貸付有価証券 5,600株
3246	コーセーアールイー	3,800	521.00	1,979,800	貸付有価証券 1,700株（400株）

3252	日本商業開発	8,100	1,523.00	12,336,300	貸付有価証券 2,700株
3254	プレサンスコーポレーション	21,000	1,193.00	25,053,000	貸付有価証券 6,900株
3271	ＴＨＥグローバル社	6,000	252.00	1,512,000	貸付有価証券 2,900株（700株）
3275	ハウスコム	2,200	1,331.00	2,928,200	貸付有価証券 800株（200株）
3276	日本管理センター	8,400	1,204.00	10,113,600	貸付有価証券 900株（900株）
3277	サンセイランディック	3,700	862.00	3,189,400	貸付有価証券 1,300株
3280	エストラスト	1,700	626.00	1,064,200	貸付有価証券 600株
3284	フージャースホールディングス	25,500	533.00	13,591,500	貸付有価証券 8,700株
3288	オープンハウス	37,100	3,645.00	135,229,500	貸付有価証券 12,600株
3289	東急不動産ホールディングス	347,300	500.00	173,650,000	貸付有価証券 140,900株（22,200株）
3291	飯田グループホールディングス	106,500	1,684.00	179,346,000	貸付有価証券 47,900株（11,500株）
3294	イーグランド	2,000	701.00	1,402,000	貸付有価証券 700株
3299	ムゲンエステート	8,800	539.00	4,743,200	貸付有価証券 4,000株（1,000株）
3452	ビーロット	6,000	710.00	4,260,000	貸付有価証券 2,000株
3454	ファーストブラザーズ	2,900	712.00	2,064,800	貸付有価証券 2,000株（1,000株）
3457	ハウスドゥ	6,300	1,029.00	6,482,700	貸付有価証券 2,400株
3458	シーアールイー	3,200	1,369.00	4,380,800	貸付有価証券 1,100株
3464	プロパティエージェント	2,000	1,041.00	2,082,000	貸付有価証券 900株（200株）
3465	ケイアイスター不動産	4,000	1,724.00	6,896,000	貸付有価証券 1,300株
3467	アグレ都市デザイン	2,100	490.00	1,029,000	貸付有価証券 700株
3475	グッドコムアセット	3,100	1,674.00	5,189,400	貸付有価証券 1,300株（300株）
3480	ジェイ・エス・ビー	2,700	2,644.00	7,138,800	貸付有価証券 1,000株
3484	テンポイノベーション	2,900	676.00	1,960,400	貸付有価証券 1,400株（400株）
3486	グローバル・リンク・マネジメント	2,100	675.00	1,417,500	貸付有価証券 900株（200株）
4666	パーク２４	68,600	1,770.00	121,422,000	貸付有価証券 30,800株（7,400株）

4809	パラカ	3,300	1,662.00	5,484,600	貸付有価証券 2,200株（1,100株）
8801	三井不動産	629,900	1,903.50	1,199,014,650	貸付有価証券 218,700株
8802	三菱地所	894,900	1,584.00	1,417,521,600	貸付有価証券 305,900株
8803	平和不動産	23,400	3,085.00	72,189,000	貸付有価証券 13,100株（5,100株）
8804	東京建物	134,600	1,248.00	167,980,800	
8806	ダイビル	32,900	987.00	32,472,300	貸付有価証券 11,300株
8818	京阪神ビルディング	20,500	1,380.00	28,290,000	貸付有価証券 7,100株
8830	住友不動産	287,100	2,884.00	827,996,400	貸付有価証券 129,200株（31,000株）
8841	テーオーシー	25,100	681.00	17,093,100	貸付有価証券 11,400株（2,700株）
8842	東京楽天地	2,100	4,505.00	9,460,500	貸付有価証券 700株
8848	レオパレス 2 1	167,400	236.00	39,506,400	貸付有価証券 18,000株（18,000株）
8850	スターツコーポレーション	17,400	2,228.00	38,767,200	貸付有価証券 7,800株（1,900株）
8860	フジ住宅	14,800	524.00	7,755,200	貸付有価証券 5,100株
8864	空港施設	12,800	416.00	5,324,800	貸付有価証券 4,400株
8869	明和地所	7,000	412.00	2,884,000	貸付有価証券 2,400株
8871	ゴールドクレスト	10,100	1,484.00	14,988,400	貸付有価証券 4,500株（1,100株）
8877	エスリード	5,000	1,341.00	6,705,000	貸付有価証券 1,700株
8881	日神グループホールディングス	18,900	365.00	6,898,500	貸付有価証券 6,500株
8892	日本エスコン	23,100	808.00	18,664,800	貸付有価証券 10,400株（2,500株）
8897	タカラレーベン	58,400	354.00	20,673,600	貸付有価証券 20,000株
8904	A V A N T I A	7,200	833.00	5,997,600	貸付有価証券 2,500株
8905	イオンモール	64,000	1,402.00	89,728,000	貸付有価証券 28,800株（6,900株）
8908	毎日コムネット	3,300	797.00	2,630,100	貸付有価証券 1,000株
8917	ファースト住建	5,400	932.00	5,032,800	貸付有価証券 1,900株
8918	ランド	695,200	10.00	6,952,000	貸付有価証券 234,800株
8919	カチタス	31,600	2,555.00	80,738,000	貸付有価証券 14,200株（3,400株）

8923	トーセイ	17,600	1,135.00	19,976,000	貸付有価証券 7,900株（1,900株）
8928	穴吹興産	2,800	1,785.00	4,998,000	
8934	サンフロンティア不動産	17,600	853.00	15,012,800	貸付有価証券 6,000株
8935	エフ・ジェー・ネクスト	11,100	872.00	9,679,200	貸付有価証券 5,000株（1,200株）
8940	インテリックス	3,600	495.00	1,782,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
8944	ランドビジネス	4,300	368.00	1,582,400	貸付有価証券 1,900株
8945	日本社宅サービス	3,900	1,101.00	4,293,900	貸付有価証券 300株（300株）
8999	グランディハウス	9,900	368.00	3,643,200	貸付有価証券 3,400株
9706	日本空港ビルデング	40,800	4,750.00	193,800,000	貸付有価証券 28,700株（14,800株）
1954	日本工営	8,300	3,005.00	24,941,500	貸付有価証券 900株（900株）
2120	L I F U L L	43,200	445.00	19,224,000	貸付有価証券 14,800株
2121	ミクシィ	18,600	1,931.00	35,916,600	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	8,300	1,151.00	9,553,300	
2127	日本M＆Aセンター	93,500	4,895.00	457,682,500	貸付有価証券 42,100株（10,100株）
2130	メンバーズ	3,600	1,579.00	5,684,400	貸付有価証券 1,300株
2139	中広	1,700	545.00	926,500	貸付有価証券 600株（100株）
2146	ＵＴグループ	19,500	2,324.00	45,318,000	
2148	アイティメディア	5,000	1,672.00	8,360,000	貸付有価証券 1,300株
2151	タケエイ	11,800	1,028.00	12,130,400	貸付有価証券 4,000株
2153	E・Jホールディングス	2,200	1,598.00	3,515,600	貸付有価証券 500株
2154	ビーネックスグループ	15,500	946.00	14,663,000	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
2157	コシダカホールディングス	29,800	439.00	13,082,200	
2163	アルトナー	3,000	938.00	2,814,000	貸付有価証券 1,300株（300株）
2168	パソナグループ	13,400	1,151.00	15,423,400	貸付有価証券 5,200株
2169	C D S	3,100	1,283.00	3,977,300	
2170	リンクアンドモチベーション	27,300	410.00	11,193,000	貸付有価証券 4,800株
2174	G C A	15,000	646.00	9,690,000	
2175	エス・エム・エス	38,500	2,511.00	96,673,500	貸付有価証券 27,100株（13,800株）
2180	サニーサイドアップグループ	4,300	831.00	3,573,300	貸付有価証券 1,300株（300株）

2181	パーソルホールディングス	123,700	1,476.00	182,581,200	貸付有価証券 55,700株（13,400株）
2183	リニカル	6,000	872.00	5,232,000	貸付有価証券 4,100株（2,000株）
2193	クックパッド	43,200	349.00	15,076,800	貸付有価証券 14,800株
2196	エスクリ	3,900	382.00	1,489,800	貸付有価証券 1,300株
2198	アイ・ケイ・ケイ	6,000	564.00	3,384,000	貸付有価証券 2,100株
2301	学情	4,400	1,218.00	5,359,200	貸付有価証券 1,500株
2305	スタジオアリス	6,200	1,604.00	9,944,800	貸付有価証券 2,800株（700株）
2309	シミックホールディングス	6,100	1,487.00	9,070,700	貸付有価証券 3,100株（700株）
2311	エプコ	2,600	1,073.00	2,789,800	貸付有価証券 200株（200株）
2325	N J S	2,700	1,797.00	4,851,900	
2331	総合警備保障	49,200	4,920.00	242,064,000	貸付有価証券 22,100株（5,300株）
2371	カカクコム	91,400	2,730.00	249,522,000	貸付有価証券 41,700株（10,000株）
2372	アイロムグループ	4,400	3,260.00	14,344,000	貸付有価証券 2,000株（500株）
2374	セントケア・ホールディング	8,000	406.00	3,248,000	貸付有価証券 2,700株
2376	サイネックス	2,100	681.00	1,430,100	貸付有価証券 700株
2378	ルネサンス	6,900	1,027.00	7,086,300	貸付有価証券 2,400株
2379	ディップ	17,400	2,254.00	39,219,600	貸付有価証券 7,900株（1,900株）
2389	オプトホールディング	6,700	1,445.00	9,681,500	貸付有価証券 2,300株
2395	新日本科学	13,400	672.00	9,004,800	貸付有価証券 4,600株
2398	ツクイ	29,100	512.00	14,899,200	貸付有価証券 10,000株
2410	キャリアデザインセンター	2,800	998.00	2,794,400	貸付有価証券 1,100株
2412	ベネフィット・ワン	45,000	2,136.00	96,120,000	貸付有価証券 15,300株（3,700株）
2413	エムスリー	272,900	4,585.00	1,251,246,500	貸付有価証券 93,100株
2418	ツカダ・グローバルホールディング	7,900	305.00	2,409,500	貸付有価証券 2,700株
2424	プラス	1,600	546.00	873,600	貸付有価証券 500株
2427	アウトソーシング	70,800	684.00	48,427,200	貸付有価証券 7,600株（7,600株）

2428	ウェルネット	12,500	731.00	9,137,500	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
2429	ワールドホールディングス	4,200	1,670.00	7,014,000	貸付有価証券 300株（300株）
2432	ディー・エヌ・エー	60,600	1,342.00	81,325,200	貸付有価証券 27,500株（6,600株）
2433	博報堂ＤＹホールディングス	172,100	1,246.00	214,436,600	貸付有価証券 121,200株（62,300株）
2440	ぐるなび	21,500	760.00	16,340,000	貸付有価証券 7,300株
2445	タカミヤ	13,100	532.00	6,969,200	貸付有価証券 5,900株（1,400株）
2453	ジャパンベストレスキューシステム	9,800	860.00	8,428,000	貸付有価証券 2,900株
2461	ファンコミュニケーションズ	34,000	452.00	15,368,000	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
2462	ライク	4,100	1,464.00	6,002,400	貸付有価証券 1,700株
2464	ビジネス・ブレークスルー	5,200	379.00	1,970,800	貸付有価証券 1,700株
2471	エスプール	31,800	747.00	23,754,600	貸付有価証券 8,200株
2475	ＷＤＢホールディングス	5,600	2,721.00	15,237,600	貸付有価証券 2,500株（600株）
2477	手間いらず	800	4,835.00	3,868,000	
2485	ティア	7,200	519.00	3,736,800	貸付有価証券 2,500株
2487	ＣＤＧ	1,300	1,576.00	2,048,800	貸付有価証券 500株（100株）
2491	バリューコマース	6,900	3,005.00	20,734,500	
2492	インフォマート	135,600	827.00	112,141,200	
2749	ＪＰホールディングス	38,900	285.00	11,086,500	貸付有価証券 17,400株（4,200株）
3521	エコナックホールディングス	22,300	102.00	2,274,600	貸付有価証券 7,600株
4282	ＥＰＳホールディングス	16,800	1,033.00	17,354,400	貸付有価証券 6,400株
4286	レッグス	3,100	928.00	2,876,800	貸付有価証券 1,100株
4290	プレステージ・インターナショナル	46,300	799.00	36,993,700	貸付有価証券 15,800株
4301	アミューズ	6,700	2,282.00	15,289,400	貸付有価証券 4,700株（2,400株）
4310	ドリームインキュベータ	3,800	1,429.00	5,430,200	貸付有価証券 1,300株
4318	クイック	7,700	1,175.00	9,047,500	貸付有価証券 2,600株
4319	ＴＡＣ	7,400	197.00	1,457,800	貸付有価証券 3,300株（800株）
4321	ケネディクス	115,300	531.00	61,224,300	

4324	電通グループ	127,600	2,550.00	325,380,000	貸付有価証券 13,800株（13,800株）
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	4,700	662.00	3,111,400	貸付有価証券 2,100株（500株）
4337	びあ	3,500	3,480.00	12,180,000	貸付有価証券 2,400株（1,200株）
4343	イオンファンタジー	4,800	1,590.00	7,632,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
4345	シーティーエス	14,000	874.00	12,236,000	貸付有価証券 6,300株（1,500株）
4346	ネクシィーズグループ	3,800	1,002.00	3,807,600	貸付有価証券 1,500株
4544	みらかホールディングス	34,600	2,586.00	89,475,600	貸付有価証券 15,500株（3,600株）
4641	アルプス技研	10,900	1,866.00	20,339,400	
4651	サニックス	21,600	292.00	6,307,200	貸付有価証券 15,200株（7,800株）
4653	ダイオーズ	2,400	1,019.00	2,445,600	貸付有価証券 900株
4658	日本空調サービス	12,900	730.00	9,417,000	貸付有価証券 4,400株
4661	オリエンタルランド	131,600	14,510.00	1,909,516,000	貸付有価証券 59,500株（14,300株）
4665	ダスキン	30,800	2,714.00	83,591,200	貸付有価証券 22,300株（11,400株）
4668	明光ネットワークジャパン	15,700	853.00	13,392,100	貸付有価証券 10,200株（5,200株）
4671	ファルコホールディングス	6,800	1,552.00	10,553,600	貸付有価証券 2,300株
4678	秀英予備校	2,700	421.00	1,136,700	貸付有価証券 900株
4679	田谷	2,300	551.00	1,267,300	貸付有価証券 800株
4680	ラウンドワン	34,500	813.00	28,048,500	貸付有価証券 15,600株（3,700株）
4681	リゾートトラスト	56,700	1,449.00	82,158,300	貸付有価証券 19,300株
4694	ビー・エム・エル	15,900	2,822.00	44,869,800	貸付有価証券 5,400株
4696	ワタベウェディング	2,000	347.00	694,000	貸付有価証券 700株
4708	りらいあコミュニケーションズ	22,400	1,024.00	22,937,600	貸付有価証券 7,600株
4714	リソー教育	56,500	333.00	18,814,500	
4718	早稲田アカデミー	5,400	923.00	4,984,200	貸付有価証券 1,400株
4732	ユー・エス・エス	138,500	1,738.00	240,713,000	貸付有価証券 47,600株
4745	東京個別指導学院	4,400	553.00	2,433,200	貸付有価証券 1,500株
4751	サイバーエージェント	76,200	5,360.00	408,432,000	貸付有価証券 32,000株（7,700株）

4755	楽天	576,800	998.00	575,646,400	
4763	クリーク・アンド・リバー社	6,500	1,063.00	6,909,500	貸付有価証券 2,200株
4767	テー・オー・ダブリュー	19,700	381.00	7,505,700	
4792	山田コンサルティンググループ	8,000	1,305.00	10,440,000	貸付有価証券 2,600株（600株）
4801	セントラルスポーツ	4,600	2,346.00	10,791,600	貸付有価証券 2,100株（500株）
4848	フルキャストホールディングス	12,400	1,490.00	18,476,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
4849	エン・ジャパン	22,000	2,815.00	61,930,000	貸付有価証券 9,800株（2,400株）
5261	リソルホールディングス	1,300	3,515.00	4,569,500	貸付有価証券 800株
6028	テクノプロ・ホールディングス	24,700	6,280.00	155,116,000	
6029	アトラ	2,800	244.00	683,200	貸付有価証券 300株（300株）
6032	インターワークス	2,400	383.00	919,200	貸付有価証券 800株
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	5,000	11,210.00	56,050,000	貸付有価証券 1,700株
6036	K e e P e r 技研	4,500	1,498.00	6,741,000	
6037	ファーストロジック	2,400	641.00	1,538,400	貸付有価証券 1,300株（300株）
6044	三機サービス	2,400	971.00	2,330,400	貸付有価証券 1,200株（300株）
6047	G u n o s y	7,700	968.00	7,453,600	貸付有価証券 3,000株
6048	デザインワン・ジャパン	3,600	301.00	1,083,600	貸付有価証券 1,100株（300株）
6050	イー・ガーディアン	5,400	2,714.00	14,655,600	貸付有価証券 2,200株
6054	リブセンス	7,900	304.00	2,401,600	貸付有価証券 5,600株（2,900株）
6055	ジャパンマテリアル	38,000	1,695.00	64,410,000	貸付有価証券 12,900株
6058	ベクトル	15,400	884.00	13,613,600	貸付有価証券 5,300株
6059	ウチヤマホールディングス	6,100	325.00	1,982,500	貸付有価証券 2,800株（700株）
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	10,500	876.00	9,198,000	貸付有価証券 3,000株（200株）
6065	ライクキッズ	2,100	1,002.00	2,104,200	貸付有価証券 1,300株（300株）
6070	キャリアリンク	4,000	573.00	2,292,000	貸付有価証券 1,400株
6071	I B J	8,400	787.00	6,610,800	貸付有価証券 3,800株（900株）
6073	アサンテ	5,000	1,491.00	7,455,000	貸付有価証券 1,700株

6077	N・フィールド	8,500	561.00	4,768,500	貸付有価証券 2,900株
6078	バリューHR	4,900	1,413.00	6,923,700	貸付有価証券 2,200株（600株）
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	10,000	4,015.00	40,150,000	貸付有価証券 4,000株（1,000株）
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	2,470.00	11,609,000	貸付有価証券 1,600株
6083	E R Iホールディングス	3,500	647.00	2,264,500	貸付有価証券 2,400株（1,200株）
6087	アピスト	1,900	2,686.00	5,103,400	貸付有価証券 600株
6088	シグマクシス	8,500	1,828.00	15,538,000	貸付有価証券 2,800株
6089	ウィルグループ	8,100	668.00	5,410,800	貸付有価証券 2,800株
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	17,100	200.00	3,420,000	貸付有価証券 7,600株（1,800株）
6098	リクルートホールディングス	886,500	3,694.00	3,274,731,000	貸付有価証券 303,000株
6099	エラン	7,300	1,893.00	13,818,900	貸付有価証券 3,300株（800株）
6171	土木管理総合試験所	5,400	369.00	1,992,600	
6175	ネットマーケティング	4,800	651.00	3,124,800	
6178	日本郵政	1,014,200	764.50	775,355,900	貸付有価証券 346,700株
6183	ベルシステム24ホールディングス	20,700	1,360.00	28,152,000	貸付有価証券 7,100株
6184	鎌倉新書	9,300	1,206.00	11,215,800	貸付有価証券 4,200株（1,000株）
6185	S M N	2,600	1,156.00	3,005,600	貸付有価証券 700株
6186	一蔵	1,300	390.00	507,000	貸付有価証券 500株
6187	L I T A L I C O	4,300	2,495.00	10,728,500	貸付有価証券 1,400株
6189	グローバルキッズCOMPANY	2,200	555.00	1,221,000	貸付有価証券 800株（200株）
6191	エアトリ	6,500	1,363.00	8,859,500	貸付有価証券 2,500株（600株）
6194	アトラエ	3,700	3,255.00	12,043,500	貸付有価証券 1,400株（300株）
6196	ストライク	4,700	5,100.00	23,970,000	貸付有価証券 1,600株
6197	ソラスト	34,100	1,045.00	35,634,500	貸付有価証券 15,300株（3,700株）
6199	セラク	3,900	1,072.00	4,180,800	貸付有価証券 1,300株
6200	インソース	5,100	2,675.00	13,642,500	貸付有価証券 2,600株（600株）
6532	ベイカレント・コンサルティング	7,500	9,310.00	69,825,000	貸付有価証券 2,600株

6533	Orchestra Holdings	2,600	1,680.00	4,368,000	貸付有価証券 1,100株（300株）
6535	アイモバイル	4,400	742.00	3,264,800	貸付有価証券 1,300株
6538	キャリアインデックス	5,100	368.00	1,876,800	貸付有価証券 1,700株
6539	MS - Japan	4,000	817.00	3,268,000	貸付有価証券 1,400株
6540	船場	2,000	972.00	1,944,000	貸付有価証券 700株
6541	グレイステクノロジー	5,700	6,240.00	35,568,000	貸付有価証券 1,900株
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	13,000	3,450.00	44,850,000	貸付有価証券 5,800株（1,400株）
6546	フルテック	1,700	1,313.00	2,232,100	
6547	グリーンズ	3,100	504.00	1,562,400	貸付有価証券 500株（500株）
6551	ツナググループ・ホールディングス	2,100	457.00	959,700	貸付有価証券 500株
6552	GameWith	3,700	610.00	2,257,000	貸付有価証券 1,200株（300株）
6553	ソウルドアウト	2,500	2,500.00	6,250,000	貸付有価証券 600株
6555	MS & Consulting	2,300	530.00	1,219,000	貸付有価証券 500株
6564	ミダック	1,600	1,767.00	2,827,200	
6569	日総工産	8,300	677.00	5,619,100	貸付有価証券 2,800株
6571	キュービーネットホールディングス	5,100	2,083.00	10,623,300	
6572	RPAホールディングス	9,400	782.00	7,350,800	貸付有価証券 3,200株（800株）
7030	スプリックス	3,500	794.00	2,779,000	貸付有価証券 1,400株
7033	マネジメントソリューションズ	5,400	1,437.00	7,759,800	
7034	プロレド・パートナーズ	1,700	4,860.00	8,262,000	
7035	and factory	1,200	1,041.00	1,249,200	
7060	ギークス	1,300	1,325.00	1,722,500	
7085	カーブスホールディングス	34,000	600.00	20,400,000	
7088	フォーラムエンジニアリング	6,400	845.00	5,408,000	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	6,200	795.00	4,929,000	貸付有価証券 2,100株
8876	リログループ	67,600	2,022.00	136,687,200	貸付有価証券 47,600株（24,500株）
8920	東祥	7,700	1,303.00	10,033,100	貸付有価証券 2,700株
9603	エイチ・アイ・エス	19,300	1,694.00	32,694,200	貸付有価証券 13,600株（7,000株）
9612	ラックランド	2,900	2,220.00	6,438,000	貸付有価証券 800株

9616	共立メンテナンス	20,500	3,795.00	77,797,500	貸付有価証券 10,200株（3,200株）
9619	イチネンホールディングス	13,900	1,178.00	16,374,200	貸付有価証券 9,700株（5,000株）
9621	建設技術研究所	8,500	1,699.00	14,441,500	貸付有価証券 900株（900株）
9622	スペース	8,000	954.00	7,632,000	
9624	長大	4,900	1,054.00	5,164,600	貸付有価証券 2,100株（500株）
9628	燦ホールディングス	5,400	1,194.00	6,447,600	貸付有価証券 1,900株
9632	スバル興業	700	8,110.00	5,677,000	貸付有価証券 300株
9633	東京テアトル	4,800	1,240.00	5,952,000	貸付有価証券 1,600株
9644	タナベ経営	2,400	1,282.00	3,076,800	貸付有価証券 800株
9663	ナガワ	3,900	7,670.00	29,913,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
9671	よみうりランド	2,700	3,615.00	9,760,500	貸付有価証券 900株
9672	東京都競馬	8,100	3,625.00	29,362,500	
9675	常磐興産	5,000	1,439.00	7,195,000	貸付有価証券 1,700株
9678	カナモト	20,200	2,248.00	45,409,600	貸付有価証券 14,200株（7,300株）
9681	東京ドーム	50,100	797.00	39,929,700	貸付有価証券 22,500株（5,400株）
9699	西尾レントオール	11,400	2,167.00	24,703,800	貸付有価証券 4,300株
9704	アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	79,300	29.00	2,299,700	貸付有価証券 35,700株（8,600株）
9715	トランス・コスモス	11,800	2,395.00	28,261,000	貸付有価証券 4,100株
9716	乃村工藝社	53,000	885.00	46,905,000	貸付有価証券 37,400株（19,200株）
9722	藤田観光	5,400	1,791.00	9,671,400	貸付有価証券 3,800株（2,000株）
9726	KNT-CTホールディングス	7,700	1,074.00	8,269,800	貸付有価証券 5,400株（2,800株）
9728	日本管財	13,200	1,907.00	25,172,400	貸付有価証券 4,500株
9729	トーカイ	12,000	2,433.00	29,196,000	貸付有価証券 4,100株
9731	白洋舎	1,400	2,890.00	4,046,000	
9735	セコム	131,300	9,343.00	1,226,735,900	貸付有価証券 44,900株
9740	セントラル警備保障	6,000	4,225.00	25,350,000	貸付有価証券 2,100株
9743	丹青社	23,400	756.00	17,690,400	貸付有価証券 8,000株

9744	メイテック	15,200	5,260.00	79,952,000	貸付有価証券 5,200株
9755	応用地質	13,300	1,361.00	18,101,300	
9757	船井総研ホールディングス	25,600	2,434.00	62,310,400	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
9760	進学会ホールディングス	4,800	509.00	2,443,200	貸付有価証券 1,600株
9765	オオバ	8,800	618.00	5,438,400	貸付有価証券 3,300株
9768	いであ	3,000	1,841.00	5,523,000	貸付有価証券 1,000株（200株）
9769	学究社	3,600	1,106.00	3,981,600	貸付有価証券 1,300株
9783	ベネッセホールディングス	41,200	2,890.00	119,068,000	貸付有価証券 29,000株（14,900株）
9787	イオンディライト	15,200	3,000.00	45,600,000	貸付有価証券 5,800株（600株）
9788	ナック	6,800	871.00	5,922,800	貸付有価証券 3,200株（800株）
9792	ニチイ学館	17,600	1,648.00	29,004,800	
9793	ダイセキ	20,700	2,743.00	56,780,100	貸付有価証券 9,300株（2,200株）
9795	ステップ	4,500	1,527.00	6,871,500	貸付有価証券 1,600株
合 計		153,429,200		284,066,971,990	

(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ＭＵＦＧ証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	12,692,363,809

[令和 2年 6月25日現在]

コール・ローン	1,525,562,396
株式	438,870,368,860
投資証券	10,950,452,444
派生商品評価勘定	6,095,376
未収入金	20,610,284
未収配当金	479,715,190
差入委託証拠金	5,908,518,302
流動資産合計	470,453,686,661
資産合計	470,453,686,661
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	188,971,836
未払解約金	209,818,059
未払利息	2,237
流動負債合計	398,792,132
負債合計	398,792,132
純資産の部	
元本等	
元本	165,977,747,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	304,077,147,266
元本等合計	470,054,894,529
純資産合計	470,054,894,529
負債純資産合計	470,453,686,661

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	153,897,147,562円
期中追加設定元本額	196,511,729,750円
期中一部解約元本額	184,431,130,049円
元本の内訳	
MAXIS 海外株式 (MSCI コクサイ) 上場投信	3,253,127,535円

	[令和 2年 6月25日現在]
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	699,561,721円
ファンド・マネジャー（海外株式）	52,228,523円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,307,688,714円
eMAXIS バランス（８資産均等型）	1,305,208,260円
eMAXIS バランス（波乗り型）	212,756,784円
コアバランス	159,412円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	36,675,852円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	60,930,659円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	43,931,280円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	36,679,987,915円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,041,076,896円
eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）	2,369,537,495円
つみたて先進国株式	4,711,372,485円
つみたて８資産均等バランス	966,190,240円
つみたて４資産均等バランス	272,563,629円
eMAXIS マイマネージャー １９７０s	1,582,912円
eMAXIS マイマネージャー １９８０s	2,143,039円
eMAXIS マイマネージャー １９９０s	2,422,595円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	26,579,108円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	23,199,354円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	11,378,845円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	6,219,782,636円
eMAXIS Slim 全世界株式（３地域均等型）	208,822,467円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	9,017,925,872円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	12,362,617円
先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）	117,749,827円
つみたて全世界株式	888,668円
三菱ＵＦＪ DC海外株式インデックスファンド	17,106,437,760円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,638,159,898円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	587,302,109円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	1,009,318,427円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	415,143,515円
三菱ＵＦＪ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	204,830,698円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	335,488,826円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	207,253,120円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	62,035,083円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	77,864,318円

	[令和 2年 6月25日現在]
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	284,896,775円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	201,730,820円
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	431,116,817円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,005,905円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,844,927,974円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	134,229,377円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,518,920,598円
M U A M 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	18,523,208,048円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	2,063,462円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,239,819,580円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	8,098,774,077円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	23,715,417円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	120,635,807円
M U K A M バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,110,601,694円
M U K A M 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）	444,222,326円
M U K A M 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）	737,230,088円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	52,619,336円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,000,167,268円
M U K A M バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	65,754,581円
M U K A M 外国株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	2,361,938,144円
M U K A M 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）	693,812,173円
M U K A M 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	6,289,418,433円
M U K A M バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）	173,310円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,049,858,090円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	1,325,042円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	5,026,361円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	3,038,600円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	5,415,865円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	50,615,459円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	7,985,585円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	64,545,213円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	11,467,378円

	[令和 2年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	73,119,428円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド	5,244,567,093円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド （安定型）	166,083,889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）	620,537,955円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド （成長型）	610,193,833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）	551,316,368円
合計	165,977,747,263円
２．受益権の総数	165,977,747,263口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１ 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
３．金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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 6月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	17,711,888,645
投資証券	319,908,095
合計	18,031,796,740

(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 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	20,409,255,061	—	20,222,134,475	187,120,586
合計		20,409,255,061	—	20,222,134,475	187,120,586

（注）時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

通貨関連

[令和 2年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	1,029,436,048	—	1,034,103,000	4,666,952
	カナダドル	42,482,394	—	42,427,800	54,594
	オーストラリアドル	39,902,130	—	39,717,000	185,130
	イギリスポンド	69,369,280	—	69,175,600	193,680
	スイスフラン	43,991,220	—	44,038,800	47,580
	香港ドル	13,474,412	—	13,533,800	59,388
	シンガポールドル	4,600,200	—	4,614,000	13,800
	スウェーデンクローネ	24,319,740	—	24,252,800	66,940
	ノルウェークローネ	11,080,100	—	11,070,000	10,100
	デンマーククローネ	16,500,700	—	16,493,400	7,300
	ユーロ	96,443,200	—	96,416,000	27,200
	売建				
	ユーロ	36,157,350	—	36,156,000	1,350
合計		1,427,756,774	—	1,431,998,200	4,244,126

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	2.8320円
(1万口当たり純資産額)	(28,320円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	71,005	14.31	1,016,081.55	
	CABOT OIL & GAS CORP	44,274	17.92	793,390.08	
	CHENIERE ENERGY INC	25,546	46.62	1,190,954.52	
	CHEVRON CORP	207,934	87.64	18,223,335.76	
	CONCHO RESOURCES INC	21,930	51.61	1,131,807.30	
	CONOCOPHILLIPS	119,782	40.99	4,909,864.18	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	17,170	41.90	719,423.00	
	EOG RESOURCES INC	64,552	48.95	3,159,820.40	
	EXXON MOBIL CORP	468,161	44.50	20,833,164.50	
	HALLIBURTON CO	95,360	11.86	1,130,969.60	
	HESS CORP	30,590	48.96	1,497,686.40	
	HOLLYFRONTIER CORP	16,085	29.58	475,794.30	
	KINDER MORGAN INC	226,085	14.81	3,348,318.85	
	MARATHON PETROLEUM CORP	71,964	36.23	2,607,255.72	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	43,849	11.19	490,670.31	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,204	18.00	1,785,672.00	
	ONEOK INC	45,913	32.30	1,482,989.90	
	PHILLIPS 66	48,705	69.99	3,408,862.95	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,395	92.16	1,695,283.20	
	SCHLUMBERGER LTD	154,596	17.86	2,761,084.56	
	VALERO ENERGY CORP	45,359	58.02	2,631,729.18	
	WILLIAMS COS INC	134,671	18.84	2,537,201.64	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,432	233.14	5,696,076.48	
	ALBEMARLE CORP	11,163	73.32	818,471.16	
	AMCOR PLC	177,674	9.96	1,769,633.04	
	AVERY DENNISON CORP	9,205	112.29	1,033,629.45	

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	23,266	21.44	498,823.04
BALL CORP	36,048	68.98	2,486,591.04
CELANESE CORP	14,056	82.96	1,166,085.76
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,432	27.84	624,506.88
CORTEVA INC	82,944	26.07	2,162,350.08
CROWN HOLDINGS INC	14,764	62.29	919,649.56
DOW INC	82,149	38.45	3,158,629.05
DUPONT DE NEMOURS INC	81,929	51.54	4,222,620.66
EASTMAN CHEMICAL CO	14,286	66.85	955,019.10
ECOLAB INC	28,224	196.67	5,550,814.08
FMC CORP	14,131	96.63	1,365,478.53
FREEMONT-MCMORAN INC	160,438	10.57	1,695,829.66
INTERNATIONAL PAPER CO	41,079	33.58	1,379,432.82
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,024	122.07	1,101,559.68
LINDE PLC	59,062	206.07	12,170,906.34
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,571	60.64	1,793,185.44
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,758	206.49	1,395,459.42
MOSAIC CO/THE	42,586	11.97	509,754.42
NEWMONT CORP	88,802	58.41	5,186,924.82
NUCOR CORP	33,406	40.67	1,358,622.02
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,156	97.94	1,092,618.64
PPG INDUSTRIES INC	26,119	101.88	2,661,003.72
RPM INTERNATIONAL INC	13,623	73.10	995,841.30
SEALED AIR CORP	16,288	31.41	511,606.08
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,187	566.65	5,205,813.55
STEEL DYNAMICS INC	23,112	25.87	597,907.44
VULCAN MATERIALS CO	14,657	118.06	1,730,405.42
WESTROCK CO	27,540	26.20	721,548.00
3M CO	63,639	152.22	9,687,128.58
AERCAP HOLDINGS NV	13,398	30.66	410,782.68
ALLEGION PLC	10,785	97.83	1,055,096.55
AMETEK INC	25,529	85.84	2,191,409.36
BOEING CO/THE	59,220	176.69	10,463,581.80
CARRIER GLOBAL CORP	90,930	21.82	1,984,092.60
CATERPILLAR INC	60,858	122.06	7,428,327.48
CUMMINS INC	16,711	166.61	2,784,219.71
DEERE & CO	32,964	150.49	4,960,752.36
DOVER CORP	15,749	91.89	1,447,175.61
EATON CORP PLC	45,797	84.01	3,847,405.97
EMERSON ELECTRIC CO	67,797	59.63	4,042,735.11
FASTENAL CO	63,681	41.34	2,632,572.54
FORTIVE CORP	33,605	66.01	2,218,266.05

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	14,546	59.30	862,577.80
GENERAL DYNAMICS CORP	27,251	146.45	3,990,908.95
GENERAL ELECTRIC CO	967,087	6.53	6,315,078.11
HD SUPPLY HOLDINGS INC	19,592	33.29	652,315.64
HEICO CORP	4,520	98.97	447,344.40
HEICO CORP-CLASS A	7,903	82.05	648,441.15
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	78,884	138.35	10,913,601.40
HOWMET AEROSPACE INC	40,938	14.62	598,513.56
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,873	167.22	814,863.06
IDEX CORP	8,293	148.76	1,233,666.68
ILLINOIS TOOL WORKS	35,252	169.03	5,958,645.56
INGERSOLL-RAND INC	39,321	27.50	1,081,327.50
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,703	82.88	1,218,584.64
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	24,600	41.66	1,024,836.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	23,100	21.96	507,276.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	84,468	33.29	2,811,939.72
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24,503	168.24	4,122,384.72
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,546	225.43	799,374.78
LOCKHEED MARTIN CORP	28,065	359.82	10,098,348.30
MASCO CORP	30,727	47.73	1,466,599.71
NORDSON CORP	6,495	184.69	1,199,561.55
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,627	301.91	5,321,767.57
OTIS WORLDWIDE CORP	45,415	55.54	2,522,349.10
OWENS CORNING	11,721	52.95	620,626.95
PACCAR INC	38,374	72.52	2,782,882.48
PARKER HANNIFIN CORP	14,262	173.72	2,477,594.64
PENTAIR PLC	17,292	36.29	627,526.68
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	167,720	61.72	10,351,678.40
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,922	205.03	2,649,397.66
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,757	386.93	4,549,136.01
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,056	35.17	564,689.52
SMITH (A.O.) CORP	14,381	45.11	648,726.91
SNAP-ON INC	5,594	130.82	731,807.08
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,118	131.09	2,243,998.62
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,106	307.65	1,263,210.90
TEXTRON INC	24,591	32.43	797,486.13
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,364	86.04	2,268,358.56
TRANSDIGM GROUP INC	5,662	433.90	2,456,741.80
UNITED RENTALS INC	7,877	142.43	1,121,921.11
WABTEC CORP	20,330	58.30	1,185,239.00
WW GRAINGER INC	5,045	294.79	1,487,215.55
XYLEM INC	19,937	62.45	1,245,065.65

CINTAS CORP	9,757	261.63	2,552,723.91
COPART INC	23,310	81.31	1,895,336.10
COSTAR GROUP INC	4,312	691.42	2,981,403.04
EQUIFAX INC	13,418	166.17	2,229,669.06
IHS MARKIT LTD	42,210	71.74	3,028,145.40
NIELSEN HOLDINGS PLC	40,926	14.13	578,284.38
REPUBLIC SERVICES INC	24,655	79.38	1,957,113.90
ROBERT HALF INTL INC	13,010	49.47	643,604.70
ROLLINS INC	15,543	41.10	638,817.30
TRANSUNION	20,876	84.62	1,766,527.12
VERISK ANALYTICS INC	17,168	163.69	2,810,229.92
WASTE CONNECTIONS INC	29,244	89.30	2,611,489.20
WASTE MANAGEMENT INC	46,950	101.37	4,759,321.50
AMERCO	901	294.34	265,200.34
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,264	78.54	1,120,294.56
CSX CORP	85,644	67.50	5,780,970.00
DELTA AIR LINES INC	17,365	27.34	474,759.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	18,454	73.62	1,358,583.48
FEDEX CORP	27,466	135.09	3,710,381.94
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9,802	117.04	1,147,226.08
KANSAS CITY SOUTHERN	10,566	142.58	1,506,500.28
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,834	41.56	533,381.04
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,555	169.15	4,830,078.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,505	163.34	1,715,886.70
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,232	32.25	491,232.00
UBER TECHNOLOGIES INC	105,216	30.46	3,204,879.36
UNION PACIFIC CORP	76,341	165.55	12,638,252.55
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	77,645	109.50	8,502,127.50
XPO LOGISTICS INC	10,923	75.51	824,795.73
APTIV PLC	29,682	74.62	2,214,870.84
AUTOLIV INC	8,580	62.88	539,510.40
BORGWARNER INC	22,366	33.18	742,103.88
FORD MOTOR CO	431,024	5.95	2,564,592.80
GENERAL MOTORS CO	142,122	25.28	3,592,844.16
LEAR CORP	6,934	107.21	743,394.14
TESLA INC	16,319	960.85	15,680,111.15
DR HORTON INC	38,501	54.09	2,082,519.09
GARMIN LTD	15,361	95.29	1,463,749.69
HASBRO INC	14,309	70.94	1,015,080.46
LENNAR CORP-A	30,418	59.04	1,795,878.72
LULULEMON ATHLETICA INC	13,698	295.22	4,043,923.56
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,344	99.29	729,185.76

NEWELL BRANDS INC	43,987	15.09	663,763.83
NIKE INC -CL B	137,307	100.08	13,741,684.56
NVR INC	381	3,186.84	1,214,186.04
PULTEGROUP INC	31,738	33.84	1,074,013.92
RALPH LAUREN CORP	5,268	70.65	372,184.20
VF CORP	37,124	59.03	2,191,429.72
WHIRLPOOL CORP	6,479	123.49	800,091.71
ARAMARK	26,004	22.68	589,770.72
CARNIVAL CORP	52,265	16.00	836,240.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,925	1,047.95	3,065,253.75
DARDEN RESTAURANTS INC	14,313	70.81	1,013,503.53
DOMINO'S PIZZA INC	4,252	375.48	1,596,540.96
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	30,813	73.19	2,255,203.47
LAS VEGAS SANDS CORP	38,079	44.94	1,711,270.26
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	30,621	85.00	2,602,785.00
MCDONALD'S CORP	82,451	184.29	15,194,894.79
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	21,705	15.84	343,807.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	50,663	16.93	857,724.59
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,022	48.24	917,621.28
STARBUCKS CORP	129,825	73.64	9,560,313.00
VAIL RESORTS INC	4,861	180.00	874,980.00
WYNN RESORTS LTD	10,693	75.21	804,220.53
YUM! BRANDS INC	33,315	86.56	2,883,746.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	85,017	75.58	6,425,584.86
ALPHABET INC-CL A	46,060	1,432.70	65,990,162.00
ALPHABET INC-CL C	21,055	1,431.97	30,150,128.35
ALTICE USA INC- A	39,800	23.55	937,290.00
CABLE ONE INC	541	1,753.15	948,454.15
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16,243	507.99	8,251,281.57
COMCAST CORP-CLASS A	502,436	38.56	19,373,932.16
DISCOVERY INC - A	13,916	21.71	302,185.94
DISCOVERY INC-C	39,779	19.68	782,850.72
DISH NETWORK CORP-A	26,666	34.41	917,577.06
ELECTRONIC ARTS INC	32,066	130.87	4,196,477.42
FACEBOOK INC-CLASS A	266,185	234.02	62,292,613.70
FOX CORP - CLASS A	36,914	27.38	1,010,705.32
FOX CORP - CLASS B	20,364	27.01	550,031.64
IAC/INTERACTIVECORP	8,748	302.00	2,641,896.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	39,684	16.44	652,404.96
LIBERTY BROADBAND-A	2,794	122.70	342,823.80
LIBERTY BROADBAND-C	11,838	123.99	1,467,793.62
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	9,306	34.32	319,381.92

LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	18,469	33.86	625,360.34
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,539	31.55	711,105.45
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	19,071	44.18	842,556.78
MATCH GROUP INC	5,376	98.02	526,955.52
NETFLIX INC	48,543	457.85	22,225,412.55
NEWS CORP - CLASS A	40,789	11.67	476,007.63
OMNICOM GROUP	24,044	52.45	1,261,107.80
PINTEREST INC- CLASS A	43,202	23.17	1,000,990.34
ROKU INC	10,395	123.35	1,282,223.25
SIRIUS XM HOLDINGS INC	131,106	5.78	757,792.68
SNAP INC - A	96,875	23.63	2,289,156.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,437	139.87	1,739,563.19
TWITTER INC	86,804	31.73	2,754,290.92
VIACOMCBS INC - CLASS B	62,239	23.58	1,467,595.62
WALT DISNEY CO/THE	199,715	112.07	22,382,060.05
ZILLOW GROUP INC - C	15,539	59.30	921,462.70
ADVANCE AUTO PARTS INC	7,660	143.00	1,095,380.00
AMAZON.COM INC	46,814	2,734.40	128,008,201.60
AUTOZONE INC	2,616	1,100.21	2,878,149.36
BEST BUY CO INC	25,827	83.82	2,164,819.14
BOOKING HOLDINGS INC	4,543	1,610.33	7,315,729.19
BURLINGTON STORES INC	7,305	203.61	1,487,371.05
CARMAX INC	18,166	89.45	1,624,948.70
DOLLAR GENERAL CORP	28,186	191.85	5,407,484.10
DOLLAR TREE INC	26,260	90.10	2,366,026.00
EBAY INC	88,110	48.77	4,297,124.70
EXPEDIA GROUP INC	14,543	81.24	1,181,473.32
GENUINE PARTS CO	16,210	84.67	1,372,500.70
HOME DEPOT INC	120,665	246.13	29,699,276.45
LKQ CORP	32,537	24.78	806,266.86
LOWE'S COS INC	84,797	131.98	11,191,508.06
MERCADOLIBRE INC	4,956	953.77	4,726,884.12
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,301	413.92	3,435,949.92
ROSS STORES INC	39,777	87.05	3,462,587.85
TARGET CORP	56,075	119.72	6,713,299.00
TIFFANY & CO	11,860	121.44	1,440,278.40
TJX COMPANIES INC	133,196	51.53	6,863,589.88
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,035	131.34	1,712,016.90
ULTA BEAUTY INC	6,041	200.00	1,208,200.00
WAYFAIR INC- CLASS A	6,907	200.71	1,386,303.97
COSTCO WHOLESALE CORP	48,872	298.02	14,564,833.44
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,900	4.60	211,140.00

KROGER CO	88,718	32.82	2,911,724.76
SYSCO CORP	53,494	54.88	2,935,750.72
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	83,437	41.17	3,435,101.29
WALMART INC	156,923	120.30	18,877,836.90
ALTRIA GROUP INC	205,591	39.43	8,106,453.13
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	61,861	39.32	2,432,374.52
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	34,216	63.81	2,183,322.96
BUNGE LTD	17,109	41.19	704,719.71
CAMPBELL SOUP CO	21,449	48.86	1,047,998.14
COCA-COLA CO/THE	450,790	44.65	20,127,773.50
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	22,468	37.77	848,616.36
CONAGRA BRANDS INC	53,686	33.79	1,814,049.94
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,556	171.66	3,185,322.96
GENERAL MILLS INC	67,015	60.29	4,040,334.35
HERSHEY CO/THE	16,439	127.98	2,103,863.22
HORMEL FOODS CORP	32,746	47.76	1,563,948.96
INGREDION INC	7,111	82.17	584,310.87
JM SMUCKER CO/THE	12,237	106.24	1,300,058.88
KELLOGG CO	28,462	64.88	1,846,614.56
KEURIG DR PEPPER INC	36,810	28.40	1,045,404.00
KRAFT HEINZ CO/THE	74,405	32.13	2,390,632.65
LAMB WESTON HOLDINGS INC	16,942	63.05	1,068,193.10
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,736	172.27	2,366,300.72
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	20,500	36.50	748,250.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	158,562	50.64	8,029,579.68
MONSTER BEVERAGE CORP	44,648	68.07	3,039,189.36
PEPSICO INC	153,672	129.56	19,909,744.32
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	172,073	70.09	12,060,596.57
TYSON FOODS INC-CL A	32,740	59.44	1,946,065.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,271	76.25	2,079,413.75
CLOROX COMPANY	13,850	212.03	2,936,615.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	89,748	72.03	6,464,548.44
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	24,594	187.75	4,617,523.50
KIMBERLY-CLARK CORP	37,791	137.91	5,211,756.81
PROCTER & GAMBLE CO/THE	273,163	116.42	31,801,636.46
ABBOTT LABORATORIES	195,097	87.30	17,031,968.10
ABIOMED INC	4,821	241.66	1,165,042.86
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,295	257.65	2,137,206.75
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,897	98.84	1,670,099.48
ANTHEM INC	27,939	257.31	7,188,984.09
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,486	82.47	4,658,400.42
BECTON DICKINSON AND CO	30,000	232.81	6,984,300.00

BOSTON SCIENTIFIC CORP	154,433	33.85	5,227,557.05
CARDINAL HEALTH INC	32,347	52.01	1,682,367.47
CENTENE CORP	65,102	61.88	4,028,511.76
CERNER CORP	34,653	68.65	2,378,928.45
CIGNA CORP	41,274	183.97	7,593,177.78
COOPER COS INC/THE	5,459	281.39	1,536,108.01
CVS HEALTH CORP	144,328	63.18	9,118,643.04
DANAHER CORP	69,315	171.46	11,884,749.90
DAVITA INC	10,182	77.18	785,846.76
DENTSPLY SIRONA INC	25,680	42.86	1,100,644.80
DEXCOM INC	10,138	394.30	3,997,413.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	69,391	67.49	4,683,198.59
HCA HEALTHCARE INC	30,006	93.73	2,812,462.38
HENRY SCHEIN INC	15,663	56.18	879,947.34
HOLOGIC INC	29,198	53.67	1,567,056.66
HUMANA INC	14,630	371.80	5,439,434.00
IDEXX LABORATORIES INC	9,437	319.38	3,013,989.06
INSULET CORP	6,857	192.11	1,317,298.27
INTUITIVE SURGICAL INC	12,829	554.96	7,119,581.84
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,799	157.09	1,696,414.91
MASIMO CORP	5,474	222.07	1,215,611.18
MCKESSON CORP	17,923	150.56	2,698,486.88
MEDTRONIC PLC	148,197	88.93	13,179,159.21
MOLINA HEALTHCARE INC	6,399	172.88	1,106,259.12
QUEST DIAGNOSTICS INC	14,829	104.55	1,550,371.95
RESMED INC	16,014	181.86	2,912,306.04
STERIS PLC	9,391	149.04	1,399,634.64
STRYKER CORP	37,271	176.30	6,570,877.30
TELADOC HEALTH INC	7,595	197.01	1,496,290.95
TELEFLEX INC	5,139	355.31	1,825,938.09
UNITEDHEALTH GROUP INC	104,969	289.18	30,354,935.42
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,579	89.30	766,104.70
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,075	115.41	1,162,755.75
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14,667	234.31	3,436,624.77
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,194	216.51	1,774,082.94
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,846	118.22	2,700,854.12
ABBVIE INC	195,379	95.14	18,588,358.06
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34,530	86.56	2,988,916.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	24,556	111.95	2,749,044.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,505	151.76	1,897,758.80
AMGEN INC	65,238	232.51	15,168,487.38
AVANTOR INC	51,253	16.91	866,688.23

BEIGENE LTD-ADR	4,162	186.15	774,756.30
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,502	432.42	1,081,914.84
BIOGEN INC	19,270	263.04	5,068,780.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,963	120.63	2,408,136.69
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	249,885	57.76	14,433,357.60
CATALENT INC	16,500	70.47	1,162,755.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	44,433	21.40	950,866.20
ELI LILLY & CO	95,275	157.03	14,961,033.25
EXACT SCIENCES CORP	16,444	82.56	1,357,616.64
GILEAD SCIENCES INC	139,834	75.93	10,617,595.62
ILLUMINA INC	16,287	358.94	5,846,055.78
INCYTE CORP	20,395	104.33	2,127,810.35
IONIS PHARMACEUTICALS INC	15,180	59.10	897,138.00
IQVIA HOLDINGS INC	21,415	136.47	2,922,505.05
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,176	109.03	673,369.28
JOHNSON & JOHNSON	291,479	139.82	40,754,593.78
MERCK & CO. INC.	280,717	75.87	21,297,998.79
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,671	784.04	2,094,170.84
MODERNA INC	30,140	64.84	1,954,277.60
MYLAN NV	54,778	16.02	877,543.56
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,757	125.36	1,223,137.52
PERKINELMER INC	11,949	95.97	1,146,745.53
PERRIGO CO PLC	14,301	53.95	771,538.95
PFIZER INC	612,559	32.19	19,718,274.21
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,168	605.04	6,757,086.72
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7,797	163.63	1,275,823.11
SEATTLE GENETICS INC	13,386	164.80	2,206,012.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	121,191	12.64	1,531,854.24
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	44,150	347.96	15,362,434.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,723	291.18	8,363,563.14
WATERS CORP	6,643	177.36	1,178,202.48
ZOETIS INC	52,584	134.30	7,062,031.20
BANK OF AMERICA CORP	868,844	23.81	20,687,175.64
CITIGROUP INC	232,945	50.81	11,835,935.45
CITIZENS FINANCIAL GROUP	47,066	24.08	1,133,349.28
COMERICA INC	15,052	37.45	563,697.40
EAST WEST BANCORP INC	16,395	35.05	574,644.75
FIFTH THIRD BANCORP	78,833	19.89	1,567,988.37
FIRST REPUBLIC BANK/CA	19,033	105.57	2,009,313.81
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,145	9.54	1,088,943.30
JPMORGAN CHASE & CO	339,976	94.66	32,182,128.16
KEYCORP	108,548	12.49	1,355,764.52

M & T BANK CORP	14,593	102.92	1,501,911.56
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	50,100	11.14	558,114.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	47,941	103.38	4,956,140.58
REGIONS FINANCIAL CORP	104,419	11.28	1,177,846.32
SIGNATURE BANK	5,429	101.29	549,903.41
SVB FINANCIAL GROUP	5,751	207.98	1,196,092.98
TRUIST FINANCIAL CORP	148,734	37.66	5,601,322.44
US BANCORP	151,626	36.87	5,590,450.62
WELLS FARGO & CO	430,668	26.12	11,249,048.16
ZIONS BANCORP NA	16,956	33.22	563,278.32
AGNC INVESTMENT CORP	58,318	12.82	747,636.76
ALLY FINANCIAL INC	41,566	18.31	761,073.46
AMERICAN EXPRESS CO	75,883	95.48	7,245,308.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,667	142.96	1,953,834.32
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	159,309	6.61	1,053,032.49
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,900	49.51	886,229.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	88,651	37.23	3,300,476.73
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	153,306	177.53	27,216,414.18
BLACKROCK INC	16,852	538.57	9,075,981.64
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	74,544	55.19	4,114,083.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	50,500	65.46	3,305,730.00
CARLYLE GROUP INC/THE	16,600	28.39	471,274.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,287	93.76	1,152,029.12
CME GROUP INC	39,654	167.47	6,640,855.38
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	34,107	50.81	1,732,976.67
E*TRADE FINANCIAL CORP	33,164	48.31	1,602,152.84
EQUITABLE HOLDINGS INC	45,959	18.81	864,488.79
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,196	297.21	1,247,093.16
FRANKLIN RESOURCES INC	33,923	20.82	706,276.86
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36,298	198.02	7,187,729.96
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	61,226	90.71	5,553,810.46
INVESCO LTD	42,877	10.72	459,641.44
KKR & CO INC	55,728	30.31	1,689,115.68
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,204	505.19	2,123,818.76
MOODY'S CORP	18,654	265.53	4,953,196.62
MORGAN STANLEY	132,554	46.95	6,223,410.30
MSCI INC	9,392	328.36	3,083,957.12
NASDAQ INC	12,754	115.28	1,470,281.12
NORTHERN TRUST CORP	22,049	77.18	1,701,741.82
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,818	68.41	945,289.38
S&P GLOBAL INC	26,947	317.97	8,568,337.59
SCHWAB (CHARLES) CORP	128,131	33.80	4,330,827.80

SEI INVESTMENTS COMPANY	15,024	53.30	800,779.20
STATE STREET CORP	39,227	61.63	2,417,560.01
SYNCHRONY FINANCIAL	61,090	22.09	1,349,478.10
T ROWE PRICE GROUP INC	26,139	121.04	3,163,864.56
TD AMERITRADE HOLDING CORP	30,044	36.48	1,096,005.12
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,686	60.85	589,393.10
VOYA FINANCIAL INC	14,125	45.33	640,286.25
AFLAC INC	75,957	35.17	2,671,407.69
ALLEGHANY CORP	1,594	467.08	744,525.52
ALLSTATE CORP	35,034	92.95	3,256,410.30
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,675	60.34	523,449.50
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	96,614	30.30	2,927,404.20
AON PLC-CLASS A	25,612	187.53	4,803,018.36
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,012	28.45	1,280,591.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,851	94.78	1,976,257.78
ASSURANT INC	7,109	100.68	715,734.12
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	17,062	31.01	529,092.62
BROWN & BROWN INC	26,416	40.05	1,057,960.80
CHUBB LTD	49,971	126.17	6,304,841.07
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,189	62.01	1,065,889.89
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,491	183.41	456,874.31
EVEREST RE GROUP LTD	4,537	206.00	934,622.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	32,377	30.37	983,289.49
GLOBE LIFE INC	11,395	71.19	811,210.05
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,672	37.86	1,501,981.92
LINCOLN NATIONAL CORP	21,525	36.04	775,761.00
LOEWS CORP	30,087	33.17	997,985.79
MARKEL CORP	1,532	895.15	1,371,369.80
MARSH & MCLENNAN COS	55,728	103.93	5,791,811.04
METLIFE INC	85,971	35.53	3,054,549.63
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	30,428	39.54	1,203,123.12
PROGRESSIVE CORP	64,755	77.29	5,004,913.95
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	43,924	59.70	2,622,262.80
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	7,809	76.63	598,403.67
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,351	172.22	921,549.22
TRAVELERS COS INC/THE	28,207	112.86	3,183,442.02
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,260	190.85	2,721,521.00
WR BERKLEY CORP	15,903	55.74	886,433.22
CBRE GROUP INC - A	36,795	42.75	1,572,986.25
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	123,100	4.13	508,403.00
JONES LANG LASALLE INC	6,176	100.76	622,293.76
ACCENTURE PLC-CL A	70,219	201.84	14,173,002.96

ADOBE INC	53,346	431.68	23,028,401.28
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	18,009	100.97	1,818,368.73
ANSYS INC	9,533	285.25	2,719,288.25
AUTODESK INC	24,347	233.44	5,683,563.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	47,774	144.84	6,919,586.16
AVALARA INC	8,809	131.13	1,155,124.17
BLACK KNIGHT INC	16,202	71.07	1,151,476.14
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15,141	77.20	1,168,885.20
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	12,522	122.70	1,536,449.40
CADENCE DESIGN SYS INC	31,097	91.99	2,860,613.03
CDK GLOBAL INC	13,633	39.89	543,820.37
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12,879	105.02	1,352,552.58
CITRIX SYSTEMS INC	12,844	142.17	1,826,031.48
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	60,760	53.80	3,268,888.00
COUPA SOFTWARE INC	7,346	257.91	1,894,606.86
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,895	103.70	1,129,811.50
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,822	96.75	369,778.50
DATADOG INC - CLASS A	12,513	88.50	1,107,400.50
DOCUSIGN INC	18,895	163.91	3,097,079.45
DROPBOX INC-CLASS A	26,831	22.64	607,453.84
DYNATRACE INC	15,534	42.34	657,709.56
EPAM SYSTEMS INC	6,152	247.50	1,522,620.00
FAIR ISAAC CORP	3,141	409.06	1,284,857.46
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	68,236	132.30	9,027,622.80
FISERV INC	64,003	96.61	6,183,329.83
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9,464	246.39	2,331,834.96
FORTINET INC	16,260	134.33	2,184,205.80
GARTNER INC	9,943	115.66	1,150,007.38
GLOBAL PAYMENTS INC	33,203	166.91	5,541,912.73
GODADDY INC - CLASS A	19,332	75.59	1,461,305.88
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,877	106.81	1,054,962.37
INTL BUSINESS MACHINES CORP	98,221	116.42	11,434,888.82
INTUIT INC	28,819	286.13	8,245,980.47
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,300	179.69	1,491,427.00
LEIDOS HOLDINGS INC	14,969	93.25	1,395,859.25
MASTERCARD INC - A	98,984	294.01	29,102,285.84
MICROSOFT CORP	799,398	197.84	158,152,900.32
MONGODB INC	4,869	217.84	1,060,662.96
NORTONLIFELOCK INC	63,188	19.74	1,247,331.12
OKTA INC	12,594	195.82	2,466,157.08
ORACLE CORP	248,300	54.44	13,517,452.00
PALO ALTO NETWORKS INC	11,061	223.40	2,471,027.40

PAYCHEX INC	35,778	71.46	2,556,695.88
PAYCOM SOFTWARE INC	5,557	312.57	1,736,951.49
PAYPAL HOLDINGS INC	123,297	168.00	20,713,896.00
PTC INC	12,907	76.92	992,806.44
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,059	267.58	2,156,427.22
SALESFORCE.COM INC	93,259	185.55	17,304,207.45
SERVICENOW INC	21,013	392.93	8,256,638.09
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	32,203	31.97	1,029,529.91
SPLUNK INC	17,284	190.61	3,294,503.24
SQUARE INC - A	39,311	100.88	3,965,693.68
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25,624	55.49	1,421,875.76
SYNOPSYS INC	16,672	189.20	3,154,342.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	4,474	396.37	1,773,359.38
TWILIO INC - A	13,147	212.17	2,789,398.99
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,388	338.47	1,485,206.36
VERISIGN INC	11,630	202.73	2,357,749.90
VISA INC-CLASS A SHARES	188,724	191.41	36,123,660.84
VMWARE INC-CLASS A	9,063	152.73	1,384,191.99
WESTERN UNION CO	45,586	20.95	955,026.70
WIX.COM LTD	5,418	241.28	1,307,255.04
WORKDAY INC-CLASS A	18,527	180.07	3,336,156.89
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,971	255.90	3,063,378.90
AMPHENOL CORP-CL A	33,180	94.61	3,139,159.80
APPLE INC	484,116	360.06	174,310,806.96
ARISTA NETWORKS INC	6,143	209.25	1,285,422.75
ARROW ELECTRONICS INC	8,551	64.81	554,190.31
CDW CORP/DE	15,886	111.49	1,771,130.14
CISCO SYSTEMS INC	469,395	44.75	21,005,426.25
COGNEX CORP	18,701	57.89	1,082,600.89
CORNING INC	84,678	25.81	2,185,539.18
DELL TECHNOLOGIES -C	25,732	53.10	1,366,369.20
F5 NETWORKS INC	6,713	135.01	906,322.13
FLIR SYSTEMS INC	15,771	38.94	614,122.74
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	139,430	9.27	1,292,516.10
HP INC	158,902	16.20	2,574,212.40
IPG PHOTONICS CORP	3,916	157.21	615,634.36
JUNIPER NETWORKS INC	36,520	22.38	817,317.60
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20,963	101.23	2,122,084.49
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,943	139.30	2,638,759.90
NETAPP INC	23,155	40.97	948,660.35
SEAGATE TECHNOLOGY	25,795	47.62	1,228,357.90
TE CONNECTIVITY LTD	37,112	78.07	2,897,333.84

TRIMBLE INC	27,774	42.67	1,185,116.58
WESTERN DIGITAL CORP	33,281	42.25	1,406,122.25
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6,019	250.50	1,507,759.50
AT&T INC	793,287	29.42	23,338,503.54
CENTURYLINK INC	107,816	9.74	1,050,127.84
LIBERTY GLOBAL PLC- C	43,975	21.43	942,384.25
LIBERTY GLOBAL PLC-A	20,125	22.01	442,951.25
T-MOBILE US INC	47,535	108.43	5,154,220.05
T-MOBILE US INC - RIGHTS	47,535	0.37	17,587.95
VERIZON COMMUNICATIONS INC	457,189	53.93	24,656,202.77
AES CORP	73,988	13.84	1,023,993.92
ALLIANT ENERGY CORP	27,248	47.12	1,283,925.76
AMEREN CORPORATION	27,283	69.46	1,895,077.18
AMERICAN ELECTRIC POWER	54,586	80.71	4,405,636.06
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,027	124.40	2,491,358.80
ATMOS ENERGY CORP	13,053	98.96	1,291,724.88
CENTERPOINT ENERGY INC	57,809	18.33	1,059,638.97
CMS ENERGY CORP	31,456	57.40	1,805,574.40
CONSOLIDATED EDISON INC	36,952	71.53	2,643,176.56
DOMINION ENERGY INC	92,651	82.58	7,651,119.58
DTE ENERGY COMPANY	21,305	105.27	2,242,777.35
DUKE ENERGY CORP	80,964	80.47	6,515,173.08
EDISON INTERNATIONAL	40,127	54.37	2,181,704.99
ENTERGY CORP	22,147	93.51	2,070,965.97
ESSENTIAL UTILITIES INC	23,727	41.43	983,009.61
EVERGY INC	25,160	59.04	1,485,446.40
EVERSOURCE ENERGY	36,514	82.42	3,009,483.88
EXELON CORP	107,805	36.47	3,931,648.35
FIRSTENERGY CORP	59,951	37.78	2,264,948.78
NEXTERA ENERGY INC	54,054	241.67	13,063,230.18
NISOURCE INC	40,974	22.40	917,817.60
NRG ENERGY INC	26,152	32.57	851,770.64
OGE ENERGY CORP	24,702	30.34	749,458.68
PINNACLE WEST CAPITAL	12,778	71.62	915,160.36
PPL CORP	84,952	25.52	2,167,975.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55,919	48.16	2,693,059.04
SEMPRA ENERGY	32,331	120.04	3,881,013.24
SOUTHERN CO/THE	116,433	52.38	6,098,760.54
UGI CORP	23,063	30.82	710,801.66
VISTRA ENERGY CORP	52,196	18.61	971,367.56
WEC ENERGY GROUP INC	34,915	86.79	3,030,272.85
XCEL ENERGY INC	58,037	63.68	3,695,796.16

	ADVANCED MICRO DEVICES	129,462	52.39	6,782,514.18	
	ANALOG DEVICES INC	40,811	119.47	4,875,690.17	
	APPLIED MATERIALS INC	101,702	59.97	6,099,068.94	
	BROADCOM INC	44,200	306.97	13,568,074.00	
	INTEL CORP	473,171	59.09	27,959,674.39	
	KLA CORP	17,384	188.62	3,278,970.08	
	LAM RESEARCH CORP	16,133	305.78	4,933,148.74	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	74,380	33.63	2,501,399.40	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	29,361	59.91	1,759,017.51	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,569	101.08	2,685,594.52	
	MICRON TECHNOLOGY INC	123,079	48.29	5,943,484.91	
	NVIDIA CORP	67,715	369.42	25,015,275.30	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	30,916	113.06	3,495,362.96	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	45,431	19.29	876,363.99	
	QORVO INC	12,862	108.52	1,395,784.24	
	QUALCOMM INC	126,432	89.14	11,270,148.48	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,862	126.41	2,384,345.42	
	TERADYNE INC	18,691	81.36	1,520,699.76	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	103,289	123.99	12,806,803.11	
	XILINX INC	27,595	92.89	2,563,299.55	
	アメリカドル 小計	32,867,208		2,903,369,463.81 (310,834,734,795)	
カナダドル	CAMECO CORP	38,400	13.20	506,880.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	131,500	23.42	3,079,730.00	
	CENOVUS ENERGY INC	105,800	6.22	658,076.00	
	ENBRIDGE INC	224,100	40.99	9,185,859.00	
	IMPERIAL OIL LTD	28,300	21.49	608,167.00	
	INTER PIPELINE LTD	47,200	12.30	580,560.00	
	KEYERA CORP	23,600	20.58	485,688.00	
	PARKLAND CORP	15,800	33.38	527,404.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	59,832	32.66	1,954,113.12	
	SUNCOR ENERGY INC	170,200	22.75	3,872,050.00	
	TC ENERGY CORP	104,000	58.75	6,110,000.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	26,100	83.85	2,188,485.00	
	B2GOLD CORP	125,100	7.28	910,728.00	
	BARRICK GOLD CORP	195,300	35.05	6,845,265.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	18,800	44.50	836,600.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	75,600	9.67	731,052.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	20,700	183.58	3,800,106.00	
	KINROSS GOLD CORP	136,000	9.13	1,241,680.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	28,500	52.33	1,491,405.00	
	LUNDIN MINING CORP	62,100	6.75	419,175.00	

NUTRIEN LTD	63,259	45.71	2,891,568.89
PAN AMERICAN SILVER CORP	25,000	37.86	946,500.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	53,700	13.92	747,504.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	48,600	56.58	2,749,788.00
YAMANA GOLD INC	114,800	6.99	802,452.00
CAE INC	28,400	21.73	617,132.00
WSP GLOBAL INC	11,800	81.85	965,830.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13,100	55.20	723,120.00
THOMSON REUTERS CORP	19,332	90.93	1,757,858.76
AIR CANADA	12,400	17.19	213,156.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	78,900	116.47	9,189,483.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	15,200	334.62	5,086,224.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,100	58.80	1,887,480.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	22,200	20.82	462,204.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	31,210	74.07	2,311,724.70
QUEBECOR INC -CL B	18,300	28.99	530,517.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	54,700	22.31	1,220,357.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,800	117.95	684,110.00
DOLLARAMA INC	34,700	45.39	1,575,033.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	96,200	42.36	4,075,032.00
EMPIRE CO LTD 'A'	17,200	32.29	555,388.00
LOBLAW COMPANIES LTD	21,500	66.13	1,421,795.00
METRO INC/CN	27,700	55.69	1,542,613.00
WESTON (GEORGE) LTD	8,411	97.40	819,231.40
SAPUTO INC	27,600	32.46	895,896.00
BAUSCH HEALTH COS INC	37,600	25.27	950,152.00
CANOPY GROWTH CORP	21,700	22.77	494,109.00
CRONOS GROUP INC	25,600	8.74	223,744.00
BANK OF MONTREAL	71,000	73.95	5,250,450.00
BANK OF NOVA SCOTIA	134,300	55.64	7,472,452.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,400	92.64	4,576,416.00
NATIONAL BANK OF CANADA	37,400	61.98	2,318,052.00
ROYAL BANK OF CANADA	157,400	91.71	14,435,154.00
TORONTO-DOMINION BANK	200,300	60.29	12,076,087.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	148,050	44.72	6,620,796.00
CI FINANCIAL CORP	21,000	16.92	355,320.00
IGM FINANCIAL INC	8,800	32.41	285,208.00
ONEX CORPORATION	9,400	58.79	552,626.00
TMX GROUP LTD	6,700	129.52	867,784.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,000	421.17	1,263,510.00
GREAT-WEST LIFECO INC	30,400	24.16	734,464.00
IA FINANCIAL CORP INC	11,700	45.88	536,796.00

	INTACT FINANCIAL CORP	15,800	130.13	2,056,054.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	215,100	18.20	3,914,820.00	
	POWER CORP OF CANADA	62,600	24.83	1,554,358.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	65,000	48.82	3,173,300.00	
	BLACKBERRY LTD	52,200	6.69	349,218.00	
	CGI INC	26,800	84.25	2,257,900.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,200	1,500.00	3,300,000.00	
	OPEN TEXT CORP	30,300	57.85	1,752,855.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	11,600	1,220.97	14,163,252.00	
	BCE INC	17,700	56.52	1,000,404.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	39,000	55.28	2,155,920.00	
	TELUS CORP	50,100	22.83	1,143,783.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	54,800	17.96	984,208.00	
	ALTAGAS LTD	28,700	15.63	448,581.00	
	ATCO LTD -CLASS I	10,400	39.14	407,056.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	13,400	32.49	435,366.00	
	EMERA INC	26,400	52.84	1,394,976.00	
	FORTIS INC	51,400	51.04	2,623,456.00	
	HYDRO ONE LTD	36,100	25.57	923,077.00	
	カナダドル 小計	4,302,394		193,756,724.87 (15,225,403,440)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	28,939	28.50	824,761.50	
	OIL SEARCH LTD	220,605	3.29	725,790.45	
	ORIGIN ENERGY LTD	181,897	6.00	1,091,382.00	
	SANTOS LTD	184,286	5.36	987,772.96	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,472	19.62	342,800.64	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	106,087	21.58	2,289,357.46	
	BHP GROUP LTD	325,647	35.90	11,690,727.30	
	BLUESCOPE STEEL LTD	52,559	11.63	611,261.17	
	EVOLUTION MINING LTD	192,818	5.61	1,081,708.98	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	187,082	14.24	2,664,047.68	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	46,413	27.60	1,280,998.80	
	NEWCREST MINING LTD	88,999	31.56	2,808,808.44	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	87,919	14.10	1,239,657.90	
	ORICA LTD	42,434	16.72	709,496.48	
	RIO TINTO LTD	40,987	98.68	4,044,597.16	
	SOUTH32 LTD	583,896	2.05	1,196,986.80	
	CIMIC GROUP LTD	14,688	24.28	356,624.64	
	BRAMBLES LTD	171,486	10.76	1,845,189.36	
	AURIZON HOLDINGS LTD	221,393	4.82	1,067,114.26	
	QANTAS AIRWAYS LTD	76,723	4.19	321,469.37	
	SYDNEY AIRPORT	126,628	5.82	736,974.96	

	TRANSURBAN GROUP	302,975	14.30	4,332,542.50	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	67,759	26.19	1,774,608.21	
	CROWN RESORTS LTD	38,274	9.89	378,529.86	
	TABCORP HOLDINGS LTD	209,211	3.46	723,870.06	
	REA GROUP LTD	5,181	107.00	554,367.00	
	SEEK LTD	35,923	21.81	783,480.63	
	WESFARMERS LTD	125,614	43.89	5,513,198.46	
	COLES GROUP LTD	148,017	16.60	2,457,082.20	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	139,702	36.12	5,046,036.24	
	COCA-COLA AMATIL LTD	51,988	8.98	466,852.24	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,600	10.85	863,660.00	
	COCHLEAR LTD	7,156	193.18	1,382,396.08	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,946	67.06	1,270,518.76	
	SONIC HEALTHCARE LTD	47,805	30.33	1,449,925.65	
	CSL LTD	50,213	292.36	14,680,272.68	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	314,070	18.83	5,913,938.10	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	195,750	69.24	13,553,730.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	354,059	18.55	6,567,794.45	
	WESTPAC BANKING CORP	399,948	18.06	7,223,060.88	
	AMP LTD	432,472	1.85	800,073.20	
	ASX LTD	20,986	85.01	1,784,019.86	
	MACQUARIE GROUP LTD	37,336	121.59	4,539,684.24	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	13,707	58.08	796,102.56	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	253,310	5.88	1,489,462.80	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	290,951	3.06	890,310.06	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	161,295	8.86	1,429,073.70	
	SUNCORP GROUP LTD	138,978	9.62	1,336,968.36	
	LENDLEASE GROUP	80,199	12.92	1,036,171.08	
	AFTERPAY LTD	25,400	59.38	1,508,252.00	
	COMPUTERSHARE LTD	50,087	13.33	667,659.71	
	WISETECH GLOBAL LTD	11,584	22.11	256,122.24	
	TELSTRA CORP LTD	457,264	3.16	1,444,954.24	
	TPG TELECOM LTD	34,115	9.02	307,717.30	
	AGL ENERGY LTD	73,209	17.19	1,258,462.71	
	APA GROUP	130,000	11.74	1,526,200.00	
	AUSNET SERVICES	190,003	1.72	326,805.16	
	オーストラリアドル 小計	7,992,045		134,251,431.53 (9,875,535,303)	
イギリスポンド	BP PLC	2,241,723	3.07	6,889,935.64	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	456,296	13.24	6,045,009.40	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	411,403	12.68	5,216,590.04	
	ANGLO AMERICAN PLC	135,257	18.28	2,472,497.96	

ANTOFAGASTA PLC	39,469	9.05	357,273.38
BHP GROUP PLC	233,416	16.22	3,786,941.18
CRODA INTERNATIONAL PLC	14,607	51.24	748,462.68
EVRAZ PLC	56,606	2.98	169,025.51
GLENCORE PLC	1,101,388	1.66	1,835,793.51
JOHNSON MATTHEY PLC	23,710	20.75	491,982.50
MONDI PLC	52,780	15.05	794,339.00
RIO TINTO PLC	123,830	44.95	5,566,158.50
ASHTED GROUP PLC	49,475	26.80	1,325,930.00
BAE SYSTEMS PLC	354,749	4.79	1,701,376.20
BUNZL PLC	39,884	20.62	822,408.08
DCC PLC	11,203	67.56	756,874.68
FERGUSON PLC	24,942	63.46	1,582,819.32
MELROSE INDUSTRIES PLC	565,432	1.14	648,833.22
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	213,636	3.00	641,335.27
SMITHS GROUP PLC	47,981	12.45	597,603.35
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,618	97.30	838,531.40
EXPERIAN PLC	100,294	28.06	2,814,249.64
INTERTEK GROUP PLC	18,273	53.84	983,818.32
RELX PLC	213,454	18.58	3,967,042.59
RENTOKIL INITIAL PLC	215,505	4.91	1,059,853.59
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	111,911	4.92	551,385.49
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	13,870	43.46	602,790.20
BURBERRY GROUP PLC	43,565	15.07	656,742.37
PERSIMMON PLC	34,819	22.59	786,561.21
TAYLOR WIMPEY PLC	418,238	1.42	595,152.67
COMPASS GROUP PLC	197,479	11.13	2,197,941.27
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,970	111.20	663,864.00
GVC HOLDINGS PLC	62,983	7.68	483,835.40
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	18,865	36.47	688,006.55
WHITBREAD PLC	17,823	22.04	392,818.92
AUTO TRADER GROUP PLC	100,945	5.25	530,768.81
INFORMA PLC	158,442	4.63	734,695.55
ITV PLC	385,089	0.74	285,736.03
PEARSON PLC	86,984	5.58	485,370.72
WPP PLC	143,982	6.25	900,751.39
JD SPORTS FASHION PLC	45,700	6.12	279,684.00
KINGFISHER PLC	231,025	2.13	492,314.27
NEXT PLC	15,223	49.00	745,927.00
OCADO GROUP PLC	49,758	19.87	988,691.46
SAINSBURY (J) PLC	185,058	2.05	379,924.07
TESCO PLC	1,083,761	2.27	2,463,388.75

	WM MORRISON SUPERMARKETS	263,276	1.90	502,725.52	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	40,366	18.85	760,899.10	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	253,733	30.55	7,751,543.15	
	COCA-COLA HBC AG-DI	22,214	20.72	460,274.08	
	DIAGEO PLC	258,300	27.03	6,981,849.00	
	IMPERIAL BRANDS PLC	104,736	15.20	1,592,510.88	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	78,502	71.28	5,595,622.56	
	UNILEVER PLC	129,106	44.80	5,783,948.80	
	SMITH & NEPHEW PLC	96,649	14.90	1,440,070.10	
	ASTRAZENECA PLC	145,200	83.44	12,115,488.00	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	554,959	16.34	9,071,359.81	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,313	23.00	398,199.00	
	BARCLAYS PLC	1,915,391	1.11	2,142,556.37	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,246,649	3.80	8,555,239.39	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,772,549	0.31	2,456,902.73	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	577,894	1.19	691,739.11	
	STANDARD CHARTERED PLC	300,113	4.20	1,262,575.39	
	3I GROUP PLC	112,735	7.88	888,351.80	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	37,749	16.17	610,590.07	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	34,805	80.14	2,789,272.70	
	M&G PLC	312,047	1.59	497,870.98	
	SCHRODERS PLC	13,260	28.62	379,501.20	
	ST JAMES'S PLACE PLC	60,295	9.25	558,211.11	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	253,774	2.54	646,362.37	
	ADMIRAL GROUP PLC	20,702	23.05	477,181.10	
	AVIVA PLC	431,668	2.69	1,161,618.58	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	152,128	2.68	408,007.29	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	658,823	2.13	1,404,610.63	
	PRUDENTIAL PLC	287,400	11.78	3,385,572.00	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	116,152	4.13	479,940.06	
	AVEVA GROUP PLC	6,135	40.99	251,473.65	
	SAGE GROUP PLC/THE	117,215	6.70	786,043.79	
	HALMA PLC	40,999	22.43	919,607.57	
	BT GROUP PLC	982,218	1.16	1,143,301.75	
	VODAFONE GROUP PLC	2,955,650	1.25	3,695,744.76	
	NATIONAL GRID PLC	387,080	9.60	3,719,064.64	
	SEVERN TRENT PLC	26,963	24.90	671,378.70	
	SSE PLC	113,590	13.57	1,541,416.30	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	80,912	9.55	772,871.42	
	イギリスポンド 小計	32,144,671		162,772,530.55 (21,655,257,464)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	20,025	18.07	361,851.75	

	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	891	719.00	640,629.00	
	GIVAUDAN-REG	1,025	3,386.00	3,470,650.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	58,022	40.31	2,338,866.82	
	SIKA AG-REG	15,753	181.05	2,852,080.65	
	ABB LTD-REG	204,339	20.81	4,252,294.59	
	GEBERIT AG-REG	4,115	466.30	1,918,824.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,238	221.00	494,598.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,544	222.70	1,011,948.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,283	43.80	800,795.40	
	SGS SA-REG	672	2,271.00	1,526,112.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6,079	157.30	956,226.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	57,814	60.86	3,518,560.04	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	3,350	187.20	627,120.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	6,832	36.60	250,051.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	331	1,826.00	604,406.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	114	7,640.00	870,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	11	80,500.00	885,500.00	
	NESTLE SA-REG	329,283	104.78	34,502,272.74	
	ALCON INC	54,485	54.68	2,979,239.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	6,125	188.90	1,157,012.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,117	757.80	846,462.60	
	LONZA GROUP AG-REG	8,286	492.00	4,076,712.00	
	NOVARTIS AG-REG	237,885	84.41	20,079,872.85	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	77,764	332.20	25,833,200.80	
	VIFOR PHARMA AG	4,879	149.05	727,214.95	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,582	91.50	327,753.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	269,457	9.49	2,558,224.75	
	JULIUS BAER GROUP LTD	24,273	39.78	965,579.94	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,892	71.10	276,721.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,065	838.00	1,730,470.00	
	UBS GROUP AG-REG	405,528	10.45	4,237,767.60	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,758	140.40	668,023.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,563	345.20	1,229,947.60	
	SWISS RE AG	32,555	72.02	2,344,611.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,537	327.50	5,415,867.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,995	88.15	704,759.25	
	TEMENOS AG - REG	7,007	140.30	983,082.10	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17,242	59.22	1,021,071.24	
	SWISSCOM AG-REG	2,817	492.50	1,387,372.50	
	スイスフラン 小計	1,925,533		141,434,714.67 (15,970,807,980)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	300,868	50.65	15,238,964.20	

	NWS HOLDINGS LTD	214,500	6.68	1,432,860.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	153,000	75.80	11,597,400.00	
	MTR CORP	178,500	40.40	7,211,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	241,000	53.15	12,809,150.00	
	SANDS CHINA LTD	272,800	31.35	8,552,280.00	
	SJM HOLDINGS LTD	210,000	8.90	1,869,000.00	
	WYNN MACAU LTD	205,600	13.84	2,845,504.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	205,300	22.70	4,660,310.00	
	WH GROUP LTD	1,037,000	6.81	7,061,970.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	129,420	17.74	2,295,910.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	407,500	24.50	9,983,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	84,500	134.40	11,356,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	132,800	317.80	42,203,840.00	
	AIA GROUP LTD	1,338,400	75.60	101,183,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	286,368	47.95	13,731,345.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	214,000	18.30	3,916,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	162,641	30.00	4,879,230.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	92,500	20.20	1,868,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	192,250	38.45	7,392,012.50	
	SINO LAND CO	317,400	9.71	3,081,954.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	144,000	100.40	14,457,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	52,000	43.50	2,262,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	110,600	19.52	2,158,912.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	135,000	37.90	5,116,500.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	96,000	61.30	5,884,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	395,000	11.28	4,455,600.00	
	PCCW LTD	446,000	4.53	2,020,380.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	70,000	41.45	2,901,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	183,000	76.80	14,054,400.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	300,000	8.08	2,424,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,189,808	12.10	14,396,676.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	164,000	43.40	7,117,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	30,500	84.70	2,583,350.00	
	香港ドル 小計	9,692,255		355,004,739.90 (4,902,615,458)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	167,100	6.04	1,009,284.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	169,300	3.37	570,541.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	321,300	0.95	305,235.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	161,040	3.90	628,056.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	820,900	0.76	627,988.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,500	20.88	281,880.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	199,700	4.09	816,773.00	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	197,500	21.10	4,167,250.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	362,600	9.04	3,277,904.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,200	20.63	2,665,396.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,100	8.10	705,510.00	
	CAPITALAND LTD	302,200	2.90	876,380.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,300	8.59	363,357.00	
	UOL GROUP LTD	44,000	7.00	308,000.00	
	VENTURE CORP LTD	28,400	16.34	464,056.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	896,260	2.53	2,267,537.80	
	シンガポールドル 小計	3,942,400		19,335,148.30 (1,487,066,255)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	146,555	6.37	933,555.35	
	A2 MILK CO LTD	80,335	19.40	1,558,499.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	62,835	31.05	1,951,026.75	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	37,789	13.39	505,994.71	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	226,021	4.57	1,032,915.97	
	MERCURY NZ LTD	67,670	4.72	319,402.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	164,842	4.88	805,253.17	
	ニュージーランドドル 小計	786,047		7,106,647.35 (488,226,672)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN ENERGY AB	21,146	226.10	4,781,110.60	
	BOLIDEN AB	30,803	204.90	6,311,534.70	
	SVENSKA CELLULOOSA AB SCA-B	72,147	112.50	8,116,537.50	
	ALFA LAVAL AB	33,952	199.35	6,768,331.20	
	ASSA ABLOY AB-B	110,346	193.40	21,340,916.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	74,336	392.30	29,162,012.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,852	342.50	14,676,810.00	
	EPIROC AB-A	79,343	116.70	9,259,328.10	
	EPIROC AB-B	36,804	114.50	4,214,058.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	18,200	166.50	3,030,300.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	37,134	203.50	7,556,769.00	
	SANDVIK AB	124,632	161.65	20,146,762.80	
	SKANSKA AB-B SHS	39,585	180.10	7,129,258.50	
	SKF AB-B SHARES	44,526	167.90	7,475,915.40	
	VOLVO AB-B SHS	164,005	143.65	23,559,318.25	
	SECURITAS AB-B SHS	32,349	122.80	3,972,457.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	23,799	154.00	3,665,046.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	42,231	74.82	3,159,723.42	
	EVOLUTION GAMING GROUP	15,100	576.00	8,697,600.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	88,823	141.85	12,599,542.55	
	ICA GRUPPEN AB	12,550	441.80	5,544,590.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,495	635.60	11,755,422.00	

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	66,842	292.90	19,578,021.80	
	NORDEA BANK ABP	355,934	65.06	23,157,066.04	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	178,690	79.02	14,120,083.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	171,237	89.20	15,274,340.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	99,769	118.88	11,860,538.72	
	EQT AB	28,400	156.65	4,448,860.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,499	208.30	3,228,441.70	
	INVESTOR AB-B SHS	49,894	482.30	24,063,876.20	
	KINNEVIK AB - B	25,532	239.30	6,109,807.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,279	416.00	3,028,064.00	
	ERICSSON LM-B SHS	323,258	84.20	27,218,323.60	
	HEXAGON AB-B SHS	31,035	530.00	16,448,550.00	
	TELE2 AB-B SHS	57,289	120.80	6,920,511.20	
	TELIA CO AB	273,487	34.44	9,418,892.28	
	スウェーデンクローネ 小計	2,847,303		407,798,721.76 (4,665,217,376)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	110,894	140.05	15,530,704.70	
	NORSK HYDRO ASA	134,189	27.16	3,644,573.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,588	352.30	6,900,852.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,712	226.20	2,196,854.40	
	MOWI ASA	53,156	178.00	9,461,768.00	
	ORKLA ASA	81,436	83.72	6,817,821.92	
	DNB ASA	104,752	130.00	13,617,760.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,100	175.80	3,885,180.00	
	TELENOR ASA	78,100	144.50	11,285,450.00	
	ノルウェークローネ 小計	613,927		73,340,964.66 (812,617,888)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	11,682	687.60	8,032,543.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	23,534	378.20	8,900,558.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	22,081	674.00	14,882,594.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	332	7,095.00	2,355,540.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	749	7,604.00	5,695,396.00	
	DSV PANALPINA A/S	23,456	803.60	18,849,241.60	
	PANDORA A/S	10,573	370.20	3,914,124.60	
	CARLSBERG AS-B	11,727	875.00	10,261,125.00	
	AMBU A/S-B	19,383	216.30	4,192,542.90	
	COLOPLAST-B	13,146	1,038.00	13,645,548.00	
	DEMANT A/S	11,895	184.00	2,188,680.00	
	GN STORE NORD A/S	15,298	361.90	5,536,346.20	
	GENMAB A/S	7,226	2,182.00	15,767,132.00	
	H LUNDBECK A/S	6,115	250.80	1,533,642.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	195,827	443.05	86,761,152.35	

	DANSKE BANK A/S	72,428	88.92	6,440,297.76	
	TRYG A/S	14,757	185.40	2,735,947.80	
	ORSTED A/S	20,956	761.80	15,964,280.80	
デンマーククローネ 小計		481,165		227,656,693.01 (3,681,208,725)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	96,941	10.65	1,032,421.65	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,261	477.60	1,557,453.60	
	BANK HAPOLIM BM	122,994	20.18	2,482,018.92	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	159,641	17.66	2,819,260.06	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	124,481	10.61	1,320,743.41	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	14,019	67.94	952,450.86	
	AZRIELI GROUP LTD	5,293	160.00	846,880.00	
	NICE LTD	6,902	668.40	4,613,296.80	
イスラエルシェケル 小計		533,532		15,624,525.30 (485,766,491)	
ユーロ	ENI SPA	283,711	8.47	2,403,599.59	
	GALP ENERGIA SGPS SA	53,277	10.58	563,670.66	
	NESTE OYJ	46,917	35.11	1,647,255.87	
	OMV AG	15,544	29.46	457,926.24	
	REPSOL SA	167,361	7.86	1,316,796.34	
	REPSOL SA-RTS	167,361	0.43	72,668.14	
	TENARIS SA	48,206	5.82	280,558.92	
	TOTAL SA	273,685	34.93	9,559,817.05	
	VOPAK	7,470	48.02	358,709.40	
	AIR LIQUIDE SA	52,470	126.20	6,621,714.00	
	AKZO NOBEL N.V.	22,145	78.50	1,738,382.50	
	ARCELORMITTAL	87,018	9.02	785,163.41	
	ARKEMA	7,399	81.68	604,350.32	
	BASF SE	101,723	49.64	5,050,038.33	
	COVESTRO AG	20,208	33.26	672,118.08	
	CRH PLC	87,171	30.36	2,646,511.56	
	EVONIK INDUSTRIES AG	22,571	22.13	499,496.23	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	9,295	35.12	326,440.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	16,048	47.11	756,021.28	
	KONINKLIJKE DSM NV	19,172	121.55	2,330,356.60	
	LANXESS AG	8,472	46.02	389,881.44	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,267	28.70	725,162.90	
	SOLVAY SA	8,657	69.60	602,527.20	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	68,929	11.00	758,219.00	
	SYMRISE AG	14,313	98.36	1,407,826.68	
	THYSSENKRUPP AG	41,124	6.10	250,856.40	
	UMICORE	20,914	41.56	869,185.84	

UPM-KYMMENE OYJ	58,920	26.29	1,549,006.80
VOESTALPINE AG	10,934	19.14	209,331.43
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	29,781	21.84	650,417.04
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	29,781	1.34	40,055.44
AIRBUS SE	65,177	62.97	4,104,195.69
ALSTOM	20,160	41.92	845,107.20
ANDRITZ AG	6,701	34.04	228,102.04
BOUYGUES SA	23,469	28.00	657,132.00
BRENNTAG AG	18,754	46.03	863,246.62
CNH INDUSTRIAL NV	110,034	5.99	659,543.79
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	57,410	30.66	1,760,190.60
DASSAULT AVIATION SA	255	798.00	203,490.00
EIFFAGE	9,901	79.50	787,129.50
FERROVIAL SA	53,344	24.53	1,308,528.32
GEA GROUP AG	16,084	28.23	454,051.32
HOCHTIEF AG	2,413	75.65	182,543.45
KINGSPAN GROUP PLC	16,564	56.40	934,209.60
KION GROUP AG	6,458	52.64	339,949.12
KNORR-BREMSE AG	5,208	90.21	469,813.68
KONE OYJ-B	37,579	61.48	2,310,356.92
LEGRAND SA	29,741	65.48	1,947,440.68
LEONARDO SPA	41,656	6.03	251,185.68
METSO OYJ	10,209	30.76	314,028.84
MTU AERO ENGINES AG	5,589	150.00	838,350.00
PRYSMIAN SPA	25,986	20.35	528,815.10
SAFRAN SA	35,585	89.76	3,194,109.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	61,354	96.00	5,889,984.00
SIEMENS AG-REG	84,694	101.26	8,576,114.44
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	23,944	15.13	362,392.44
THALES SA	11,743	69.60	817,312.80
VINCI SA	57,253	81.10	4,643,218.30
WARTSILA OYJ ABP	46,974	7.12	334,642.77
BUREAU VERITAS SA	30,023	18.99	570,286.88
RANDSTAD NV	13,562	38.66	524,306.92
TELEPERFORMANCE	6,540	213.20	1,394,328.00
WOLTERS KLUWER	30,324	67.46	2,045,657.04
ADP	3,034	91.90	278,824.60
AENA SME SA	7,523	120.30	905,016.90
ATLANTIA SPA	54,988	14.28	785,228.64
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,484	8.95	201,411.67
DEUTSCHE POST AG-REG	109,653	31.58	3,462,841.74
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,842	39.86	153,142.12

GETLINK SE	47,878	12.75	610,444.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	36,383	56.18	2,043,996.94
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,381	43.38	233,427.78
CONTINENTAL AG	12,206	84.18	1,027,501.08
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	94,776	34.84	3,302,469.72
FAURECIA	6,804	32.63	222,014.52
FERRARI NV	13,974	149.55	2,089,811.70
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	127,348	8.66	1,103,470.42
MICHELIN (CGDE)	18,916	89.90	1,700,548.40
PEUGEOT SA	68,017	14.01	952,918.17
PIRELLI & C SPA	35,183	3.80	133,976.86
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	16,669	49.18	819,781.42
RENAULT SA	21,400	20.91	447,581.00
VALEO SA	27,895	21.94	612,016.30
VOLKSWAGEN AG	3,486	140.90	491,177.40
VOLKSWAGEN AG-PREF	20,630	129.62	2,674,060.60
ADIDAS AG	21,073	235.70	4,966,906.10
ESSILORLUXOTTICA	31,584	112.50	3,553,200.00
HERMES INTERNATIONAL	3,511	726.80	2,551,794.80
KERING	8,398	474.60	3,985,690.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	30,750	381.35	11,726,512.50
MONCLER SPA	21,058	34.79	732,607.82
PUMA SE	10,166	67.56	686,814.96
SEB SA	2,324	136.90	318,155.60
ACCOR SA	19,606	24.64	483,091.84
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,385	123.65	1,531,405.25
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,150	29.32	297,598.00
SODEXO SA	9,249	58.16	537,921.84
ALTICE EUROPE NV	63,237	3.66	231,637.13
BOLLORE	87,103	2.83	246,675.69
JCDECAUX SA	12,164	16.47	200,341.08
PUBLICIS GROUPE	26,010	28.02	728,800.20
SCOUT24 AG	12,799	69.25	886,330.75
SES	36,096	6.00	216,576.00
TELENET GROUP HOLDING NV	6,451	37.22	240,106.22
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,560	69.82	667,479.20
VIVENDI	92,463	22.88	2,115,553.44
DELIVERY HERO SE	13,753	91.30	1,255,648.90
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	120,772	23.99	2,897,320.28
JUST EAT TAKEAWAY	12,963	89.94	1,165,892.22
PROSUS NV	53,946	81.32	4,386,888.72
ZALANDO SE	15,956	62.98	1,004,908.88

CARREFOUR SA	66,266	14.31	948,266.46
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,376	32.95	111,239.20
COLRUYT SA	5,890	48.82	287,549.80
JERONIMO MARTINS	26,811	15.79	423,479.74
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	122,354	23.75	2,905,907.50
METRO AG	14,082	8.32	117,274.89
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	84,426	43.95	3,710,522.70
DANONE	68,508	63.38	4,342,037.04
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	63,159	7.64	483,040.03
HEINEKEN HOLDING NV	12,863	73.70	948,003.10
HEINEKEN NV	28,777	83.20	2,394,246.40
KERRY GROUP PLC-A	17,324	110.10	1,907,372.40
PERNOD RICARD SA	23,591	139.30	3,286,226.30
REMY COINTREAU	2,158	121.00	261,118.00
BEIERSDORF AG	11,229	98.84	1,109,874.36
HENKEL AG & CO KGAA	11,474	70.15	804,901.10
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,803	78.84	1,561,268.52
L'OREAL	27,813	279.00	7,759,827.00
UNILEVER NV	161,637	48.82	7,891,118.34
BIOMERIEUX	5,151	118.60	610,908.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,177	86.20	360,057.40
DIASORIN SPA	2,987	170.30	508,686.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	23,654	75.84	1,793,919.36
FRESENIUS SE & CO KGAA	46,456	43.97	2,042,670.32
KONINKLIJKE PHILIPS NV	99,356	41.23	4,096,944.66
ORPEA	6,192	102.65	635,608.80
SARTORIUS AG-VORZUG	3,953	297.00	1,174,041.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,005	41.99	672,129.97
BAYER AG-REG	108,782	69.99	7,613,652.18
EUROFINS SCIENTIFIC	1,567	558.20	874,699.40
GALAPAGOS NV	4,558	178.05	811,551.90
GRIFOLS SA	32,153	27.62	888,065.86
IPSEN	3,542	71.65	253,784.30
MERCK KGAA	13,999	99.62	1,394,580.38
ORION OYJ-CLASS B	10,472	43.49	455,427.28
QIAGEN N.V.	25,778	38.13	982,915.14
RECORDATI SPA	10,877	45.00	489,465.00
SANOFI	124,981	91.06	11,380,769.86
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,098	215.80	668,548.40
UCB SA	14,048	102.75	1,443,432.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	45,526	7.52	342,446.57
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	738,181	3.03	2,238,164.79

BANCO SANTANDER SA	1,838,810	2.13	3,925,859.35
BANKINTER SA	67,617	4.18	283,179.99
BNP PARIBAS	124,634	34.51	4,301,119.34
CAIXABANK SA	396,234	1.85	734,815.95
COMMERZBANK AG	106,972	3.78	404,568.10
CREDIT AGRICOLE SA	126,371	8.03	1,015,517.35
ERSTE GROUP BANK AG	33,121	20.27	671,362.67
FINECOBANK SPA	67,925	11.90	808,647.12
ING GROEP NV	432,460	6.10	2,640,168.30
INTESA SANPAOLO	1,658,878	1.66	2,765,017.85
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248	—	—
KBC GROUP NV	27,164	49.76	1,351,680.64
MEDIOBANCA SPA	66,680	6.46	430,752.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	21,019	16.26	341,768.94
SOCIETE GENERALE SA	90,559	14.26	1,291,552.45
UNICREDIT SPA	237,062	8.06	1,912,853.27
AMUNDI SA	6,295	67.95	427,745.25
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	217,794	8.12	1,768,922.86
DEUTSCHE BOERSE AG	21,050	155.70	3,277,485.00
EURAZEO SE	4,128	45.18	186,503.04
EXOR NV	12,940	49.09	635,224.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,663	71.66	764,110.58
NATIXIS	93,734	2.26	212,588.71
SOFINA	1,799	230.50	414,669.50
WENDEL	2,701	83.45	225,398.45
AEGON NV	203,530	2.64	538,133.32
AGEAS	18,334	30.45	558,270.30
ALLIANZ SE-REG	46,130	178.02	8,212,062.60
ASSICURAZIONI GENERALI	122,183	13.26	1,620,757.49
AXA SA	214,658	18.40	3,951,424.46
CNP ASSURANCES	17,599	9.81	172,734.18
HANNOVER RUECK SE	6,718	151.50	1,017,777.00
MAPFRE SA	152,207	1.61	245,205.47
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,983	224.70	3,591,380.10
NN GROUP NV	32,738	29.35	960,860.30
POSTE ITALIANE SPA	57,979	7.84	455,019.19
SAMPO OYJ-A SHS	51,996	30.07	1,563,519.72
SCOR SE	17,251	23.38	403,328.38
AROUNDTOWN SA	136,350	5.18	707,383.80
DEUTSCHE WOHNEN SE	37,703	39.23	1,479,088.69
LEG IMMOBILIEN AG	8,173	114.46	935,481.58
VONOVIA SE	56,918	52.90	3,010,962.20

ADYEN NV	2,001	1,263.00	2,527,263.00
AMADEUS IT GROUP SA	47,787	46.56	2,224,962.72
ATOS SE	11,305	73.42	830,013.10
CAPGEMINI SE	17,915	98.80	1,770,002.00
DASSAULT SYSTEMES SA	14,639	150.05	2,196,581.95
EDENRED	26,473	37.66	996,973.18
NEMETSCHEK SE	6,883	60.30	415,044.90
NEXI SPA	46,087	14.77	680,935.42
SAP SE	115,529	120.10	13,875,032.90
TEAMVIEWER AG	15,450	47.74	737,583.00
WIRECARD AG	7,229	12.30	88,931.15
WORLDLINE SA	14,484	69.58	1,007,796.72
INGENICO GROUP	6,326	130.75	827,124.50
NOKIA OYJ	627,998	3.77	2,369,750.45
CELLNEX TELECOM SA	27,526	52.88	1,455,574.88
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	368,404	14.63	5,389,750.52
ELISA OYJ	16,663	53.08	884,472.04
ILIAD SA	1,325	170.25	225,581.25
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,455	8.91	253,676.32
KONINKLIJKE KPN NV	384,763	2.34	900,345.42
ORANGE	221,500	10.34	2,291,417.50
PROXIMUS	15,448	18.46	285,170.08
TELECOM ITALIA SPA	949,339	0.36	343,660.71
TELECOM ITALIA-RSP	550,435	0.35	197,000.68
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	128,092	2.59	332,911.10
TELEFONICA SA	516,010	4.20	2,167,242.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,661	36.74	465,165.14
E.ON SE	248,694	9.92	2,469,034.03
EDF	63,459	7.80	495,107.11
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	283,668	4.12	1,168,995.82
ELIA GROUP SA/NV	3,662	94.70	346,791.40
ENAGAS SA	27,183	21.44	582,803.52
ENDESA SA	32,471	22.50	730,597.50
ENEL SPA	900,665	7.62	6,866,669.96
ENGIE	202,902	10.94	2,219,747.88
FORTUM OYJ	48,909	16.56	810,177.58
IBERDROLA SA	641,893	9.99	6,417,646.21
NATURGY ENERGY GROUP SA	33,187	16.29	540,616.23
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51,197	17.05	872,908.85
RWE AG	64,839	31.43	2,037,889.77
SNAM SPA	225,127	4.21	948,009.79
SUEZ	36,458	10.07	367,314.35

TERNA SPA	150,741	5.99	903,843.03	
UNIPER SE	21,910	28.22	618,300.20	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	58,825	20.00	1,176,500.00	
VERBUND AG	6,650	37.52	249,508.00	
ASML HOLDING NV	47,122	321.75	15,161,503.50	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	138,763	20.42	2,833,540.46	
STMICROELECTRONICS NV	71,096	23.71	1,685,686.16	
ユーロ 小計	20,860,019		404,795,146.15 (48,785,911,013)	
合 計	118,988,499		438,870,368,860 (438,870,368,860)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,625	2,227,415.00	
		AMERICAN TOWER CORP	48,992	12,452,786.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,577	2,361,005.89	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,212	1,454,054.28	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,763	958,122.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	45,995	7,455,789.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	29,076	4,071,221.52	
		DUKE REALTY CORP	40,962	1,416,465.96	
		EQUINIX INC	9,456	6,521,141.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,251	1,190,096.82	
		EQUITY RESIDENTIAL	41,270	2,372,199.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,267	1,655,204.59	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	14,331	1,296,668.88	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,801	643,348.47	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	56,133	1,458,896.67	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	82,386	904,598.28	
		INVITATION HOMES INC	60,167	1,640,754.09	
		IRON MOUNTAIN INC	30,494	763,264.82	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	57,590	1,027,981.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,437	1,374,537.24	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	18,183	650,951.40	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27,133	770,577.20	
		PROLOGIS INC	81,723	7,338,725.40	
		PUBLIC STORAGE	17,405	3,297,377.25	

		REALTY INCOME CORP	36,999	2,199,960.54	
		REGENCY CENTERS CORP	18,384	815,514.24	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	12,383	3,563,455.91	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	33,964	2,211,396.04	
		SUN COMMUNITIES INC	10,038	1,382,935.26	
		UDR INC	32,769	1,192,463.91	
		VENTAS INC	40,833	1,404,246.87	
		VEREIT INC	118,846	774,875.92	
		VICI PROPERTIES INC	52,096	1,098,183.68	
		VORNADO REALTY TRUST	18,373	694,131.94	
		WELLTOWER INC	45,457	2,244,666.66	
		WEYERHAEUSER CO	82,738	1,799,551.50	
		WP CAREY INC	19,183	1,286,411.98	
アメリカドル合計			1,286,292	85,970,978.91 (9,204,053,002)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,700	419,862.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15,000	209,400.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,200	248,508.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,100	213,413.00	
カナダドル合計			50,000	1,091,183.00 (85,745,160)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	118,796	1,199,839.60	
		GOODMAN GROUP	182,706	2,788,093.56	
		GPT GROUP	232,503	1,050,913.56	
		MIRVAC GROUP	404,306	966,291.34	
		SCENTRE GROUP	620,280	1,401,832.80	
		STOCKLAND	238,162	862,146.44	
		VICINITY CENTRES	348,844	512,800.68	
オーストラリアドル合計			2,145,597	8,781,917.98 (645,997,886)	
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	106,428	409,002.80	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	81,488	461,222.08	
		SEGRO PLC	125,994	1,111,267.08	
イギリスポンド合計			313,910	1,981,491.96 (263,617,690)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	231,100	14,778,845.00	
香港ドル合計			231,100	14,778,845.00 (204,095,849)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	318,200	1,018,240.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	363,300	643,041.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	266,700	538,734.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	216,300	428,274.00	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	306,800	598,260.00	
		SUNTEC REIT	194,300	285,621.00	
シンガポールドル合計			1,665,600	3,512,170.00 (270,120,994)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	4,877	315,298.05	
		GECINA SA	5,521	610,622.60	
		ICADE	3,010	187,523.00	
		KLEPIERRE	20,000	344,400.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,452	839,052.00	
ユーロ合計			49,860	2,296,895.65 (276,821,863)	
合計				10,950,452,444 (10,950,452,444)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 592銘柄	97.12%	—	69.10%
	投資証券 37銘柄	—	2.88%	2.05%
カナダドル	株式 81銘柄	99.44%	—	3.38%
	投資証券 4銘柄	—	0.56%	0.02%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	93.86%	—	2.20%
	投資証券 7銘柄	—	6.14%	0.14%
イギリスポンド	株式 85銘柄	98.80%	—	4.81%
	投資証券 3銘柄	—	1.20%	0.06%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.00%	—	3.55%
香港ドル	株式 34銘柄	96.00%	—	1.09%
	投資証券 1銘柄	—	4.00%	0.05%
シンガポールドル	株式 16銘柄	84.63%	—	0.33%
	投資証券 6銘柄	—	15.37%	0.06%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.00%	—	0.11%
スウェーデンクローネ	株式 36銘柄	100.00%	—	1.04%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.00%	—	0.18%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.00%	—	0.82%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%	—	0.11%
ユーロ	株式 244銘柄	99.44%	—	10.85%
	投資証券 5銘柄	—	0.56%	0.06%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
[令和 2年 6月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	4,323,336,312
コール・ローン	171,167,685
株式	119,436,374,066
投資証券	104,748,997
派生商品評価勘定	30,548,102
未収入金	57,969,062
未収配当金	325,129,531
差入委託証拠金	1,769,753,089
流動資産合計	126,219,026,844
資産合計	126,219,026,844
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,327,107
未払金	2,662,651,472
未払解約金	17,070,161
未払利息	251
流動負債合計	2,685,048,991
負債合計	2,685,048,991
純資産の部	
元本等	
元本	52,599,604,651
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,934,373,202
元本等合計	123,533,977,853
純資産合計	123,533,977,853
負債純資産合計	126,219,026,844

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 新株予約権証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
--------------------	---

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	36,935,854,206円
期中追加設定元本額	23,962,947,485円
期中一部解約元本額	8,299,197,040円
元本の内訳	
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	130,212,176円
eMAXIS 新興国株式インデックス	12,510,210,618円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,633,149,028円
eMAXIS バランス（波乗り型）	146,988,396円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	396,050,751円
コアバランス	102,680円
海外株式セレクション（ラップ向け）	93,350,227円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	2,991,764,192円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	12,699,247,490円
つみたて新興国株式	2,280,199,368円
つみたて8資産均等バランス	1,214,384,890円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	781,172円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,136,150円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,734,863円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	1,159,668,206円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	258,734,496円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	1,681,267,818円
新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）	657,208,300円
つみたて全世界株式	165,663円
三菱ＵＦＪ DC新興国株式インデックスファンド	10,812,748,903円
新興国株式インデックスオープン	417,712,434円
eMAXIS 全世界株式インデックス	491,890,525円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	552,404,607円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	873,793円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	25,649,156円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	141,048,461円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	118,118,966円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	486,723,014円

	[令和 2年 6月25日現在]
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,493,840,108円
アドバンスト・バランス（F O F s用）（適格機関投資家限定）	2,287,022円
アドバンスト・バランス（F O F s用）（適格機関投資家限定）	11,673,338円
世界8資産バランスファンドV L（適格機関投資家限定）	13,661,775円
M U K A M バランスファンド2019 - 12（適格機関投資家限定）	84,051,970円
M U K A M バランスファンド2020 - 04（適格機関投資家限定）	89,564,095円
合計	52,599,604,651円
2. 受益権の総数	52,599,604,651口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

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

２ 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 6月25日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
２．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	9,226,575,055
投資証券	5,422,693
合計	9,231,997,748

(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 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,033,271,380	—	4,057,382,362	24,110,982
合計		4,033,271,380	—	4,057,382,362	24,110,982

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

[令和 2年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	7,854,198	—	7,862,150	7,952
	香港ドル	607,622,400	—	607,640,000	17,600
	マレーシアリン ギット	34,194,787	—	34,150,955	43,832
	タイバーツ	66,214,137	—	66,204,597	9,540
	フィリピンペソ	32,130,000	—	32,100,000	30,000
	インドネシアルピ ア	35,225,273	—	35,543,292	318,019
	メキシコペソ	44,234,050	—	44,180,000	54,050
	韓国ウォン	319,968,000	—	320,400,000	432,000
	ニュー台湾ドル	343,026,000	—	344,850,000	1,824,000
	チェココルナ	11,269,025	—	11,275,000	5,975
	ポーランドズロチ	10,813,240	—	10,808,000	5,240
	南アフリカランド	98,360,000	—	98,240,000	120,000
	トルコリラ	10,930,220	—	10,927,000	3,220
	売建				
	アメリカドル	1,540,299,540	—	1,541,520,000	1,220,460
	オフショア元	7,854,198	—	7,863,389	9,191
合計		3,169,995,068	—	3,173,564,383	1,110,013

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	2.3486円
(1万口当たり純資産額)	(23,486円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM PJSC-SPON ADR	1,130,722	5.47	6,187,310.78	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	156,900	0.65	102,455.70	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	76,498	76.50	5,852,097.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	17,803	154.40	2,748,783.20	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	227,420	5.43	1,236,334.69	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,337,800	0.57	773,800.24	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	1,299,900	0.51	664,111.89	
	TATNEFT PJSC	263,380	8.56	2,255,815.56	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	29,046	5.46	158,591.16	
	ALROSA PJSC	485,760	0.93	454,428.62	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	35,491	9.22	327,227.02	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	43,064	7.28	313,505.92	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	11,917	285.72	3,405,026.55	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	243,290	2.02	491,730.37	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,499	12.68	336,007.32	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	13,083	84.60	1,106,821.80	
	SEVERSTAL PJSC	43,990	12.68	558,175.77	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,381	37.48	613,959.88	
	51JOB INC-ADR	4,511	68.81	310,401.91	
	BEST INC - ADR	46,618	4.79	223,300.22	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	70,291	37.38	2,627,477.58	
	NIO INC - ADR	172,262	6.86	1,181,717.32	
	GSX TECHEDU INC- ADR	13,900	56.70	788,130.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	25,623	36.65	939,082.95	

	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	27,490	132.11	3,631,703.90	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	73,261	67.55	4,948,780.55	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	68,926	49.70	3,425,622.20	
	58.COM INC-ADR	18,576	54.01	1,003,289.76	
	AUTOHOME INC-ADR	10,694	73.78	789,003.32	
	BAIDU INC - SPON ADR	52,385	121.37	6,357,967.45	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	19,638	44.03	864,661.14	
	HUYA INC-ADR	14,300	17.98	257,114.00	
	IQIYI INC-ADR	40,409	22.92	926,174.28	
	JOYY INC	10,716	93.63	1,003,339.08	
	MOMO INC-SPON ADR	26,548	18.46	490,076.08	
	NETEASE INC-ADR	15,543	437.46	6,799,440.78	
	SINA CORP	11,600	35.83	415,628.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	66,284	13.51	895,496.84	
	WEIBO CORP-SPON ADR	9,514	32.96	313,581.44	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	357,887	226.22	80,961,197.14	
	BAOZUN INC-SPN ADR	8,747	39.85	348,567.95	
	JD.COM INC-ADR	161,934	59.84	9,690,130.56	
	PINDUODUO INC-ADR	49,317	84.50	4,167,286.50	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	91,047	25.81	2,349,923.07	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	82,033	20.24	1,660,347.92	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	67,457	13.31	897,852.67	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	23,091	35.02	808,646.82	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	15,480	25.00	387,000.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	10,600	78.59	833,054.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	283,222	4.13	1,171,122.97	
	CREDICORP LTD	13,150	139.77	1,837,975.50	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	498,104	11.75	5,852,722.00	
	VTB BANK PJSC	658,130,000	0.00	340,319.02	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	274,310	1.67	460,625.49	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	5,699	25.33	144,355.67	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	196,860	0.77	152,172.78	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	15,566	80.22	1,248,704.52	
	GLOBANT SA	6,884	145.36	1,000,658.24	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	83,893	9.36	785,238.48	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,804	9.28	137,381.12	
	INTER RAO UES PJSC	7,192,000	0.07	516,774.68	
	アメリカドル 小計	673,840,118		181,530,229.37 (19,434,626,356)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	43,353	15.83	686,277.99	
	イギリスポンド 小計	43,353		686,277.99 (91,302,423)	

香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	394,000	7.25	2,856,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,626,000	3.33	15,404,580.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	625,000	12.20	7,625,000.00	
	CNOOC LTD	3,439,000	8.80	30,263,200.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	236,000	3.74	882,640.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	4,043,000	2.66	10,754,380.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	280,000	5.89	1,649,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	858,000	1.49	1,278,420.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	229,000	51.50	11,793,500.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	304,000	3.44	1,045,760.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	681,000	2.57	1,750,170.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	768,000	8.35	6,412,800.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	440,000	9.74	4,285,600.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	257,000	7.68	1,973,760.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	247,000	4.34	1,071,980.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	315,000	7.19	2,264,850.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	531,000	1.91	1,014,210.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	242,500	8.69	2,107,325.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,062,000	3.51	3,727,620.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	406,000	3.62	1,469,720.00	
	BOC AVIATION LTD	49,100	49.00	2,405,900.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	854,000	4.57	3,902,780.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	404,000	5.16	2,084,640.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	321,000	33.70	10,817,700.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	228,000	10.80	2,462,400.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	339,000	6.40	2,169,600.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	752,000	4.11	3,090,720.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	414,000	4.76	1,970,640.00	
	CITIC LTD	1,072,000	7.47	8,007,840.00	
	CRRC CORP LTD - H	816,550	3.24	2,645,622.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	457,000	9.95	4,547,150.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	118,000	16.06	1,895,080.00	
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	428,000	2.23	954,440.00	
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	80,000	12.20	976,000.00	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	431,500	3.38	1,458,470.00	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	116,000	20.30	2,354,800.00	
	WEICHAJ POWER CO LTD-H	400,800	14.28	5,723,424.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	117,200	7.45	873,140.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	105,900	21.25	2,250,375.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	219,400	5.90	1,294,460.00	
	A-LIVING SERVICES CO LTD-H	76,250	42.60	3,248,250.00	
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	749,111	4.12	3,086,337.32	

COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	247,000	36.65	9,052,550.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	316,000	9.42	2,976,720.00
AIR CHINA LTD-H	444,000	4.79	2,126,760.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	310,000	5.10	1,581,000.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	410,000	2.87	1,176,700.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	258,000	9.26	2,389,080.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	280,000	3.52	985,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	440,500	2.29	1,008,745.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	360,000	4.24	1,526,400.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	268,000	9.32	2,497,760.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	106,000	8.13	861,780.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	189,500	12.48	2,364,960.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	238,000	5.67	1,349,460.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	262,000	3.61	945,820.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	562,000	7.44	4,181,280.00
BYD CO LTD-H	116,000	61.05	7,081,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	580,000	5.06	2,934,800.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	118,800	19.18	2,278,584.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,090,000	12.28	13,385,200.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	619,000	5.06	3,132,140.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	528,945	6.22	3,290,037.90
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	202,000	72.00	14,544,000.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	492,000	2.53	1,244,760.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	255,000	24.50	6,247,500.00
LI NING CO LTD	397,500	25.25	10,036,875.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	157,900	98.25	15,513,675.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	104,500	14.12	1,475,540.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	137,000	12.86	1,761,820.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	200,000	7.20	1,440,000.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	143,000	34.35	4,912,050.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	41,500	34.20	1,419,300.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	2,400,000	1.10	2,640,000.00
CHINA LITERATURE LTD	55,600	53.15	2,955,140.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,091,800	490.80	535,855,440.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,572,000	1.62	2,546,640.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	677,300	178.40	120,830,320.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	154,000	13.80	2,125,200.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	213,000	9.98	2,125,740.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	112,000	42.80	4,793,600.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	449,500	13.00	5,843,500.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	20,400	85.00	1,734,000.00
CHINA FEIHE LTD	161,000	15.44	2,485,840.00

CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	—	—
CHINA MENGNIU DAIRY CO	529,000	30.00	15,870,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	284,000	43.60	12,382,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	336,000	4.60	1,545,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	354,000	12.34	4,368,360.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	76,000	55.70	4,233,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	301,000	7.88	2,371,880.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	892,000	6.03	5,378,760.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	87,000	77.60	6,751,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	131,000	62.05	8,128,550.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	27.40	1,753,600.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	66,000	24.70	1,630,200.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	698,000	23.70	16,542,600.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	74,600	115.00	8,579,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	496,000	16.36	8,114,560.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	156,600	12.82	2,007,612.00
SINOPHARM GROUP CO-H	258,400	19.56	5,054,304.00
3SBIO INC	260,000	9.68	2,516,800.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,600	225.00	2,385,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	281,000	9.50	2,669,500.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	235,000	4.36	1,024,600.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	596,000	3.71	2,211,160.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	920,000	14.20	13,064,000.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT-NEW	172,400	14.20	2,448,080.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	200,000	16.24	3,248,000.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	92,000	37.50	3,450,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	178,000	57.90	10,306,200.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	412,500	5.05	2,083,125.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	115,000	26.30	3,024,500.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,331,000	14.88	19,805,280.00
SSY GROUP LTD	328,000	5.07	1,662,960.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	39,984	101.80	4,070,371.20
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	170,500	145.50	24,807,750.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,279,000	3.16	16,681,640.00
BANK OF CHINA LTD-H	15,203,000	2.90	44,088,700.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,728,900	4.78	8,264,142.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,794,000	3.40	6,099,600.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	18,295,550	6.22	113,798,321.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	626,000	2.93	1,834,180.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	747,550	36.10	26,986,555.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,121,820	5.38	6,035,391.60
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	570,000	3.11	1,772,700.00

IND & COMM BK OF CHINA-H	11,604,350	4.81	55,816,923.50	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,931,000	4.52	8,728,120.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,673,000	1.58	2,643,340.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	186,000	11.52	2,142,720.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	657,500	4.34	2,853,550.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2,024,000	0.78	1,578,720.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	249,200	15.10	3,762,920.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	414,500	15.66	6,491,070.00	
FAR EAST HORIZON LTD	373,000	6.38	2,379,740.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	227,800	8.53	1,943,134.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	126,600	11.14	1,410,324.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	524,400	6.50	3,408,600.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	285,400	13.10	3,738,740.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,404,000	15.92	22,351,680.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	535,400	21.10	11,296,940.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	783,000	0.85	665,550.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	309,200	12.46	3,852,632.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	151,700	26.25	3,982,125.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,665,000	2.49	4,145,850.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,262,000	7.43	9,376,660.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,132,000	79.15	89,597,800.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	60,200	35.20	2,119,040.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	198,000	9.01	1,783,980.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	264,000	9.79	2,584,560.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	366,000	19.50	7,137,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	962,000	5.49	5,281,380.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	740,000	24.85	18,389,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	220,000	8.07	1,775,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	618,000	30.75	19,003,500.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	322,951	24.65	7,960,742.15	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	632,000	6.24	3,943,680.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,477,232	9.89	14,609,824.48	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	211,200	9.18	1,938,816.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	406,000	3.00	1,218,000.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	273,000	12.44	3,396,120.00	
LOGAN GROUP CO LTD	270,000	13.70	3,699,000.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	344,500	37.65	12,970,425.00	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	20,400	76.80	1,566,720.00	
SEAZEN GROUP LTD	370,000	6.90	2,553,000.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	542,000	2.33	1,262,860.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	226,000	32.50	7,345,000.00	
SHUI ON LAND LTD	717,000	1.30	932,100.00	

SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	497,500	1.88	935,300.00	
SOHO CHINA LTD	317,500	2.78	882,650.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	480,000	33.75	16,200,000.00	
WHARF HOLDINGS LTD	275,000	16.56	4,554,000.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,500,000	1.41	2,115,000.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	336,000	3.37	1,132,320.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	386,000	4.88	1,883,680.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	429,000	16.92	7,258,680.00	
KINGSOFT CORP LTD	149,000	34.20	5,095,800.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	178,000	14.66	2,609,480.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	143,000	49.45	7,071,350.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	126,000	18.22	2,295,720.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	237,000	3.37	798,690.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	149,500	21.40	3,199,300.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	183,500	8.15	1,495,525.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	136,200	8.82	1,201,284.00	
LENOVO GROUP LTD	1,468,000	4.35	6,385,800.00	
SUNNY OPTICAL TECH	136,200	119.80	16,316,760.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	1,963,600	13.88	27,254,768.00	
ZTE CORP-H	144,931	23.60	3,420,371.60	
CHINA MOBILE LTD	1,171,000	55.00	64,405,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	2,628,000	2.27	5,965,560.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	8,338,000	1.46	12,173,480.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	1,258,000	4.44	5,585,520.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	96,500	26.95	2,600,675.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	812,000	3.01	2,444,120.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,943,000	1.66	3,225,380.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	489,600	27.55	13,488,480.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	562,000	4.56	2,562,720.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	705,000	1.46	1,029,300.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	176,000	40.35	7,101,600.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	394,000	9.08	3,577,520.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	149,900	91.80	13,760,820.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	558,000	13.88	7,745,040.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	678,000	2.94	1,993,320.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	708,000	5.12	3,624,960.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	89,000	26.10	2,322,900.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	649,400	27.45	17,826,030.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	806,000	7.31	5,891,860.00	
香港ドル 小計	170,363,324		2,073,381,131.75 (28,633,393,429)	

マレーシアリングット	DIALOG GROUP BHD	782,180	3.63	2,839,313.40	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	56,300	21.64	1,218,332.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	461,900	6.43	2,970,017.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	241,700	4.55	1,099,735.00	
	GAMUDA BHD	282,700	3.53	997,931.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	133,100	8.55	1,138,005.00	
	IJM CORP BHD	457,600	1.84	841,984.00	
	SIME DARBY BERHAD	493,200	2.08	1,025,856.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	241,800	5.72	1,383,096.00	
	MISC BHD	228,100	7.80	1,779,180.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	148,400	3.76	557,984.00	
	GENTING BHD	441,700	4.27	1,886,059.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	628,000	2.63	1,651,640.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	27,500	24.10	662,750.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	24,500	32.48	795,760.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	39,200	10.10	395,920.00	
	IOI CORP BHD	455,200	4.40	2,002,880.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	82,700	22.34	1,847,518.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	14,400	139.30	2,005,920.00	
	PPB GROUP BERHAD	134,440	17.98	2,417,231.20	
	QL RESOURCES BHD	150,100	9.19	1,379,419.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	390,700	4.95	1,933,965.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	319,600	12.10	3,867,160.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	436,300	5.40	2,356,020.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	290,400	15.60	4,530,240.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	271,500	3.23	876,945.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,282,900	3.62	4,644,098.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	123,700	14.20	1,756,540.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	33,300	13.78	458,874.00	
	MALAYAN BANKING BHD	747,500	7.64	5,710,900.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	552,300	16.48	9,101,904.00	
	RHB BANK BHD	319,249	4.80	1,532,395.20	
	AXIATA GROUP BERHAD	545,100	3.48	1,896,948.00	
	DIGI.COM BHD	567,300	4.21	2,388,333.00	
	MAXIS BHD	474,300	5.33	2,528,019.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	214,800	4.00	859,200.00	
	PETRONAS GAS BHD	137,800	17.10	2,356,380.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	439,700	11.74	5,162,078.00	
	YTL CORP BHD	769,263	0.81	623,103.03	
マレーシアリングット 小計		13,440,432		83,479,632.83 (2,088,660,413)	
タイバーツ	IRPC PCL - NVDR	2,038,500	2.66	5,422,410.00	

PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	277,800	92.75	25,765,950.00
PTT PCL-NVDR	2,222,100	37.50	83,328,750.00
THAI OIL PCL-NVDR	238,100	43.75	10,416,875.00
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	293,000	27.25	7,984,250.00
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	457,061	45.75	20,910,540.75
SIAM CEMENT PCL-NVDR	149,650	353.00	52,826,450.00
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	818,700	59.75	48,917,325.00
BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	1,300,300	9.70	12,612,910.00
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,517,200	11.40	17,296,080.00
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	1,173,700	4.04	4,741,748.00
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	509,900	20.90	10,656,910.00
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	385,017	32.75	12,609,306.75
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	1,156,301	15.40	17,807,035.40
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	243,700	38.75	9,443,375.00
CP ALL PCL-NVDR	1,134,500	67.25	76,295,125.00
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	744,400	31.25	23,262,500.00
OSOTSPA PCL-NVDR	110,500	38.75	4,281,875.00
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	552,100	12.30	6,790,830.00
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,743,000	22.30	38,868,900.00
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	93,100	114.00	10,613,400.00
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	101,200	107.50	10,879,000.00
KASIKORNBANK PCL-NVDR	308,100	90.25	27,806,025.00
KRUNG THAI BANK - NVDR	791,400	10.30	8,151,420.00
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	176,700	72.75	12,854,925.00
TMB BANK PCL-NVDR	3,393,200	1.06	3,596,792.00
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	315,500	24.50	7,729,750.00
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	135,500	30.25	4,098,875.00
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	154,600	53.00	8,193,800.00
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	142,800	52.50	7,497,000.00
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	398,900	50.25	20,044,725.00
LAND & HOUSES PUB - NVDR	1,350,100	7.70	10,395,770.00
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	232,000	188.00	43,616,000.00
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	411,500	55.50	22,838,250.00
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	118,000	40.75	4,808,500.00
TRUE CORP PCL-NVDR	2,045,076	3.56	7,280,470.56
B GRIMM POWER PCL-NVDR	167,500	51.50	8,626,250.00
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	58,900	251.00	14,783,900.00
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	274,600	38.75	10,640,750.00
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	145,900	75.00	10,942,500.00
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	372,900	35.25	13,144,725.00
RATCH GROUP PCL-NVDR	154,300	63.50	9,798,050.00
	28,407,305		768,580,023.46

タイバーツ 小計				(2,666,972,681)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	342,280	46.75	16,001,590.00	
	AYALA CORPORATION	57,085	786.00	44,868,810.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	15,054	470.40	7,081,401.60	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	508,020	61.00	30,989,220.00	
	SM INVESTMENTS CORP	48,350	937.00	45,303,950.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	211,940	100.80	21,363,552.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	85,240	143.90	12,266,036.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	183,600	44.75	8,216,100.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	174,900	128.10	22,404,690.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	211,341	72.00	15,216,552.00	
	BDO UNIBANK INC	389,750	100.10	39,013,975.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	402,156	38.00	15,281,928.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,266,500	3.88	8,794,020.00	
	AYALA LAND INC	1,581,520	34.05	53,850,756.00	
	MEGAWORLD CORP	1,793,000	3.06	5,486,580.00	
	ROBINSONS LAND CO	304,700	17.24	5,253,028.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,855,900	31.00	57,532,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	6,260	2,094.00	13,108,440.00	
	PLDT INC	14,760	1,213.00	17,903,880.00	
	ABOITIZ POWER CORP	249,500	26.70	6,661,650.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	50,740	266.80	13,537,432.00	
フィリピンペソ 小計		10,752,596		460,136,490.60	(984,692,089)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	3,549,400	1,045.00	3,709,123,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	328,100	16,725.00	5,487,472,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	5,284,700	1,190.00	6,288,793,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	438,900	5,600.00	2,457,840,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	310,600	12,300.00	3,820,380,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	640,400	9,475.00	6,067,790,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,777,200	5,000.00	18,886,000,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	1,063,000	1,535.00	1,631,705,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,481,700	5,650.00	8,371,605,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	96,000	47,700.00	4,579,200,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	1,631,300	1,710.00	2,789,523,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	385,700	9,075.00	3,500,227,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	743,900	6,525.00	4,853,947,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,405,600	8,075.00	11,350,220,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	3,583,600	1,460.00	5,232,056,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,863,700	28,525.00	53,162,042,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,450,600	5,150.00	17,770,590,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,612,700	4,740.00	7,644,198,000.00	

	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	10,740,300	3,120.00	33,509,736,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	9,517,900	3,180.00	30,266,922,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	514,700	2,690.00	1,384,543,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	1,707,300	1,130.00	1,929,249,000.00	
	インドネシアルピア 小計	54,127,300		234,693,163,000.00 (1,783,668,038)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	3,002,268	6.26	18,794,197.68	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	561,570	52.61	29,544,197.70	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	22,650	220.61	4,996,816.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	198,398	34.48	6,840,763.04	
	ALFA S.A.B. -A	661,400	12.78	8,452,692.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	72,700	46.55	3,384,185.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	77,800	166.27	12,935,806.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	41,515	259.15	10,758,612.25	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	38,620	167.58	6,471,939.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	420,800	25.08	10,553,664.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	51,600	67.44	3,479,904.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,002,300	55.48	55,607,604.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	89,966	100.43	9,035,285.38	
	BECLE SAB DE CV	104,800	43.00	4,506,400.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	106,000	102.05	10,817,300.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	372,100	143.35	53,340,535.00	
	GRUMA S.A.B. -B	46,275	243.94	11,288,323.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	327,600	38.99	12,773,124.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	316,600	35.26	11,163,316.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	494,100	81.94	40,486,554.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	367,500	16.70	6,137,250.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	6,385,200	15.08	96,288,816.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	99,600	64.00	6,374,400.00	
	メキシコペソ 小計	14,861,362		434,031,685.65 (2,044,289,239)	
ブラジルリアル	COSAN SA	33,600	68.79	2,311,344.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	701,600	21.91	15,372,056.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	913,000	21.00	19,173,000.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,600	18.49	2,803,084.00	
	BRASKEM SA-PREF A	32,300	23.79	768,417.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	149,600	11.08	1,657,568.00	
	GERDAU SA-PREF	187,000	15.74	2,943,380.00	
	KLABIN SA - UNIT	117,400	20.48	2,404,352.00	
	SUZANO SA	110,722	38.60	4,273,869.20	
	VALE SA	699,330	55.39	38,735,888.70	
	WEG SA	155,844	46.05	7,176,616.20	

CCR SA	215,600	14.40	3,104,640.00
LOCALIZA RENT A CAR	116,513	40.98	4,774,702.74
RUMO SA	211,400	23.08	4,879,112.00
COGNA EDUCACAO	384,192	6.76	2,597,137.92
B2W CIA DIGITAL	38,000	106.27	4,038,260.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	150,961	31.80	4,800,559.80
LOJAS RENNER S.A.	153,620	41.05	6,306,101.00
MAGAZINE LUIZA SA	141,100	69.80	9,848,780.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	138,000	21.49	2,965,620.00
ATACADAO SA	74,700	19.63	1,466,361.00
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	30,300	69.28	2,099,184.00
RAIA DROGASIL SA	39,700	108.00	4,287,600.00
AMBEV SA	915,300	13.68	12,521,304.00
BRF SA	115,200	21.87	2,519,424.00
JBS SA	209,300	21.83	4,569,019.00
NATURA &CO HOLDING SA	138,400	41.30	5,715,920.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	45,600	60.71	2,768,376.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	93,200	65.17	6,073,844.00
HYPERA SA	73,900	34.40	2,542,160.00
BANCO BRADESCO S.A.	252,241	19.22	4,848,072.02
BANCO BRADESCO SA-PREF	861,558	20.85	17,963,484.30
BANCO DO BRASIL S.A.	158,400	32.22	5,103,648.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	74,100	28.75	2,130,375.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	926,630	25.84	23,944,119.20
ITAUSA SA	860,707	9.77	8,409,107.39
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	395,675	52.65	20,832,288.75
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	48,400	76.70	3,712,280.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	127,100	28.37	3,605,827.00
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	119,900	11.06	1,326,094.00
PORTO SEGURO SA	15,400	52.85	813,890.00
SUL AMERICA SA - UNITS	56,658	44.26	2,507,683.08
BR MALLS PARTICIPACOES SA	127,554	10.34	1,318,908.36
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,300	21.40	969,420.00
CIELO SA	207,121	4.70	973,468.70
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	89,375	48.82	4,363,287.50
TIM PARTICIPACOES SA	149,377	13.99	2,089,784.23
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	49,300	30.80	1,518,440.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	62,200	29.43	1,830,546.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	163,773	11.04	1,808,053.92
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	18,700	61.78	1,155,286.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	60,800	60.07	3,652,256.00
CPFL ENERGIA SA	44,600	30.27	1,350,042.00

	ENERGISA SA-UNITS	40,100	47.67	1,911,567.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	42,050	42.38	1,782,079.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	163,800	22.18	3,633,084.00	
	ブラジルリアル 小計	11,697,801		309,050,772.01 (6,187,196,455)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	78,409	5,794.00	454,301,746.00	
	EMPRESAS CMPC SA	237,271	1,727.00	409,767,017.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,539	21,050.00	453,395,950.00	
	FALABELLA SA	141,135	2,580.00	364,128,300.00	
	CENCOSUD SA	308,874	1,215.00	375,281,910.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,576	6,225.00	140,535,600.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	57,088	2,060.00	117,601,280.00	
	BANCO DE CHILE	8,408,646	75.50	634,852,773.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	9,439	28,231.00	266,472,409.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,826,505	34.30	405,649,121.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	94,600	1,580.00	149,468,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	26,107	5,350.10	139,675,060.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	472,237	272.00	128,448,464.00	
	COLBUN SA	1,351,330	130.00	175,672,900.00	
	ENEL AMERICAS SA	6,844,035	127.01	869,260,885.00	
	ENEL CHILE SA	6,014,289	62.88	378,178,492.00	
	チリペソ 小計	35,914,080		5,462,689,907.00 (713,973,570)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	10,450	37,500.00	391,875,000.00	
	S-OIL CORP	8,232	66,800.00	549,897,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,802	136,500.00	1,474,473,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	23,378	19,450.00	454,702,100.00	
	HYUNDAI STEEL CO	17,295	21,450.00	370,977,750.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,657	351,000.00	581,607,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2,964	77,500.00	229,710,000.00	
	LG CHEM LTD	8,840	516,000.00	4,561,440,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,367	273,500.00	373,874,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	3,322	174,500.00	579,689,000.00	
	POSCO	13,990	185,000.00	2,588,150,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,967	78,500.00	311,409,500.00	
	CJ CORP	3,215	88,300.00	283,884,500.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	5,856	86,100.00	504,201,600.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	26,032	3,580.00	93,194,560.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	6,507	24,450.00	159,096,150.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	8,098	27,300.00	221,075,400.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	10,115	25,850.00	261,472,750.00	
	HANWHA CORPORATION	10,143	23,000.00	233,289,000.00	

HYUNDAI ENGINEERING & CONST	15,811	34,600.00	547,060,600.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	2,060	254,000.00	523,240,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	12,156	24,800.00	301,468,800.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	7,446	90,300.00	672,373,800.00	
LG CORP	18,503	74,400.00	1,376,623,200.00	
LOTTE CORP	3,952	34,300.00	135,553,600.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	7,531	14,350.00	108,069,850.00	
SAMSUNG C&T CORP	15,837	118,000.00	1,868,766,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	25,856	12,300.00	318,028,800.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	84,388	6,100.00	514,766,800.00	
SK HOLDINGS CO LTD	6,564	286,500.00	1,880,586,000.00	
S-1 CORPORATION	3,622	88,700.00	321,271,400.00	
CJ LOGISTICS	1,801	159,500.00	287,259,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	4,218	111,000.00	468,198,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	16,090	18,050.00	290,424,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD-RTS	6,287	3,060.00	19,238,220.00	
PAN OCEAN CO LTD	39,939	3,770.00	150,570,030.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	16,564	25,300.00	419,069,200.00	
HANON SYSTEMS	43,260	9,580.00	414,430,800.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	12,695	205,000.00	2,602,475,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	27,993	103,000.00	2,883,279,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	7,722	60,600.00	467,953,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	3,585	58,000.00	207,930,000.00	
KIA MOTORS CORP	51,864	33,750.00	1,750,410,000.00	
COWAY CO LTD	9,531	73,800.00	703,387,800.00	
FILA HOLDINGS CORP	11,149	35,850.00	399,691,650.00	
HLB INC	7,869	102,500.00	806,572,500.00	
LG ELECTRONICS INC	20,535	67,000.00	1,375,845,000.00	
KANGWON LAND INC	19,369	22,300.00	431,928,700.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	17,976	16,700.00	300,199,200.00	
KAKAO CORP	10,559	282,500.00	2,982,917,500.00	
NAVER CORP	23,495	279,000.00	6,555,105,000.00	
NCSOFT CORP	3,118	943,000.00	2,940,274,000.00	
NETMARBLE CORP	3,622	101,000.00	365,822,000.00	
PEARL ABYSS CORP	1,102	219,000.00	241,338,000.00	
CJ ENM CO LTD	1,662	111,400.00	185,146,800.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	6,730	69,900.00	470,427,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	2,000	58,100.00	116,200,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	2,198	79,700.00	175,180,600.00	
SHINSEGAE INC	1,181	209,500.00	247,419,500.00	
BGF RETAIL CO LTD	1,349	137,000.00	184,813,000.00	
E-MART INC	3,358	111,000.00	372,738,000.00	

GS RETAIL CO LTD	4,031	38,150.00	153,782,650.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,754	346,000.00	606,884,000.00	
KT&G CORP	22,508	79,500.00	1,789,386,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	4,722	137,000.00	646,914,000.00	
OTTOGI CORPORATION	187	572,000.00	106,964,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	6,519	155,000.00	1,010,445,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,222	60,500.00	73,931,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	4,695	49,850.00	234,045,750.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,764	1,345,000.00	2,372,580,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	343	713,000.00	244,559,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	13,396	112,900.00	1,512,408,400.00	
CELLTRION INC	18,115	319,000.00	5,778,685,000.00	
CELLTRION PHARM INC	2,819	136,600.00	385,075,400.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,079	257,000.00	277,303,000.00	
HELIXMITH CO LTD	3,937	65,000.00	255,905,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,221	819,000.00	2,637,999,000.00	
YUHAN CORP	9,295	53,100.00	493,564,500.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,834	5,100.00	249,053,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	55,632	27,650.00	1,538,224,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	54,119	8,300.00	449,187,700.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	74,211	34,900.00	2,589,963,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	86,148	30,200.00	2,601,669,600.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	105,445	9,250.00	975,366,250.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	8,663	48,250.00	417,989,750.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	58,500	3,230.00	188,955,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	66,513	6,980.00	464,260,740.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	20,867	8,820.00	184,046,940.00	
SAMSUNG CARD CO	4,545	28,200.00	128,169,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	9,939	27,900.00	277,298,100.00	
DB INSURANCE CO LTD	9,631	44,000.00	423,764,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	10,238	25,250.00	258,509,500.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,018	186,500.00	1,122,357,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	13,439	46,400.00	623,569,600.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	3,400	108,500.00	368,900,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	6,817	179,000.00	1,220,243,000.00	
KMW CO LTD	6,037	62,900.00	379,727,300.00	
LG DISPLAY CO LTD	45,899	12,000.00	550,788,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	2,514	168,000.00	422,352,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	10,498	136,000.00	1,427,728,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	909,180	52,900.00	48,095,622,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	156,279	47,000.00	7,345,113,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	10,394	380,500.00	3,954,917,000.00	

	LG UPLUS CORP	46,629	12,250.00	571,205,250.00	
	SK TELECOM	3,819	205,500.00	784,804,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	49,082	19,850.00	974,277,700.00	
	KOREA GAS CORPORATION	3,688	27,300.00	100,682,400.00	
	SK HYNIX INC	103,648	86,000.00	8,913,728,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,849,010		157,790,977,090.00 (14,043,396,961)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	219,150	89.00	19,504,350.00	
	ASIA CEMENT CORP	397,281	43.45	17,261,859.45	
	CHINA STEEL CORP	2,231,947	20.85	46,536,094.95	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	662,430	75.50	50,013,465.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	719,600	87.40	62,893,040.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	980,557	64.70	63,442,037.90	
	TAIWAN CEMENT	896,563	42.85	38,417,724.55	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	25,000	514.00	12,850,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	587,138	27.75	16,293,079.50	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	47,405	295.50	14,008,177.50	
	CHINA AIRLINES LTD	405,000	8.39	3,397,950.00	
	EVA AIRWAYS CORP	615,365	11.40	7,015,161.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	439,883	10.75	4,728,742.25	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	386,000	36.85	14,224,100.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	306,413	34.50	10,571,248.50	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	31,728	338.00	10,724,064.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	54,318	180.00	9,777,240.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	131,000	37.25	4,879,750.00	
	GIANT MANUFACTURING	62,000	261.50	16,213,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	28,000	297.00	8,316,000.00	
	POU CHEN	419,500	28.95	12,144,525.00	
	TATUNG CO LTD	297,000	21.00	6,237,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	57,000	689.00	39,273,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	110,000	300.00	33,000,000.00	
	STANDARD FOODS CORP	110,023	63.00	6,931,449.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	913,624	71.40	65,232,753.60	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	989,563	19.55	19,345,956.65	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	3,298,955	20.25	66,803,838.75	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,970,106	27.95	55,064,462.70	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,984,816	22.70	45,055,323.20	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,500,878	19.90	29,867,472.20	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,124,754	31.25	66,398,562.50	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,861,018	11.10	20,657,299.80	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,969,316	13.55	26,684,231.80	
	TAIWAN BUSINESS BANK	1,190,859	10.85	12,920,820.15	

TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,678,824	20.80	34,919,539.20	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	641,000	45.10	28,909,100.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	218,478	119.00	25,998,882.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD-NEW	8,739	119.00	1,039,941.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,822,321	18.40	33,530,706.40	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,512,366	42.20	63,821,845.20	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,557,255	9.34	23,884,761.70	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	455,056	22.00	10,011,232.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,248,087	44.15	55,103,041.05	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	2,271,852	8.66	19,674,238.32	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	105,000	43.90	4,609,500.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	108,720	50.60	5,501,232.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	93,000	223.50	20,785,500.00	
ACER INC	573,168	18.00	10,317,024.00	
ADVANTECH CO LTD	64,676	294.00	19,014,744.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	138,774	223.50	31,015,989.00	
AU OPTRONICS CORP	1,766,000	9.34	16,494,440.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	130,000	222.50	28,925,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	101,766	84.60	8,609,403.60	
COMPAL ELECTRONICS	806,775	19.45	15,691,773.75	
DELTA ELECTRONICS INC	372,220	168.00	62,532,960.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	163,042	55.90	9,114,047.80	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,376,272	83.50	198,418,712.00	
INNOLUX CORP	1,733,112	7.86	13,622,260.32	
INVENTEC CORP	488,429	25.70	12,552,625.30	
LARGAN PRECISION CO LTD	18,820	4,010.00	75,468,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	391,160	47.30	18,501,868.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	140,000	106.50	14,910,000.00	
PEGATRON CORP	393,976	70.10	27,617,717.60	
QUANTA COMPUTER INC	556,150	70.90	39,431,035.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	237,193	41.30	9,796,070.90	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	65,000	188.50	12,252,500.00	
WISTRON CORP	525,865	35.65	18,747,087.25	
WIIWYNN CORP	15,000	799.00	11,985,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	335,168	39.45	13,222,377.60	
YAGEO CORPORATION	68,952	407.50	28,097,940.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	110,000	133.50	14,685,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	733,000	114.50	83,928,500.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	291,000	67.00	19,497,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	308,400	108.00	33,307,200.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	625,294	68.00	42,519,992.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	406.50	17,073,000.00	

	MEDIATEK INC	287,236	580.00	166,596,880.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	217,000	60.80	13,193,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	116,000	228.00	26,448,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	23,000	292.00	6,716,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	147,300	103.00	15,171,900.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	92,703	306.50	28,413,469.50	
	SILERGY CORP	15,000	1,885.00	28,275,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,691,000	317.50	1,489,392,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,117,000	15.75	33,342,750.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	185,000	78.30	14,485,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	61,000	295.00	17,995,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	460,000	13.40	6,164,000.00	
	ニュー台湾ドル 小計	62,728,339		4,018,017,366.44 (14,585,403,040)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	115,594	378.55	43,758,108.70	
	COAL INDIA LTD	238,400	141.55	33,745,520.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	105,207	228.40	24,029,278.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	373,789	87.10	32,557,021.90	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	489,850	83.10	40,706,535.00	
	PETRONET LNG LTD	133,659	262.65	35,105,536.35	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	543,157	1,727.85	938,493,822.45	
	AMBUJA CEMENTS LTD	135,329	188.70	25,536,582.30	
	ASIAN PAINTS LTD	53,729	1,747.25	93,877,995.25	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	44,660	540.80	24,152,128.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	54,756	613.65	33,601,019.40	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	240,897	151.40	36,471,805.80	
	JSW STEEL LTD	181,540	193.90	35,200,606.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	26,343	1,404.15	36,989,523.45	
	SHREE CEMENT LTD	1,824	22,566.25	41,160,840.00	
	TATA STEEL LTD	54,834	326.05	17,878,625.70	
	ULTRATECH CEMENT LTD	23,025	3,821.60	87,992,340.00	
	UPL LTD	85,811	444.95	38,181,604.45	
	VEDANTA LTD	332,594	109.45	36,402,413.30	
	HAVELLS INDIA LTD	51,739	582.10	30,117,271.90	
	LARSEN & TOUBRO LTD	88,309	955.55	84,383,664.95	
	SIEMENS LTD	10,672	1,094.30	11,678,369.60	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	92,656	351.85	32,601,013.60	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	32,335	417.75	13,507,946.25	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	15,619	1,062.50	16,595,187.50	
	BAJAJ AUTO LTD	14,978	2,817.25	42,196,770.50	
	BHARAT FORGE LTD	53,198	356.65	18,973,066.70	
	BOSCH LTD	1,117	11,401.30	12,735,252.10	

EICHER MOTORS LTD	2,432	18,436.85	44,838,419.20
HERO MOTOCORP LTD	18,137	2,493.80	45,230,050.60
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	142,365	515.35	73,367,802.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	23,024	5,755.35	132,511,178.40
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	151,457	95.70	14,494,434.90
TATA MOTORS LTD	369,721	104.80	38,746,760.80
PAGE INDUSTRIES LTD	1,074	20,753.90	22,289,688.60
TITAN CO LTD	63,266	988.20	62,519,461.20
JUBILANT FOODWORKS LTD	13,156	1,767.65	23,255,203.40
INFO EDGE INDIA LTD	12,518	2,712.05	33,949,441.90
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	147,513	174.10	25,682,013.30
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,138	2,358.35	66,359,252.30
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,326	3,446.40	39,033,926.40
ITC LTD	652,664	191.85	125,213,588.40
NESTLE INDIA LTD	4,245	16,707.95	70,925,247.75
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	77,000	383.10	29,498,700.00
UNITED SPIRITS LTD	53,355	608.00	32,439,840.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	13,677	1,388.35	18,988,462.95
DABUR INDIA LTD	94,514	455.05	43,008,595.70
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	81,841	671.70	54,972,599.70
HINDUSTAN UNILEVER LTD	157,131	2,130.30	334,736,169.30
MARICO LTD	94,747	338.75	32,095,546.25
AUROBINDO PHARMA LTD	52,503	791.95	41,579,750.85
BIOCON LTD	50,755	389.90	19,789,374.50
CIPLA LTD	65,246	631.20	41,183,275.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	13,924	2,341.35	32,600,957.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	22,330	4,042.65	90,272,374.50
LUPIN LTD	43,303	921.40	39,899,384.20
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	15,818	1,240.40	19,620,647.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	161,560	484.40	78,259,664.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,990	2,462.05	22,133,829.50
AXIS BANK LTD	394,911	424.65	167,698,956.15
BANDHAN BANK LTD	73,800	331.35	24,453,630.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	314,092	1,797.75	564,658,893.00
ICICI BANK LTD	922,252	348.10	321,035,921.20
LIC HOUSING FINANCE LTD	50,241	270.40	13,585,166.40
STATE BANK OF INDIA	347,235	184.60	64,099,581.00
BAJAJ FINANCE LTD	33,410	2,934.45	98,039,974.50
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	8,941	2,447.30	21,881,309.30
REC LTD	126,676	112.90	14,301,720.40
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,379	682.25	10,492,322.75
BAJAJ FINSERV LTD	7,537	6,046.05	45,569,078.85

	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	142,800	527.25	75,291,300.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	41,277	1,293.10	53,375,288.70	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	63,100	430.65	27,174,015.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	71,900	780.75	56,135,925.00	
	DLF LTD	138,319	160.05	22,137,955.95	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	210,747	559.60	117,934,021.20	
	INFOSYS LTD	649,044	714.15	463,514,772.60	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	172,110	2,042.20	351,483,042.00	
	TECH MAHINDRA LTD	82,825	560.95	46,460,683.75	
	WIPRO LTD	220,999	218.20	48,221,981.80	
	BHARTI AIRTEL LTD	472,969	557.35	263,609,272.15	
	BHARTI INFRATEL LTD	49,169	233.05	11,458,835.45	
	GAIL INDIA LTD	325,150	101.40	32,970,210.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	36,632	443.55	16,248,123.60	
	NTPC LTD	428,056	97.05	41,542,834.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	369,017	178.50	65,869,534.50	
	インドルピー 小計	12,011,939		6,707,369,841.15	(9,524,465,174)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	16,748	567.00	9,496,116.00	
	MONETA MONEY BANK AS	101,820	55.70	5,671,374.00	
	CEZ AS	30,444	495.00	15,069,780.00	
	チェココルナ 小計	149,012		30,237,270.00	(136,370,087)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	1,058,563	2,090.00	2,212,396,670.00	
	BANCOLOMBIA SA	39,604	25,000.00	990,100,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	87,511	24,720.00	2,163,271,920.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	38,050	19,280.00	733,604,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	91,762	18,800.00	1,725,125,600.00	
	コロンビアペソ 小計	1,315,490		7,824,498,190.00	(224,563,098)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	76,580	1,912.00	146,420,960.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	26,853	6,750.00	181,257,750.00	
	OTP BANK PLC	43,226	11,620.00	502,286,120.00	
	ハンガリーフォリント 小計	146,659		829,964,830.00	(284,262,954)
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	575,797	5.02	2,890,500.94	
	DUBAI ISLAMIC BANK	378,667	3.88	1,469,227.96	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	536,876	11.22	6,023,748.72	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	820,642	1.85	1,518,187.70	
	EMAAR MALLS PJSC	731,313	1.44	1,053,090.72	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	790,788	2.80	2,214,206.40	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	353,612	16.90	5,976,042.80	

アラブディルハム 小計		4,187,695		21,145,005.24 (617,434,153)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	15,889	59.10	939,039.90	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	57,472	64.08	3,682,805.76	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	368,052	4.40	1,620,164.90	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	26,966	88.56	2,388,108.96	
	LPP SA	260	6,555.00	1,704,300.00	
	CD PROJEKT SA	12,909	407.60	5,261,708.40	
	CYFROWY POLSAT SA	48,046	26.54	1,275,140.84	
	DINO POLSKA SA	10,080	201.00	2,026,080.00	
	BANK PEKAO SA	37,668	54.60	2,056,672.80	
	MBANK SA	2,305	241.20	555,966.00	
	PKO BANK POLSKI SA	164,806	22.81	3,759,224.86	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	6,517	180.40	1,175,666.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	114,089	29.27	3,339,385.03	
	ORANGE POLSKA SA	110,607	6.16	681,892.15	
	PGE SA	148,359	7.33	1,088,361.62	
ポーランドズロチ 小計		1,124,025		31,554,518.02 (852,918,622)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	53,022	131.53	6,973,983.66	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	9,699	1,212.00	11,755,188.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	77,932	497.24	38,750,907.68	
	GOLD FIELDS LTD	172,551	155.71	26,867,916.21	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,665	114.50	17,251,142.50	
	KUMBA IRON ORE LTD	13,805	490.57	6,772,318.85	
	NORTHAM PLATINUM LTD	73,043	109.73	8,015,008.39	
	SASOL LTD	111,300	140.00	15,582,000.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	435,901	36.00	15,692,436.00	
	BIDVEST GROUP LTD	51,937	149.00	7,738,613.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	81,412	106.71	8,687,474.52	
	MR PRICE GROUP LTD	53,931	145.72	7,858,825.32	
	NASPERS LTD-N SHS	84,574	3,167.51	267,888,990.74	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	123,600	11.41	1,410,276.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	207,846	33.61	6,985,704.06	
	BID CORP LTD	64,043	286.66	18,358,566.38	
	CLICKS GROUP LTD	45,600	218.04	9,942,624.00	
	PICK N PAY STORES LTD	55,770	52.54	2,930,155.80	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	101,866	107.83	10,984,210.78	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	32,210	175.00	5,636,750.00	
	TIGER BRANDS LTD	26,414	178.50	4,714,899.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	230,622	17.22	3,971,310.84	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	75,342	146.63	11,047,397.46	

	ABSA GROUP LTD	132,975	88.24	11,733,714.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,709	857.41	7,467,183.69	
	NEDBANK GROUP LTD	65,739	106.12	6,976,222.68	
	STANDARD BANK GROUP LTD	245,339	103.71	25,444,107.69	
	FIRSTRAND LTD	925,053	39.59	36,622,848.27	
	PSG GROUP LTD	33,344	158.62	5,289,025.28	
	REINET INVESTMENTS SCA	26,395	286.06	7,550,553.70	
	REMGRO LTD	101,024	103.21	10,426,687.04	
	DISCOVERY LTD	80,303	106.12	8,521,754.36	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN	144,183	18.00	2,595,294.00	
	OLD MUTUAL LTD	985,060	11.65	11,475,949.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	139,332	29.69	4,136,767.08	
	SANLAM LTD	346,686	58.82	20,392,070.52	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	82,474	87.55	7,220,598.70	
	MTN GROUP LTD	313,960	53.90	16,922,444.00	
	VODACOM GROUP LTD	130,082	123.51	16,066,427.82	
	南アフリカランド 小計	6,093,743		714,658,347.02 (4,395,148,834)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	57,700	5.68	327,736.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	242,225	3.97	961,633.25	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	41,728	14.68	612,567.04	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	26,000	6.54	170,040.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	331,200	2.73	904,176.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	4.60	193,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	308,400	4.26	1,313,784.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	79,200	7.26	574,992.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	28,400	5.85	166,140.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	39,000	6.37	248,430.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	38,870	3.73	144,985.10	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	30.94	281,554.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	21,055	8.80	185,284.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	124,400	2.77	344,588.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	50,680	2.55	129,234.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	49,000	54.10	2,650,900.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	176,396	4.60	811,421.60	
	BBMG CORPORATION-A	79,100	3.08	243,628.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	14,200	40.48	574,816.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	33,200	9.38	311,416.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	365,201	3.70	1,351,243.70	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	34,500	9.41	324,645.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	10,308	54.03	556,941.24	
	GEM CO LTD-A	39,400	4.92	193,848.00	

GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	28,700	6.70	192,290.00
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	9,000	35.80	322,200.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	55,700	13.76	766,432.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	35,148	8.93	313,871.64
HESTEEL CO LTD-A	100,800	2.06	207,648.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	12,900	24.27	313,083.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	40,200	3.82	153,564.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	433,400	1.08	468,072.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	80,316	2.58	207,215.28
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	48,700	13.35	650,145.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	2,900	81.51	236,379.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	19,700	13.28	261,616.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	25,500	6.09	155,295.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	19,300	17.87	344,891.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	56,600	2.59	146,594.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	81,700	2.04	166,668.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	90,700	11.98	1,086,586.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	23,300	6.81	158,673.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	24,660	36.48	899,596.80
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,500	18.09	280,395.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	113,700	2.02	229,674.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	9,200	32.67	300,564.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	24,600	9.36	230,256.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	8,600	100.97	868,342.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	54,100	3.34	180,694.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	58,100	3.50	203,350.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	12,800	16.55	211,840.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	26,600	25.80	686,280.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	17,600	13.02	229,152.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	100,100	1.91	191,191.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	30,906	5.50	169,983.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	29,800	50.02	1,490,596.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	4,900	62.00	303,800.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	11.75	157,450.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	18,900	15.71	296,919.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	6,400	66.46	425,344.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	10,250	38.32	392,780.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	26,100	6.85	178,785.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	30,900	12.68	391,812.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	32,700	8.96	292,992.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	281,300	4.38	1,232,094.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	10,900	13.66	148,894.00

AECC AVIATION POWER CO-A	21,400	23.35	499,690.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	26,300	17.71	465,773.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	34,300	7.91	271,313.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	8,800	32.25	283,800.00
AVICOPTER PLC-A	5,500	40.68	223,740.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	16,100	21.60	347,760.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	58,800	2.98	175,224.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	25,900	6.44	166,796.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	13,900	13.29	184,731.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	26,000	7.46	193,960.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	43,700	5.95	260,015.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	10,200	14.36	146,472.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	46,800	5.53	258,804.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	109,300	8.47	925,771.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	291,100	5.07	1,475,877.00
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	217,404	4.01	871,790.04
CHINA SPACESAT CO LTD -A	11,200	31.05	347,760.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	533,680	4.84	2,583,011.20
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	25,508	171.50	4,374,622.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	75,100	1.86	139,686.00
CRRC CORP LTD-A	231,325	5.59	1,293,106.75
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	26,100	8.97	234,117.00
EVE ENERGY CO LTD-A	17,488	44.38	776,117.44
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	36,143	6.45	233,122.35
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	10,800	26.62	287,496.00
GUOCHENG MINING CO LTD-A	37,800	18.43	696,654.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	6,400	53.10	339,840.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	7,100	39.09	277,539.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	16,100	10.23	164,703.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	8,400	76.26	640,584.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	29,200	11.30	329,960.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	169,634	2.52	427,477.68
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	26,700	25.43	678,981.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	43,900	20.73	910,047.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	121,200	3.51	425,412.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	79,516	18.53	1,473,431.48
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	3.08	260,260.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	77,300	5.06	391,138.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	29,774	5.74	170,902.76
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15,900	36.96	587,664.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	14,800	13.78	203,944.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	14,700	19.19	282,093.00

SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	25,400	7.84	199,136.00
TBEA CO LTD-A	35,200	6.87	241,824.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	56,851	13.54	769,762.54
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	74,400	5.88	437,472.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	8.89	239,141.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	32,800	9.98	327,344.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,500	26.12	535,460.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	75.40	348,348.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	34,113	21.88	746,392.44
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	15,000	11.81	177,150.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	21,000	12.08	253,680.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	60,900	6.25	380,625.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	30,000	8.20	246,000.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	15,800	18.97	299,726.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8,800	52.78	464,464.00
AIR CHINA LTD-A	142,600	6.65	948,290.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	88,800	4.25	377,400.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	81,800	5.18	423,724.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	276,200	3.44	950,128.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	141,289	7.07	998,913.23
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	19,688	15.33	301,817.04
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	443,900	1.51	670,289.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	15,600	9.16	142,896.00
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	83,600	3.54	295,944.00
S F HOLDING CO LTD-A	30,700	55.20	1,694,640.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	9,100	70.86	644,826.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	80,900	4.22	341,398.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	19,500	7.66	149,370.00
SINOTRANS LIMITED-A	41,600	3.24	134,784.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,700	36.20	314,940.00
STO EXPRESS CO LTD-A	37,900	16.64	630,656.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	18,460	24.59	453,931.40
BYD CO LTD -A	17,200	71.70	1,233,240.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,600	122.04	317,304.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	37,000	11.33	419,210.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,938	21.24	402,243.12
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	29,900	20.82	622,518.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	23.07	285,145.20
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	31,200	27.25	850,200.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	97,044	18.19	1,765,230.36
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	11,400	20.47	233,358.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	7,900	20.39	161,081.00

ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	20,800	6.42	133,536.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	40,593	57.22	2,322,731.46
HAIER SMART HOME CO LTD-A	57,929	17.92	1,038,087.68
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	31.77	285,930.00
JOYOUNG CO LTD -A	21,300	37.04	788,952.00
NAVINFO CO LTD-A	18,600	15.76	293,136.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	2,655	116.61	309,599.55
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	8,700	22.67	197,229.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	128,600	6.14	789,604.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	13,800	56.75	783,150.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	17,100	7.08	121,068.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	69.61	361,972.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	9,400	15.63	146,922.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	25,100	27.87	699,537.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	6,400	28.36	181,504.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	78,000	6.12	477,360.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	18.22	452,639.46
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	11.43	318,897.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	31,200	24.40	761,280.00
CHINA FILM CO LTD-A	14,700	12.94	190,218.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	17,000	10.65	181,050.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A	13,000	12.10	157,300.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,502	5.55	774,236.10
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	700	524.33	367,031.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	12,800	17.61	225,408.00
LEO GROUP CO LTD-A	173,000	4.03	697,190.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	25,280	62.90	1,590,112.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	23,400	22.60	528,840.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	32,600	9.69	315,894.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	12,200	56.10	684,420.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	19,800	15.55	307,890.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	20,000	43.50	870,000.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	8,400	25.97	218,148.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	50,600	15.73	795,938.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	26,299	127.30	3,347,862.70
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	14,500	18.70	271,150.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	8.80	271,040.00
SUNING.COM CO LTD-A	166,680	8.93	1,488,452.40
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.22	203,404.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	2,700	94.00	253,800.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	5,040	84.50	425,880.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	91,000	9.42	857,220.00

ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	46.30	361,140.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,600	149.88	539,568.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5,625	49.28	277,200.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	8.86	357,058.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	7,000	55.38	387,660.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	26,800	6.69	179,292.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	12,500	53.71	671,375.00
CHONGQING BREWERY CO-A	4,600	67.56	310,776.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	7,500	35.48	266,100.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	31,586	123.80	3,910,346.80
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	28.95	283,710.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	15,000	47.34	710,100.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	16,900	14.60	246,740.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	26,200	43.83	1,148,346.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	82,100	30.82	2,530,322.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	11,890	38.01	451,938.90
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	14,281	105.33	1,504,217.73
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	23,200	16.85	390,920.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	56.21	427,196.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	5,500	69.08	379,940.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,378	1,460.01	19,532,013.78
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	13,900	92.46	1,285,194.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	38,760	75.20	2,914,752.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	40,000	28.40	1,136,000.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,300	138.18	1,146,894.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	4,600	62.36	286,856.00
TOLY BREAD CO LTD-A	5,200	49.79	258,908.00
TONGWEI CO LTD-A	37,000	17.20	636,400.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	72.20	476,520.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	60,540	21.90	1,325,826.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,100	168.61	6,929,871.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	12,500	16.33	204,125.00
BY-HEALTH CO LTD-A	15,000	22.01	330,150.00
C&S PAPER CO LTD-A	35,999	21.23	764,258.77
PROYA COSMETICS CO LTD-A	4,500	173.85	782,325.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	6,400	46.80	299,520.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	38,252	44.05	1,685,000.60
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	2,700	167.15	451,305.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	3,600	47.90	172,440.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	7,200	49.52	356,544.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	86.35	379,940.00
GUANGZHOU WONFO BIOTECH C-A	7,700	96.52	743,204.00

HUADONG MEDICINE CO LTD-A	16,640	24.10	401,024.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	7,600	65.28	496,128.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	9,500	33.82	321,290.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	17,800	17.88	318,264.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,960	35.79	606,998.40
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	13.45	478,282.00
OVCTEK CHINA INC-A	5,700	66.50	379,050.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	18,300	18.49	338,367.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	10,600	299.19	3,171,414.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,000	156.30	468,900.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	20,020	20.47	409,809.40
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	15,000	22.00	330,000.00
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	2,200	231.00	508,200.00
BEIJING Tiantan Biological-A	9,900	43.88	434,412.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	13,000	26.69	346,970.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3,800	135.71	515,698.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	3,800	145.98	554,724.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	5,200	417.60	2,171,520.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	6,900	44.70	308,430.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,300	28.62	266,166.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	21,098	99.90	2,107,690.20
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	12,100	27.02	326,942.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	6,200	37.17	230,454.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,400	32.04	429,336.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	97.62	692,028.18
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	17,290	48.03	830,438.70
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	7,800	23.88	186,264.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	57,636	92.95	5,357,266.20
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	11,100	15.71	174,381.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	10,700	26.25	280,875.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	16.26	299,184.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	47.18	273,644.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	5,700	59.30	338,010.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	10,780	27.33	294,617.40
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	19,200	32.66	627,072.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	57,900	8.42	487,518.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	9,900	23.84	236,016.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,041	153.70	928,501.70
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	8,200	27.49	225,418.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	11,500	30.58	351,670.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	13,600	20.74	282,064.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	132,800	5.45	723,760.00

TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,300	15.67	302,431.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	14,680	53.67	787,875.60
WUXI APPTec CO LTD-A	19,460	95.88	1,865,824.80
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	11,700	22.85	267,345.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,100	94.10	1,138,610.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	5,800	165.26	958,508.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	25,300	5.57	140,921.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	13,860	33.27	461,122.20
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	20,400	28.20	575,280.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	5,000	59.82	299,100.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	708,100	3.37	2,386,297.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	200,800	4.90	983,920.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	34,393	7.95	273,424.35
BANK OF CHINA LTD-A	333,900	3.46	1,155,294.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	506,033	5.12	2,590,888.96
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	48,700	9.07	441,709.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	109,620	5.69	623,737.80
BANK OF NANJING CO LTD -A	169,500	7.41	1,255,995.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	80,011	26.11	2,089,087.21
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	134,969	8.24	1,112,144.56
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	53,900	5.07	273,273.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	91,200	6.32	576,384.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	378,310	3.59	1,358,132.90
CHINA MERCHANTS BANK-A	235,999	33.90	8,000,366.10
CHINA MINSHENG BANKING-A	430,928	5.67	2,443,361.76
HUAXIA BANK CO LTD-A	198,750	6.13	1,218,337.50
IND & COMM BK OF CHINA-A	646,128	5.22	3,372,788.16
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	228,374	15.84	3,617,444.16
JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A	26,000	7.49	194,740.00
PING AN BANK CO LTD-A	203,161	12.80	2,600,460.80
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	156,900	4.45	698,205.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	327,937	10.60	3,476,132.20
AVIC CAPITAL CO LTD -A	85,300	3.97	338,641.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	34,125	10.59	361,383.75
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	52,500	6.90	362,250.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	70,200	11.54	810,108.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	12.73	738,340.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	54,300	20.17	1,095,231.00
CITIC SECURITIES CO-A	119,445	24.25	2,896,541.25
CSC FINANCIAL CO LTD-A	26,300	37.95	998,085.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	11.04	289,248.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	76,597	19.18	1,469,130.46

EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	37,200	14.79	550,188.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	33,200	7.04	233,728.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	78,300	7.13	558,279.00
GF SECURITIES CO LTD-A	56,200	14.37	807,594.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	39,000	11.35	442,650.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	114,300	17.36	1,984,248.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	8.65	275,935.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	133,879	12.87	1,723,022.73
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,130	128.02	656,742.60
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	34,400	6.81	234,264.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	108,940	19.46	2,119,972.40
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	24,900	10.94	272,406.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	63,600	6.15	391,140.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	31,300	14.65	458,545.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	22,200	8.66	192,252.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	56,800	9.63	546,984.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	64,800	3.23	209,304.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	33,500	12.77	427,795.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	40,000	4.41	176,400.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	26,900	6.39	171,891.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	214,214	4.84	1,036,795.76
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	28,700	11.52	330,624.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	28,500	8.29	236,265.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	4.62	248,094.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	115,900	6.25	724,375.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	33,200	8.25	273,900.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	26,400	10.11	266,904.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	26,400	28.23	745,272.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	75,700	27.51	2,082,507.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	47,000	5.28	248,160.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	19,786	44.82	886,808.52
PICC HOLDING CO-A	81,000	6.47	524,070.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	122,522	72.26	8,853,439.72
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	24,500	5.83	142,835.00
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	38,700	4.08	157,896.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	28,500	22.95	654,075.00
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	21,688	30.33	657,797.04
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	75,223	16.69	1,255,471.87
CHINA VANKE CO LTD -A	111,356	26.40	2,939,798.40
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	28,300	6.65	188,195.00
GEMDALE CORP-A	42,900	13.43	576,147.00
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	31,100	5.08	157,988.00

GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	77,200	5.67	437,724.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	35,200	8.87	312,224.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	50,700	8.03	407,121.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	32,901	3.80	125,023.80
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	113,000	14.74	1,665,620.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	41,300	8.12	335,356.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	21,500	31.77	683,055.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	14,800	18.95	280,460.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	28,600	5.44	155,584.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	81,700	3.00	245,100.00
YANGO GROUP CO LTD-A	38,500	6.56	252,560.00
YOUNGOR GROUP CO-A	106,400	6.01	639,464.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	229,500	3.25	745,875.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	51,100	18.89	965,279.00
AISINO CORP-A	17,800	16.63	296,014.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	14,300	52.50	750,750.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	8,400	39.00	327,600.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	14,700	26.53	389,991.00
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	26,700	27.97	746,799.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	4,700	79.12	371,864.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	14,100	22.97	323,877.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	29,500	12.39	365,505.00
GLODON CO LTD-A	10,700	69.95	748,465.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	10,049	103.97	1,044,794.53
IFLYTEK CO LTD - A	21,000	36.58	768,180.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	9,900	15.90	157,410.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,200	189.76	607,232.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	54,860	2.77	151,962.20
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	8,000	58.58	468,640.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	8,200	18.73	153,586.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	11,800	69.12	815,616.00
VENUSTECH GROUP INC-A	8,500	40.98	348,330.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	23,200	8.79	203,928.00
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	32,300	22.51	727,073.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	30,615	43.70	1,337,875.50
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	6,400	32.59	208,576.00
ADDSINO CO LTD -A	15,000	13.42	201,300.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	10,000	37.36	373,600.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	321,800	4.53	1,457,754.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	16,597	25.74	427,206.78
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	27,800	13.04	362,512.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	12,040	39.66	477,506.40

FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	11,100	29.17	323,787.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	88,700	15.52	1,376,624.00	
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	8,000	34.55	276,400.00	
GOERTEK INC -A	30,800	27.16	836,528.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	22,900	12.12	277,548.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	21,800	12.76	278,168.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	8,400	95.90	805,560.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	102,910	30.27	3,115,085.70	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	18,000	16.56	298,080.00	
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	29,600	5.23	154,808.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	33,500	24.47	819,745.00	
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	9,500	13.32	126,540.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	12,300	41.80	514,140.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	31,100	25.51	793,361.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	24,200	6.13	148,346.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	54,200	10.93	592,406.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	66,012	49.04	3,237,228.48	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	169.04	743,776.00	
NINESTAR CORP-A	10,100	34.46	348,046.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	25,700	17.50	449,750.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	21,600	29.88	645,408.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,480	167.09	748,563.20	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	29,600	23.71	701,816.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	9,200	50.02	460,184.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	15,300	29.44	450,432.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	9,000	36.60	329,400.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	19,400	15.28	296,432.00	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	16,120	42.58	686,389.60	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	13,800	21.36	294,768.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	8,000	21.34	170,720.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	10,000	126.19	1,261,900.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	15,130	26.69	403,819.70	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	20,000	10.75	215,000.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	16,400	24.96	409,344.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	8,400	46.05	386,820.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,050	67.00	472,350.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,500	19.09	544,065.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	5,700	62.10	353,970.00	
ZTE CORP-A	44,200	39.71	1,755,182.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	295,000	4.87	1,436,650.00	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	28,400	4.59	130,356.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	123,205	4.12	507,604.60	

	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	241,064	19.09	4,601,911.76	
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	186,400	1.85	344,840.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	64,400	3.42	220,248.00	
	HUANENG POWER INTL INC-A	157,200	4.21	661,812.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	41,300	3.52	145,376.00	
	INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	55,000	2.47	135,850.00	
	LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	15,000	14.06	210,900.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	64,500	7.88	508,260.00	
	SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	24,800	7.40	183,520.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	46,600	5.92	275,872.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	37,560	4.72	177,283.20	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	41,800	9.30	388,740.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	48,300	2.57	124,131.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,340	244.07	1,059,263.80	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	12,500	14.79	184,875.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	50,434	38.00	1,916,492.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	38,800	24.20	938,960.00	
	SG MICRO CORP-A	2,700	300.40	811,080.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	3,600	226.28	814,608.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	26,500	20.89	553,585.00	
	TIANSUI HUATIAN TECHNOLOG-A	51,100	13.66	698,026.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	24.29	706,839.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	5,700	71.59	408,063.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	13,000	14.03	182,390.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,500	206.68	1,136,740.00	
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	58,800	11.95	702,660.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	29,700	24.30	721,710.00	
	オフショア元 小計	25,077,409		349,233,195.60 (5,283,898,249)	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	32,700	13.38	437,526.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	226,598	32.80	7,432,414.40	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	17,512	53.00	928,136.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	48,940	10.12	495,272.80	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	77,416	14.14	1,094,662.24	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	41,469	74.30	3,081,146.70	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	86,949	35.30	3,069,299.70	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	170,252	87.80	14,948,125.60	
	SAUDI CEMENT	11,200	51.00	571,200.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	32,930	20.02	659,258.60	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	144,273	8.29	1,196,023.17	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,276	51.60	2,645,841.60	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	6,030	78.80	475,164.00	

	JARIR MARKETING CO	12,646	145.80	1,843,786.80	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	8,000	114.20	913,600.00	
	ALMARAI CO	46,959	55.00	2,582,745.00	
	SAVOLA	52,366	44.90	2,351,233.40	
	AL RAJHI BANK	233,789	57.50	13,442,867.50	
	ALINMA BANK	200,518	14.60	2,927,562.80	
	ARAB NATIONAL BANK	106,309	19.42	2,064,520.78	
	BANK AL-JAZIRA	81,590	11.18	912,176.20	
	BANK ALBILAD	63,262	22.12	1,399,355.44	
	BANQUE SAUDI FRANSI	119,495	30.05	3,590,824.75	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	279,052	37.25	10,394,687.00	
	RIYAD BANK	265,259	16.72	4,435,130.48	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	181,351	23.00	4,171,073.00	
	SAUDI BRITISH BANK	142,160	21.82	3,101,931.20	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	10,773	114.40	1,232,431.20	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	14,550	70.00	1,018,500.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	117,066	6.99	818,291.34	
	EMAAR ECONOMIC CITY	57,120	6.71	383,275.20	
	ETIHAD ETISALAT CO	78,370	27.15	2,127,745.50	
	SAUDI TELECOM CO	115,569	99.00	11,441,331.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	150,064	15.96	2,395,021.44	
	サウジアラビアリアル 小計	3,283,813		110,582,160.84 (3,161,543,978)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	20,156	89.00	1,793,884.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	294,834	8.37	2,467,760.58	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	77,548	31.50	2,442,762.00	
	KOC HOLDING AS	155,842	17.10	2,664,898.20	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	26,912	19.10	514,019.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,226	12.40	1,069,202.40	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	14,221	71.35	1,014,668.35	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	89,057	70.95	6,318,594.15	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	50,431	20.28	1,022,740.68	
	AKBANK T.A.S.	562,940	5.96	3,355,122.40	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	460,073	8.19	3,767,997.87	
	TURKIYE IS BANKASI-C	268,383	5.34	1,433,165.22	
	YAPI VE KREDI BANKASI	515,884	2.36	1,217,486.24	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	136,771	9.00	1,230,939.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	215,914	16.70	3,605,763.80	
	トルコリラ 小計	2,975,192		33,919,004.09 (529,814,843)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,079	13.60	123,474.40	
	FF GROUP	5,889	4.80	28,267.20	

	OPAP SA	39,461	8.92	352,189.42	
	JUMBO SA	22,412	16.26	364,419.12	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	42,454	12.40	526,429.60	
ユーロ 小計		119,295		1,394,779.74 (168,098,854)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	83,268	16.72	1,392,240.96	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	775,129	2.12	1,650,249.64	
	INDUSTRIES QATAR	308,520	8.10	2,500,863.12	
	COMMERCIAL BANK PSQC	434,616	3.89	1,694,567.78	
	MASRAF AL RAYAN	681,547	3.87	2,641,676.17	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	144,077	8.50	1,224,654.50	
	QATAR ISLAMIC BANK	222,208	16.00	3,555,328.00	
	QATAR NATIONAL BANK	868,021	18.29	15,876,104.09	
	BARWA REAL ESTATE CO	334,664	2.96	990,605.44	
	QOOREDOO QPSC	128,720	6.66	858,047.52	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	112,139	16.17	1,813,287.63	
カタールリアル 小計		4,092,909		34,197,624.85 (1,000,280,526)	
合 計		1,139,602,201		119,436,374,066 (119,436,374,066)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
メキシコ ペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	621,800	12,380,038.00	
メキシコペソ合計			621,800	12,380,038.00 (58,309,978)	
南アフリ カランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	537,442	7,551,060.10	
南アフリカランド合計			537,442	7,551,060.10 (46,439,019)	
合 計				104,748,997 (104,748,997)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 61銘柄	100.00%	—	16.26%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.00%	—	0.08%
香港ドル	株式 208銘柄	100.00%	—	23.95%
マレーシアリングット	株式 39銘柄	100.00%	—	1.75%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.00%	—	2.23%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.00%	—	0.82%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.00%	—	1.49%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.23%	—	1.71%
	投資証券 1銘柄	—	2.77%	0.05%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	100.00%	—	5.18%
チリペソ	株式 16銘柄	100.00%	—	0.60%
韓国ウォン	株式 108銘柄	100.00%	—	11.75%
ニュー台湾ドル	株式 89銘柄	100.00%	—	12.20%
インドルピー	株式 86銘柄	100.00%	—	7.97%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%	—	0.11%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.00%	—	0.19%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%	—	0.24%
アラブディルハム	株式 7銘柄	100.00%	—	0.52%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.00%	—	0.71%
南アフリカランド	株式 39銘柄	98.95%	—	3.68%
	投資証券 1銘柄	—	1.05%	0.04%
オフショア元	株式 471銘柄	100.00%	—	4.42%
サウジアラビアリヤル	株式 34銘柄	100.00%	—	2.64%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.00%	—	0.44%
ユーロ	株式 5銘柄	100.00%	—	0.14%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.00%	—	0.84%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,754,604,595
国債証券	494,480,723,560
地方債証券	28,271,978,402
特殊債証券	39,498,642,189
社債証券	29,843,027,000
派生商品評価勘定	1,835,600
未収入金	1,419,922,000
未収利息	754,489,860
前払費用	36,936,377
差入委託証拠金	3,720,000
流動資産合計	597,065,879,583
資産合計	597,065,879,583
負債の部	
流動負債	
前受金	1,920,000
未払金	1,715,245,000
未払解約金	92,876,141
未払利息	4,040
流動負債合計	1,810,045,181
負債合計	1,810,045,181
純資産の部	
元本等	
元本	442,030,576,547
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	153,225,257,855
元本等合計	595,255,834,402
純資産合計	595,255,834,402
負債純資産合計	597,065,879,583

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	467,522,146,188円
期中追加設定元本額	299,294,691,329円
期中一部解約元本額	324,786,260,970円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（国内債券）	141,827,459,637円
e M A X I S 国内債券インデックス	8,567,272,574円

	[令和 2年 6月25日現在]
e M A X I S バランス（８資産均等型）	2,557,313,504円
e M A X I S バランス（波乗り型）	69,868,437円
コアバランス	1,724,984円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	648,458,871円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	367,287,968円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	143,466,247円
e M A X I S S l i m 国内債券インデックス	6,625,728,162円
国内債券セレクション（ラップ向け）	3,550,550,949円
e M A X I S S l i m バランス（８資産均等型）	4,634,478,804円
つみたて８資産均等バランス	1,897,810,794円
つみたて４資産均等バランス	556,554,391円
e M A X I S マイマネージャー １９７０ｓ	4,206,640円
e M A X I S マイマネージャー １９８０ｓ	1,057,469円
e M A X I S マイマネージャー １９９０ｓ	78,095円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	245,397,963円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	96,826,363円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	29,926,714円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	29,951,757円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	6,767,261円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	10,637,637,375円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	10,756,551,601円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,120,435,675円
三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	3,710,771,683円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	6,018,757,930円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	227,472,337円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	253,999,563円
e M A X I S 債券バランス（２資産均等型）	66,969,667円
e M A X I S バランス（４資産均等型）	426,364,065円
e M A X I S 最適化バランス（マイゴールキーパー）	707,036,656円
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	386,401,173円
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	726,179,457円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	66,273,714円
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	13,809,809円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,909,366円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,197,514,669円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,143,742,763円

	[令和 2年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	4,845,106,831円
MUAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	132,987,617,442円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	516,630,668円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,472,472円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	4,404,057円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,740,460,854円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,258,785,708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）	20,033,909,074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）	8,035,762,254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）	4,178,410,031円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	229,232,334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）	18,950,656,529円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,180,502,964円
MUKAM 日本債券インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	5,849,477,655円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	3,932,878,836円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	15,601,807円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	29,091,726円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	10,452,669円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	12,078,958円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	87,055,533円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	207,108,237円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	65,462,299円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	129,105,837円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>日本債券インデックスファンド	4,150,966,667円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	1,999,543,505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）	3,758,555,072円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	2,120,873,374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）	1,281,358,067円
合計	442,030,576,547円
２．受益権の総数	442,030,576,547口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１ 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
２．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
３．金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は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 6月25日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,981,815,700
地方債証券	31,595,280
特殊債券	71,594,175
社債券	43,850,500
合計	3,041,154,655

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

[令和 2年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	606,560,000	—	608,400,000	1,840,000
合計		606,560,000	—	608,400,000	1,840,000

（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 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.3466円
(1万口当たり純資産額)	(13,466円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第４０３回利付国債（２年）	1,100,000,000	1,103,267,000	
	第４０４回利付国債（２年）	1,150,000,000	1,153,680,000	
	第４０７回利付国債（２年）	350,000,000	351,305,500	
	第４０８回利付国債（２年）	3,150,000,000	3,162,442,500	
	第４０９回利付国債（２年）	6,300,000,000	6,326,271,000	
	第４１０回利付国債（２年）	400,000,000	401,716,000	
	第４１２回利付国債（２年）	550,000,000	552,596,000	
	第１２９回利付国債（５年）	3,100,000,000	3,110,168,000	
	第１３０回利付国債（５年）	4,950,000,000	4,969,156,500	
	第１３１回利付国債（５年）	5,010,000,000	5,031,743,400	
	第１３２回利付国債（５年）	3,850,000,000	3,868,749,500	
	第１３３回利付国債（５年）	4,900,000,000	4,926,901,000	
	第１３４回利付国債（５年）	9,360,000,000	9,417,189,600	
	第１３６回利付国債（５年）	1,550,000,000	1,561,377,000	
	第１３７回利付国債（５年）	5,400,000,000	5,442,120,000	
	第１３８回利付国債（５年）	5,150,000,000	5,192,333,000	
	第１３９回利付国債（５年）	2,100,000,000	2,118,501,000	
	第１４０回利付国債（５年）	3,860,000,000	3,895,512,000	
	第１４１回利付国債（５年）	4,270,000,000	4,310,906,600	
	第１４２回利付国債（５年）	5,870,000,000	5,926,880,300	
	第１４３回利付国債（５年）	2,500,000,000	2,524,350,000	
	第１回利付国債（４０年）	475,000,000	702,496,500	
	第２回利付国債（４０年）	870,000,000	1,249,407,000	
	第３回利付国債（４０年）	733,000,000	1,059,646,790	
	第４回利付国債（４０年）	1,098,000,000	1,599,489,540	
	第５回利付国債（４０年）	1,135,000,000	1,601,246,650	
	第６回利付国債（４０年）	1,060,000,000	1,475,339,800	
	第７回利付国債（４０年）	1,280,000,000	1,715,904,000	
	第８回利付国債（４０年）	1,280,000,000	1,606,630,400	
	第９回利付国債（４０年）	1,950,000,000	1,829,860,500	
	第１０回利付国債（４０年）	2,400,000,000	2,640,528,000	
	第１１回利付国債（４０年）	1,630,000,000	1,741,003,000	

第１２回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,728,298,700	
第３１７回利付国債（１０年）	1,957,000,000	1,987,764,040	
第３１８回利付国債（１０年）	2,480,000,000	2,515,910,400	
第３１９回利付国債（１０年）	1,719,000,000	1,751,231,250	
第３２０回利付国債（１０年）	1,980,000,000	2,014,174,800	
第３２１回利付国債（１０年）	2,515,000,000	2,565,199,400	
第３２２回利付国債（１０年）	1,470,000,000	1,496,783,400	
第３２３回利付国債（１０年）	1,675,000,000	1,709,806,500	
第３２４回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,852,612,000	
第３２５回利付国債（１０年）	3,835,000,000	3,916,263,650	
第３２６回利付国債（１０年）	730,000,000	745,381,100	
第３２７回利付国債（１０年）	2,540,000,000	2,599,842,400	
第３２８回利付国債（１０年）	3,700,000,000	3,775,591,000	
第３２９回利付国債（１０年）	5,860,000,000	6,025,017,600	
第３３０回利付国債（１０年）	3,330,000,000	3,431,731,500	
第３３１回利付国債（１０年）	1,060,000,000	1,085,493,000	
第３３２回利付国債（１０年）	5,040,000,000	5,169,679,200	
第３３３回利付国債（１０年）	6,550,000,000	6,730,518,000	
第３３４回利付国債（１０年）	4,330,000,000	4,456,565,900	
第３３５回利付国債（１０年）	4,470,000,000	4,588,946,700	
第３３６回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,988,446,000	
第３３７回利付国債（１０年）	940,000,000	957,578,000	
第３３８回利付国債（１０年）	3,580,000,000	3,665,955,800	
第３３９回利付国債（１０年）	6,660,000,000	6,828,431,400	
第３４０回利付国債（１０年）	2,250,000,000	2,311,020,000	
第３４１回利付国債（１０年）	4,270,000,000	4,367,783,000	
第３４２回利付国債（１０年）	6,440,000,000	6,519,856,000	
第３４３回利付国債（１０年）	5,260,000,000	5,328,117,000	
第３４４回利付国債（１０年）	4,660,000,000	4,721,418,800	
第３４５回利付国債（１０年）	4,440,000,000	4,500,872,400	
第３４６回利付国債（１０年）	4,590,000,000	4,655,361,600	
第３４７回利付国債（１０年）	4,120,000,000	4,179,410,400	
第３４８回利付国債（１０年）	5,100,000,000	5,174,307,000	
第３４９回利付国債（１０年）	4,290,000,000	4,353,063,000	
第３５０回利付国債（１０年）	5,070,000,000	5,142,957,300	
第３５１回利付国債（１０年）	5,510,000,000	5,587,415,500	
第３５２回利付国債（１０年）	3,570,000,000	3,618,766,200	
第３５３回利付国債（１０年）	5,130,000,000	5,195,561,400	
第３５４回利付国債（１０年）	5,000,000,000	5,061,300,000	
第３５５回利付国債（１０年）	5,350,000,000	5,410,187,500	
第３５６回利付国債（１０年）	6,200,000,000	6,265,906,000	
第３５７回利付国債（１０年）	4,400,000,000	4,441,712,000	

第 3 5 8 回利付国債（ 1 0 年 ）	4,870,000,000	4,912,563,800	
第 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	76,000,000	95,696,920	
第 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	98,000,000	120,649,760	
第 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	117,000,000	143,423,280	
第 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	127,000,000	164,712,650	
第 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	108,000,000	133,024,680	
第 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	169,000,000	213,303,350	
第 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	164,000,000	206,303,800	
第 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	142,000,000	171,061,720	
第 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	116,000,000	134,098,320	
第 1 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	185,000,000	207,085,300	
第 1 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	137,000,000	164,043,800	
第 1 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	220,000,000	275,495,000	
第 1 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	205,000,000	254,622,300	
第 1 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	493,000,000	640,515,460	
第 1 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	346,000,000	455,491,700	
第 1 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	302,000,000	398,694,360	
第 1 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	327,000,000	428,268,630	
第 1 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	427,000,000	554,519,280	
第 1 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	303,000,000	394,702,950	
第 2 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	495,000,000	660,884,400	
第 2 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	379,000,000	495,932,870	
第 2 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	570,000,000	765,276,300	
第 2 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	554,000,000	746,149,360	
第 2 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	411,000,000	554,845,890	
第 2 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	742,000,000	981,272,740	
第 2 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	884,000,000	1,186,372,200	
第 2 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	860,000,000	1,173,908,600	
第 2 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	911,000,000	1,249,472,940	
第 2 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,450,000,000	1,973,058,500	
第 3 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,496,000,000	2,019,450,400	
第 3 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,358,000,000	1,817,316,340	
第 3 2 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,739,000,000	2,369,248,380	
第 3 3 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,644,000,000	2,156,599,200	
第 3 4 回利付国債（ 3 0 年 ）	2,116,000,000	2,869,867,320	
第 3 5 回利付国債（ 3 0 年 ）	2,069,000,000	2,735,673,180	
第 3 6 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,829,000,000	2,426,205,080	
第 3 7 回利付国債（ 3 0 年 ）	2,707,000,000	3,546,982,100	
第 3 8 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,145,000,000	1,480,553,700	
第 3 9 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,040,000,000	1,369,794,400	
第 4 0 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,610,000,000	2,086,962,500	
第 4 1 回利付国債（ 3 0 年 ）	1,410,000,000	1,799,639,400	

第４２回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,405,360,000	
第４３回利付国債（３０年）	890,000,000	1,138,212,100	
第４４回利付国債（３０年）	590,000,000	755,282,600	
第４５回利付国債（３０年）	1,850,000,000	2,285,971,000	
第４６回利付国債（３０年）	1,900,000,000	2,349,198,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,780,000,000	2,244,758,000	
第４８回利付国債（３０年）	1,760,000,000	2,138,892,800	
第４９回利付国債（３０年）	1,760,000,000	2,139,808,000	
第５０回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,350,795,600	
第５１回利付国債（３０年）	1,830,000,000	1,737,841,200	
第５２回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,656,148,800	
第５３回利付国債（３０年）	880,000,000	898,471,200	
第５４回利付国債（３０年）	1,650,000,000	1,766,704,500	
第５５回利付国債（３０年）	1,760,000,000	1,883,288,000	
第５６回利付国債（３０年）	1,720,000,000	1,839,282,000	
第５７回利付国債（３０年）	1,110,000,000	1,186,157,100	
第５８回利付国債（３０年）	2,640,000,000	2,819,150,400	
第５９回利付国債（３０年）	1,010,000,000	1,051,834,200	
第６０回利付国債（３０年）	2,440,000,000	2,664,992,400	
第６１回利付国債（３０年）	2,340,000,000	2,432,430,000	
第６２回利付国債（３０年）	200,000,000	197,274,000	
第６３回利付国債（３０年）	30,000,000	28,767,000	
第６４回利付国債（３０年）	2,360,000,000	2,259,440,400	
第６５回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,338,232,000	
第６６回利付国債（３０年）	810,000,000	773,023,500	
第５２回利付国債（２０年）	214,000,000	220,013,400	
第５４回利付国債（２０年）	480,000,000	496,824,000	
第５５回利付国債（２０年）	241,000,000	250,008,580	
第５６回利付国債（２０年）	449,000,000	468,158,830	
第５８回利付国債（２０年）	147,000,000	153,741,420	
第５９回利付国債（２０年）	589,000,000	616,099,890	
第６１回利付国債（２０年）	289,000,000	298,074,600	
第６３回利付国債（２０年）	442,000,000	467,689,040	
第６４回利付国債（２０年）	441,000,000	470,163,330	
第６５回利付国債（２０年）	318,000,000	340,597,080	
第６６回利付国債（２０年）	500,000,000	533,780,000	
第６８回利付国債（２０年）	846,000,000	919,906,560	
第７０回利付国債（２０年）	422,000,000	464,655,760	
第７１回利付国債（２０年）	160,000,000	174,892,800	
第７２回利付国債（２０年）	534,000,000	584,591,160	
第７３回利付国債（２０年）	620,000,000	679,110,800	
第７４回利付国債（２０年）	318,000,000	349,752,300	

第 7 5 回利付国債（ 2 0 年）	575,000,000	635,288,750	
第 7 6 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	219,068,000	
第 7 7 回利付国債（ 2 0 年）	210,000,000	231,018,900	
第 7 8 回利付国債（ 2 0 年）	410,000,000	451,069,700	
第 7 9 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	55,258,500	
第 8 0 回利付国債（ 2 0 年）	315,000,000	349,706,700	
第 8 1 回利付国債（ 2 0 年）	350,000,000	388,783,500	
第 8 2 回利付国債（ 2 0 年）	662,000,000	738,844,960	
第 8 3 回利付国債（ 2 0 年）	413,000,000	463,365,350	
第 8 4 回利付国債（ 2 0 年）	670,000,000	748,008,100	
第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	490,000,000	552,455,400	
第 8 6 回利付国債（ 2 0 年）	515,000,000	586,585,000	
第 8 7 回利付国債（ 2 0 年）	450,000,000	509,953,500	
第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	804,000,000	920,700,600	
第 8 9 回利付国債（ 2 0 年）	410,000,000	467,043,300	
第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,100,000,000	1,259,137,000	
第 9 1 回利付国債（ 2 0 年）	468,000,000	538,644,600	
第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,432,000,000	1,638,165,040	
第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	390,000,000	445,653,000	
第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	615,000,000	706,930,200	
第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,017,000,000	1,188,649,260	
第 9 6 回利付国債（ 2 0 年）	320,000,000	369,507,200	
第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	343,000,000	400,349,600	
第 9 8 回利付国債（ 2 0 年）	470,000,000	545,162,400	
第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	1,345,000,000	1,566,965,350	
第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,060,000,000	1,248,012,200	
第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	573,000,000	683,548,890	
第 1 0 2 回利付国債（ 2 0 年）	530,000,000	635,099,000	
第 1 0 3 回利付国債（ 2 0 年）	640,000,000	761,772,800	
第 1 0 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	352,263,000	
第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	870,000,000	1,025,529,900	
第 1 0 6 回利付国債（ 2 0 年）	711,000,000	843,985,440	
第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	567,000,000	670,585,230	
第 1 0 8 回利付国債（ 2 0 年）	800,000,000	932,528,000	
第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	800,000,000	935,576,000	
第 1 1 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,096,000,000	1,300,930,080	
第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	711,000,000	853,434,630	
第 1 1 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,340,000,000	1,596,382,200	
第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	1,182,000,000	1,413,199,200	
第 1 1 4 回利付国債（ 2 0 年）	1,520,000,000	1,822,753,600	
第 1 1 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,154,000,000	1,394,793,640	
第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	246,000,000	298,375,860	

第１１７回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,311,477,100	
第１１８回利付国債（２０年）	1,076,000,000	1,288,273,280	
第１１９回利付国債（２０年）	660,000,000	777,051,000	
第１２０回利付国債（２０年）	760,000,000	879,639,200	
第１２１回利付国債（２０年）	1,139,000,000	1,355,649,190	
第１２２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,368,811,600	
第１２３回利付国債（２０年）	1,368,000,000	1,661,367,600	
第１２４回利付国債（２０年）	900,000,000	1,083,609,000	
第１２５回利付国債（２０年）	2,304,000,000	2,831,247,360	
第１２７回利付国債（２０年）	350,000,000	418,890,500	
第１２８回利付国債（２０年）	1,534,000,000	1,840,968,740	
第１３０回利付国債（２０年）	2,652,000,000	3,161,687,880	
第１３１回利付国債（２０年）	280,000,000	330,694,000	
第１３２回利付国債（２０年）	187,000,000	221,348,160	
第１３３回利付国債（２０年）	2,540,000,000	3,035,452,400	
第１３４回利付国債（２０年）	2,975,000,000	3,561,432,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,482,000,000	1,760,690,100	
第１３８回利付国債（２０年）	400,000,000	465,760,000	
第１３９回利付国債（２０年）	400,000,000	470,492,000	
第１４０回利付国債（２０年）	2,397,000,000	2,853,676,440	
第１４１回利付国債（２０年）	420,000,000	501,009,600	
第１４２回利付国債（２０年）	3,510,000,000	4,230,111,600	
第１４３回利付国債（２０年）	2,010,000,000	2,377,066,200	
第１４４回利付国債（２０年）	230,000,000	269,125,300	
第１４５回利付国債（２０年）	2,860,000,000	3,424,564,000	
第１４６回利付国債（２０年）	3,340,000,000	4,006,664,000	
第１４７回利付国債（２０年）	2,690,000,000	3,197,091,900	
第１４８回利付国債（２０年）	2,280,000,000	2,683,286,400	
第１４９回利付国債（２０年）	2,700,000,000	3,181,788,000	
第１５０回利付国債（２０年）	2,910,000,000	3,393,321,900	
第１５１回利付国債（２０年）	3,440,000,000	3,918,710,400	
第１５２回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,758,388,600	
第１５３回利付国債（２０年）	2,660,000,000	3,072,246,800	
第１５４回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,978,271,000	
第１５５回利付国債（２０年）	2,110,000,000	2,345,898,000	
第１５６回利付国債（２０年）	2,530,000,000	2,579,613,300	
第１５７回利付国債（２０年）	2,090,000,000	2,064,418,400	
第１５８回利付国債（２０年）	2,110,000,000	2,180,389,600	
第１５９回利付国債（２０年）	2,170,000,000	2,275,830,900	
第１６０回利付国債（２０年）	2,620,000,000	2,789,173,400	
第１６１回利付国債（２０年）	2,900,000,000	3,038,127,000	
第１６２回利付国債（２０年）	1,550,000,000	1,622,214,500	

	第１６３回利付国債（２０年）	2,360,000,000	2,467,356,400	
	第１６４回利付国債（２０年）	3,100,000,000	3,185,591,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,393,166,300	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,820,000,000	1,930,838,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,680,000,000	2,745,016,800	
	第１６８回利付国債（２０年）	2,370,000,000	2,384,528,100	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,282,710,000	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,296,564,500	
	第１７１回利付国債（２０年）	2,060,000,000	2,028,255,400	
	第１７２回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,102,013,000	
国債証券 合計		456,801,000,000	494,480,723,560	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	20,000,000	20,904,200	
	第４回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	218,588,000	
	第７回東京都公募公債（２０年）	560,000,000	621,700,800	
	第７回東京都公募公債（３０年）	10,000,000	13,596,700	
	第８回東京都公募公債（３０年）	80,000,000	104,875,200	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	94,494,400	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	95,534,400	
	第２２回東京都公募公債（２０年）	120,000,000	141,105,600	
	第２８回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,315,000	
	第３３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	96,549,000	
	第７００回東京都公募公債	200,000,000	202,460,000	
	第７０５回東京都公募公債	170,000,000	173,039,600	
	第７２２回東京都公募公債	100,000,000	102,312,000	
	第７２９回東京都公募公債	100,000,000	102,479,000	
	第７６８回東京都公募公債	100,000,000	100,833,000	
	平成２５年度第４回北海道公募公債	200,000,000	204,836,000	
	平成２５年度第７回北海道公募公債	150,000,000	153,597,000	
	平成２５年度第９回北海道公募公債	300,000,000	306,573,000	
	平成２８年度第１２回北海道公募公債	600,000,000	603,102,000	
	平成２９年度第１５回北海道公募公債	117,000,000	118,113,840	
	第２９回１号宮城県公募公債	100,000,000	102,182,000	
	第１回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	263,118,000	
	第２回神奈川県公募公債（２０年）	80,000,000	87,468,800	
	第２回神奈川県公募公債（３０年）	80,000,000	110,520,800	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,680,000	
	第１９１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,598,000	
	第２３２回神奈川県公募公債	200,000,000	201,534,000	
	第１１回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	235,820,000	
	第３４８回大阪府公募公債	10,000,000	10,097,800	
	第３５１回大阪府公募公債	100,000,000	101,259,000	
	第３５８回大阪府公募公債	56,000,000	56,873,600	

第３５９回大阪府公募公債	56,000,000	56,934,640	
第３６３回大阪府公募公債	500,000,000	507,950,000	
第３７５回大阪府公募公債	100,000,000	102,523,000	
第３７６回大阪府公募公債	106,000,000	108,689,220	
第３８５回大阪府公募公債	200,000,000	204,878,000	
第３８８回大阪府公募公債	400,000,000	408,500,000	
第３９３回大阪府公募公債	110,000,000	112,176,900	
第３９４回大阪府公募公債	200,000,000	204,218,000	
第４１９回大阪府公募公債	700,000,000	705,761,000	
第４２９回大阪府公募公債	103,000,000	103,799,280	
平成２３年度第９回京都府公募公債	140,000,000	142,374,400	
平成２４年度第１０回京都府公募公債	100,000,000	101,766,000	
平成２７年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	112,576,000	
第１回兵庫県公募公債（１５年）	300,000,000	328,800,000	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	300,000,000	349,020,000	
第２回兵庫県公募公債（３０年）	40,000,000	54,140,000	
第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	109,047,000	
第５回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	109,549,000	
第１０回兵庫県公募公債（２０年）	300,000,000	360,234,000	
平成２８年度第２回兵庫県公募公債	400,000,000	400,464,000	
平成２８年度第３回兵庫県公募公債	700,000,000	700,819,000	
第２９回兵庫県公募公債（２０年）	200,000,000	200,858,000	
第３回静岡県公募公債（１５年）	100,000,000	109,367,000	
平成２５年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	101,564,000	
平成２５年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	102,775,000	
平成２５年度第８回静岡県公募公債	130,000,000	132,915,900	
平成２３年度第７回愛知県公募公債	100,000,000	101,192,000	
平成２３年度第９回愛知県公募公債	100,000,000	101,264,000	
平成２３年度第１３回愛知県公募公債	300,000,000	327,891,000	
平成２３年度第１４回愛知県公募公債	100,000,000	101,407,000	
平成２３年度第１７回愛知県公募公債	100,000,000	101,555,000	
平成２４年度第１３回愛知県公募公債	100,000,000	101,816,000	
平成３０年度第８回愛知県公募公債	600,000,000	607,986,000	
平成２２年度第８回広島県公募公債	26,650,000	26,910,903	
平成２３年度第７回広島県公募公債	100,000,000	101,698,000	
平成２８年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	100,213,000	
平成２９年度第７回広島県公募公債	100,000,000	100,884,000	
第４回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	230,158,000	
第１６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,368,000	
平成２３年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	101,283,000	
平成２６年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	101,412,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	70,000,000	95,437,300	

平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	80,000,000	105,554,400	
平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	101,869,000	
平成２６年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	102,515,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,271,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	80,000,000	93,517,600	
平成２３年度第９回千葉県公募公債	20,000,000	20,340,600	
平成２４年度第１回千葉県公募公債	20,000,000	20,375,400	
平成２４年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,898,000	
平成２５年度第１回千葉県公募公債	82,500,000	83,796,075	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	102,201,000	
第７回群馬県公募公債（２０年）	300,000,000	295,860,000	
平成２４年度第１回大分県公募公債	100,260,000	102,085,734	
平成２７年度第１回大分県公募公債	203,400,000	208,021,248	
第１００回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,281,000	
第１０１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,202,000	
第１０６回共同発行市場公募地方債	1,500,000,000	1,522,470,000	
第１０９回共同発行市場公募地方債	170,000,000	173,190,900	
第１１０回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,965,000	
第１１４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,782,000	
第１２６回共同発行市場公募地方債	210,000,000	215,357,100	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,182,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,633,000	
第１３５回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,599,000	
第１４２回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,912,000	
第１４４回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,174,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,822,000	
第１５３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,298,000	
第１６２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,657,000	
第１７８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,186,000	
平成２４年度第２回堺市公募公債	200,000,000	203,326,000	
平成２５年度第１回長崎県公募公債	200,000,000	205,110,000	
平成２８年度第２回島根県公募公債（２０年）	100,000,000	101,618,000	
平成３０年度第１回福島県公募公債	100,000,000	101,456,000	
平成２３年度第１回滋賀県公募公債	100,000,000	101,427,000	
平成２５年度第１回栃木県公募公債	100,000,000	102,142,000	
平成２４年度第２回熊本県公募公債	50,000,000	50,905,000	
平成２３年度第１回浜松市公募公債	238,200,000	241,651,518	
平成２４年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	102,116,000	
平成２５年度第１回浜松市公募公債	161,000,000	165,242,350	
第５回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	119,469,000	
平成２３年度第１０回大阪市公募公債	10,000,000	10,148,100	
第１回名古屋市公募公債（２０年）	200,000,000	213,696,000	

第１回名古屋市公募公債（３０年）	200,000,000	262,192,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	400,000,000	466,712,000	
第１０回名古屋市公募公債（２０年）	80,000,000	95,620,800	
第４７回名古屋市公募公債	100,000,000	101,500,000	
第１回京都市公募公債（２０年）	200,000,000	218,964,000	
第５回京都市公募公債（２０年）	50,000,000	57,406,500	
平成２３年度第２回京都市公募公債	100,000,000	101,204,000	
平成２３年度第４回京都市公募公債	350,000,000	355,442,500	
平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,801,000	
平成２０年度第２４回神戸市公募公債（２０年）	300,000,000	350,286,000	
平成２２年度第４回神戸市公募公債	100,000,000	117,386,000	
第７回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	221,988,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	80,000,000	94,688,800	
平成２４年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	101,825,000	
平成２４年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	102,084,000	
平成２４年度第３回横浜市公募公債	100,000,000	101,754,000	
平成２７年度第２回横浜市公募公債	200,000,000	205,384,000	
平成２７年度第３回横浜市公募公債	500,000,000	512,110,000	
第２７回横浜市公募公債（２０年）	60,000,000	69,940,800	
第３３回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	98,852,000	
第３５回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	301,746,000	
平成２２年度第８回札幌市公募公債（３０年）	80,000,000	107,902,400	
平成２３年度第３回札幌市公募公債	300,000,000	356,973,000	
平成２６年度第５回札幌市公募公債	100,000,000	107,743,000	
平成２７年度第９回札幌市公募公債	100,000,000	100,765,000	
第１７回北九州市公募公債（２０年）	100,000,000	116,029,000	
平成２５年度第３回北九州市公募公債	300,000,000	307,167,000	
平成２３年度第６回福岡市公募公債	100,000,000	101,313,000	
平成２４年度第４回福岡市公募公債	200,000,000	203,642,000	
平成２５年度第４回福岡市公募公債	50,000,000	51,090,000	
平成２６年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	114,312,000	
平成２５年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,435,000	
平成２９年度第６回広島市公募公債	300,000,000	303,315,000	
平成２４年度第１回相模原市公募公債	200,000,000	203,406,000	
平成２３年度第１回三重県公募公債	98,410,000	99,815,294	
平成２４年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,232,000	
平成２６年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,912,000	
平成２３年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	101,427,000	
平成３０年度第１回山梨県公募公債	100,000,000	101,648,000	
平成２４年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	101,805,000	
平成２６年度第１回岡山市公募公債	100,000,000	101,390,000	
平成２８年度第１回岡山県公募公債	300,000,000	302,265,000	

	第４回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	199,586,000	
	第９６回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	117,224,000	
	第１３２回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,036,000	
地方債証券 合計		26,868,420,000	28,271,978,402	
特殊債券	第３回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	102,537,000	
	第１１回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債	400,000,000	400,348,000	
	第１９回政府保証日本政策投資銀行	400,000,000	407,544,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,475,600	
	第６０回政府保証日本政策投資銀行債券	700,000,000	698,201,000	
	第９４回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	200,000,000	199,966,000	
	第９回道路債券（財投機関債）	100,000,000	130,854,000	
	第１７回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	227,878,000	
	第１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	45,969,600	
	第１９回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	150,555,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	130,000,000	193,310,000	
	第２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	500,000,000	579,690,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	232,224,000	
	第３３回道路債券（財投機関債）	500,000,000	672,915,000	
	第５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	59,594,000	
	第７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	236,084,000	
	第８３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	59,504,500	
	第８９回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	117,063,000	
	第１０１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,909,000	
	第１４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	122,000,000	123,516,460	
	第１４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	239,458,000	
	第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,820,000	
	第１４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	236,566,000	
	第１４９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	136,000,000	138,038,640	
	第１５０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	221,476,000	
	第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	133,911,000	

第１５５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,545,000	
第１５７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	212,000,000	215,366,560	
第１５９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	119,000,000	120,944,460	
第１６０回日本高速道路保有・債務返済機構債券 （財投機関債）	100,000,000	113,184,000	
第１６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	433,000,000	441,153,390	
第１６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,991,000	
第１６５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	253,302,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	512,000,000	521,487,360	
第１６７回日本高速道路保有・債務返済機構債券 （財投機関債）	200,000,000	221,354,000	
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	700,000,000	712,628,000	
第１７５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	430,000,000	438,251,700	
第１７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	408,080,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	205,496,370	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,700,000	173,926,230	
第１８８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,664,000	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	155,461,770	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	212,862,320	
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,628,000	
第１９５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	223,000,000	229,223,930	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,580,000	
第２１１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,782,000	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	332,000,000	339,921,520	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	124,000,000	127,002,040	
第２２６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,378,000	
第２３１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	283,000,000	289,076,010	
第２５６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	213,000,000	217,536,900	

第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,784,000	
第303回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	106,944,460	
第318回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,833,000	
第1回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	59,430,500	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	300,000,000	302,460,000	
第3回公営企業債券（20年）（財投機関債）	20,000,000	20,550,200	
第5回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	313,722,000	
第6回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	106,968,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	200,000,000	236,862,000	
第9回公営企業債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	54,846,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	351,249,000	
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	96,969,600	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	94,290,400	
F17回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	400,000,000	410,264,000	
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	150,000,000	169,767,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	30,000,000	30,288,300	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	350,157,000	
F24回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	73,157,700	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	117,145,000	
第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	59,226,500	
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	21,000,000	21,289,800	
第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	401,000,000	406,846,580	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	50,000,000	50,842,500	
第33回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	400,000,000	406,816,000	
第35回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,732,000	
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,768,000	
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,450,000	
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	407,520,000	
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	113,275,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,226,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,321,300	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,655,920	
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	160,000,000	163,804,800	
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	315,000,000	322,878,150	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,516,000	

第 6 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,397,000	
第 6 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	245,404,800	
F 6 7 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	335,034,000	
第 7 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	309,084,920	
第 7 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	116,038,570	
第 7 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	152,920,500	
第 8 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	174,000,000	174,000,000	
F 8 9 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	331,575,000	
F 9 0 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	333,498,000	
第 9 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	206,000,000	207,011,460	
第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,797,000	
F 1 0 4 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,979,000	
第 1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,142,000	
第 1 0 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	116,000,000	116,892,040	
F 1 2 2 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	327,057,000	
F 1 2 3 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	113,744,000	
第 1 2 8 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,952,000	
F 1 4 9 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,787,000	
F 2 3 4 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	117,620,000	
第 1 0 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	95,339,200	
第 1 5 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	94,157,600	
第 2 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,243,000	
第 1 7 回政府保証民間都市開発債券	200,000,000	201,416,000	
第 4 8 回福祉医療機構債券（財投機関債）	700,000,000	702,695,000	
第 5 4 回福祉医療機構債券（財投機関債）	300,000,000	302,250,000	
第 1 8 回政府保証中部国際空港債券	558,000,000	568,596,420	
第 2 1 1 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,196,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,854,000	13,244,375	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,323,000	13,816,883	
第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,148,000	14,765,984	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,634,000	14,197,629	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	70,889,000	70,894,671	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	150,088,000	150,205,068	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,525,000	14,055,450	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	181,074,000	180,706,419	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,745,000	11,953,473	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	12,176,000	12,531,417	
第 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,492,000	13,974,878	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,199,000	14,730,184	

第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,211,000	12,559,135	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,361,000	14,904,851	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,802,000	13,243,156	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,126,000	15,917,089	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,215,000	13,676,335	
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,064,000	15,737,963	
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,147,000	10,182,413	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,863,000	11,986,375	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,404,000	14,662,551	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,473,000	14,743,210	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	43,647,000	44,428,717	
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,481,000	11,669,518	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,604,000	11,848,960	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,880,000	49,539,388	
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,592,000	11,795,207	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,554,000	26,194,383	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,978,000	14,411,318	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,579,000	29,538,212	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,306,000	30,127,208	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,226,000	29,913,632	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,825,000	14,346,479	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,128,000	32,855,292	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,128,000	13,549,146	
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,545,000	34,071,685	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,386,000	15,030,924	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,934,000	13,469,596	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,878,000	40,196,891	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,858,000	39,348,863	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,100,000	33,077,649	
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,215,000	30,024,992	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,227,000	93,816,180	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,264,000	31,036,813	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,109,000	31,862,548	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,959,000	13,440,945	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,518,000	34,425,505	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,200,000	37,180,352	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,800,000	38,874,048	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,649,000	42,953,798	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,205,000	129,262,338	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,825,000	44,244,158	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,415,000	45,771,132	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,873,000	47,082,097	

第 6 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,018,000	47,034,356	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,072,000	49,228,839	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,454,000	44,589,011	
第 7 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,783,000	50,445,468	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	96,020,000	
第 7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,694,000	302,522,442	
第 7 7 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	32,965,500	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,195,000	45,038,130	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,696,000	182,145,037	
第 8 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,736,000	98,873,121	
第 8 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,994,000	49,051,867	
第 8 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,811,000	51,942,910	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,138,000	102,196,006	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,420,000	105,689,782	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,658,000	56,786,929	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,935,000	57,913,980	
第 9 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,052,000	117,933,189	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,145,000	59,817,831	
第 9 2 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	182,797,200	
第 9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,330,000	124,923,396	
第 9 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,602,000	72,957,282	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,597,000	73,300,865	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,638,000	146,914,015	
第 1 0 2 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	300,000,000	326,571,000	
第 1 0 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	368,875,000	382,519,686	
第 1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	407,795,000	410,637,331	
第 1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,726,000	248,769,549	
第 1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	190,000,000	208,430,000	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,635,000	256,052,141	
第 1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	428,300,000	434,257,653	
第 1 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	173,696,900	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,174,000	177,265,577	
第 1 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	118,348,000	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	530,976,000	536,476,911	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,057,000	89,969,834	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,200,000	91,359,070	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,335,000	91,276,290	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,538,000	183,139,165	

	第１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,234,000	182,832,483	
	第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	455,360,000	460,022,886	
	第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,678,000	186,129,569	
	第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,782,000	187,959,365	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,327,000	94,621,445	
	第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,877,000	95,382,787	
	第１４３回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	217,482,000	
	第１４７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,787,000	96,170,466	
	第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,222,000	193,863,254	
	第１５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,804,000	196,170,291	
	第１５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,092,000	197,578,817	
	第１７４回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	199,620,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	54,933,000	
	い第８１４号商工債券	200,000,000	200,494,000	
	い第８３２号商工債券	300,000,000	299,298,000	
	い第８１８号農林債券	200,000,000	199,998,000	
	第３２２回信金中金債	300,000,000	300,036,000	
	第３２７回信金中金債	200,000,000	200,066,000	
	第３３６回信金中金債	300,000,000	300,360,000	
	第３３８回信金中金債	200,000,000	200,310,000	
	第１１号商工債券（１０年）	100,000,000	102,298,000	
	第２２３号商工債券（３年）	300,000,000	300,282,000	
	第２３０号商工債券（３年）	300,000,000	300,261,000	
	第２３１号商工債券（３年）	100,000,000	100,073,000	
	第２３６号商工債券（３年）	500,000,000	499,435,000	
	第２回信金中金債（１０年）	300,000,000	306,825,000	
	第７回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	83,454,000	
	第３３回中日本高速道路	50,000,000	50,660,500	
	第３９回中日本高速道路	400,000,000	406,200,000	
	第６５回中日本高速道路	700,000,000	700,105,000	
	第２９回西日本高速道路	500,000,000	505,030,000	
	第７２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	213,838,000	
特殊債券 合計		37,544,143,000	39,498,642,189	
社債券	第１４回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	299,697,000	
	第１９回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	202,230,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	196,298,000	
	第８回新韓銀行	300,000,000	299,919,000	
	第１７回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	300,000,000	298,365,000	
	第１回韓国石油公社債	300,000,000	298,359,000	
	第３８回関西国際空港	50,000,000	50,815,500	

第１０回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	200,000,000	204,394,000	
第１７回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	99,871,000	
第５回日揮	700,000,000	698,698,000	
第７回明治ホールディングス	100,000,000	99,845,000	
第３回コカ・コーラウエスト	300,000,000	302,325,000	
第２４回味の素	100,000,000	99,871,000	
第３回 キューピー	100,000,000	99,575,000	
第１２回日本たばこ産業	200,000,000	199,680,000	
第１３回日本たばこ産業	300,000,000	300,942,000	
第６回ヒューリック	300,000,000	299,604,000	
第７回ヒューリック	300,000,000	298,611,000	
第１２回野村不動産ホールディングス	100,000,000	99,920,000	
第２２回森ビル	200,000,000	199,508,000	
第３１回東レ	100,000,000	99,839,000	
第９回クラレ	200,000,000	200,052,000	
第４回野村総合研究所	100,000,000	99,731,000	
第１回電通	300,000,000	298,788,000	
第２回電通	200,000,000	199,246,000	
第２回大塚ホールディングス	100,000,000	99,683,000	
第１５回Ｚホールディングス	300,000,000	299,937,000	
第３回富士フイルムホールディングス	100,000,000	101,700,000	
第１１回ブリヂストン	300,000,000	299,376,000	
第１３回ブリヂストン	200,000,000	200,154,000	
第１０回日本特殊陶業	100,000,000	99,498,000	
第１回日本製鉄	400,000,000	398,308,000	
第４回新日本製鐵	200,000,000	198,782,000	
第４回日本製鉄	200,000,000	199,958,000	
第５回日本製鉄	200,000,000	199,980,000	
第１９回豊田自動織機	100,000,000	101,190,000	
第４８回日本精工	200,000,000	199,440,000	
第５１回日本精工	100,000,000	98,842,000	
第１９回日立製作所	300,000,000	298,020,000	
第５３回日本電気	200,000,000	199,742,000	
第５６回日本電気	300,000,000	300,207,000	
第１７回パナソニック	100,000,000	100,570,000	
第１８回デンソー	500,000,000	498,115,000	
第５５回川崎重工業	100,000,000	99,994,000	
第１回日本生命２０１７基金	100,000,000	99,729,000	
第２回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	200,000,000	200,180,000	
第６０回日産自動車	200,000,000	194,208,000	
第１３回アイシン精機	100,000,000	101,928,000	

第１回明治安田生命２０１８基金	300,000,000	296,778,000	
第１回明治安田生命２０１９基金	200,000,000	197,500,000	
第４８回クレディセゾン	200,000,000	204,804,000	
第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	300,000,000	301,668,000	
第１７回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	300,000,000	295,155,000	
第８回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	100,000,000	101,959,000	
第９回みずほコーポレート銀行（劣後特約付）	100,000,000	109,441,000	
第２８回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	100,826,000	
第２９回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	217,998,000	
第３０回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	116,805,000	
第５７回三菱東京ＵＦＪ銀行	200,000,000	209,726,000	
第８回三菱ＵＦＪ信託銀行（劣後特約付）	200,000,000	214,758,000	
第２３回三井住友銀行（劣後特約付）	100,000,000	100,711,000	
第１５回芙蓉総合リース	100,000,000	100,056,000	
第４７回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	194,670,000	
第２０回東京センチュリーリース	100,000,000	99,789,000	
第２３回東京センチュリーリース	200,000,000	199,434,000	
第４２回ホンダファイナンス	100,000,000	99,720,000	
第９１回トヨタファイナンス	300,000,000	300,084,000	
第２３回リコーリース	200,000,000	199,736,000	
第２７回リコーリース	100,000,000	99,874,000	
第３０回リコーリース	200,000,000	199,934,000	
第３５回リコーリース	100,000,000	99,651,000	
第３７回リコーリース	300,000,000	298,482,000	
第７回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	198,800,000	
第７９回アコム	300,000,000	296,346,000	
第４７回日立キャピタル	100,000,000	101,731,000	
第７０回日立キャピタル	200,000,000	199,966,000	
第７８回日立キャピタル	300,000,000	298,743,000	
第８２回日立キャピタル	300,000,000	298,914,000	
第１９４回オリックス	400,000,000	399,504,000	
第１６回三井住友ファイナンス＆リース	100,000,000	99,970,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース	200,000,000	199,646,000	
第６３回三菱ＵＦＪリース	400,000,000	399,644,000	
第６６回三菱ＵＦＪリース	400,000,000	399,440,000	
第７４回三菱ＵＦＪリース	400,000,000	399,004,000	
第７５回三菱ＵＦＪリース	200,000,000	199,438,000	
第７７回三菱ＵＦＪリース	300,000,000	300,771,000	
第２７回野村ホールディングス	100,000,000	108,682,000	
第５０回野村ホールディングス	200,000,000	199,994,000	
第７６回三井不動産	100,000,000	100,065,000	
第１１６回三菱地所	100,000,000	101,830,000	

第１２５回三菱地所	300,000,000	299,202,000	
第９５回住友不動産	100,000,000	102,614,000	
第９９回住友不動産	300,000,000	306,537,000	
第１２回イオンモール	200,000,000	200,016,000	
第１２回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	101,778,000	
第１２回森トラスト総合リート投資法人	100,000,000	99,468,000	
第３６回京王電鉄	100,000,000	100,633,000	
第３８回京王電鉄	100,000,000	100,395,000	
第１９回東日本旅客鉄道	100,000,000	103,814,000	
第２６回東日本旅客鉄道	100,000,000	102,756,000	
第１００回東日本旅客鉄道	100,000,000	126,193,000	
第９回東海旅客鉄道	100,000,000	103,709,000	
第１１回東海旅客鉄道	100,000,000	102,656,000	
第５３回東海旅客鉄道	100,000,000	115,118,000	
第５６回東海旅客鉄道	100,000,000	118,473,000	
第７４回東海旅客鉄道	100,000,000	120,110,000	
第１１回東京地下鉄	100,000,000	101,595,000	
第５０回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	200,954,000	
第１６回三菱倉庫	200,000,000	199,234,000	
第６３回日本電信電話	100,000,000	101,263,000	
第２１回ＫＤＤＩ	100,000,000	102,069,000	
第２７回ＫＤＤＩ	300,000,000	298,854,000	
第１回ソフトバンク	300,000,000	299,415,000	
第２０回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	101,616,000	
第５６７回東京電力	100,000,000	106,920,000	
第４９９回中部電力	50,000,000	51,586,500	
第５００回中部電力	100,000,000	102,800,000	
第５２８回中部電力	200,000,000	199,964,000	
第４９６回関西電力	100,000,000	102,949,000	
第４９９回関西電力	200,000,000	204,002,000	
第５０８回関西電力	200,000,000	201,332,000	
第５１２回関西電力	200,000,000	200,686,000	
第５１７回関西電力	300,000,000	300,267,000	
第５１８回関西電力	100,000,000	100,192,000	
第５３２回関西電力	100,000,000	99,838,000	
第３８１回中国電力	100,000,000	103,001,000	
第３８５回中国電力	100,000,000	102,534,000	
第４０２回中国電力	200,000,000	200,472,000	
第４０９回中国電力	300,000,000	301,806,000	
第３０４回北陸電力	100,000,000	102,749,000	
第３０７回北陸電力	100,000,000	104,479,000	
第３１０回北陸電力	200,000,000	204,860,000	

第 3 2 2 回北陸電力	200,000,000	200,610,000	
第 4 7 5 回東北電力	300,000,000	307,767,000	
第 2 5 3 回四国電力	100,000,000	102,595,000	
第 4 2 6 回九州電力	300,000,000	309,714,000	
第 4 2 9 回九州電力	200,000,000	205,848,000	
第 4 4 9 回九州電力	100,000,000	100,768,000	
第 4 8 4 回九州電力	300,000,000	299,598,000	
第 4 8 8 回九州電力	100,000,000	99,869,000	
第 3 8 回電源開発	100,000,000	102,830,000	
第 3 9 回電源開発	100,000,000	102,714,000	
第 4 0 回電源開発	200,000,000	205,474,000	
第 5 7 回電源開発	200,000,000	199,676,000	
第 6 回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,778,000	
第 1 3 回東京電力パワーグリッド	200,000,000	199,620,000	
第 1 5 回東京電力パワーグリッド	200,000,000	198,258,000	
第 2 8 回東京電力パワーグリッド	200,000,000	201,834,000	
第 3 1 回東京電力パワーグリッド	200,000,000	201,022,000	
第 3 3 回東京電力パワーグリッド	300,000,000	300,354,000	
第 3 7 回東京電力パワーグリッド	400,000,000	400,032,000	
第 2 3 回東京ガス	200,000,000	205,454,000	
第 1 3 回広島ガス	200,000,000	199,910,000	
第 6 回ＳＣＳＫ	100,000,000	99,771,000	
第 4 回ファーストリテイリング	100,000,000	102,246,000	
第 7 回ファーストリテイリング	200,000,000	199,604,000	
社債券 合計	29,600,000,000	29,843,027,000	
合計	550,813,563,000	592,094,371,151	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,354,313,579

[令和 2年 6月25日現在]

コール・ローン	169,355,122
国債証券	155,778,578,883
派生商品評価勘定	138,060
未収利息	906,765,594
前払費用	110,144,491
流動資産合計	158,319,295,729
資産合計	158,319,295,729
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	74,174
未払金	302,737,056
未払解約金	66,287,628
未払利息	248
流動負債合計	369,099,106
負債合計	369,099,106
純資産の部	
元本等	
元本	72,213,285,049
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,736,911,574
元本等合計	157,950,196,623
純資産合計	157,950,196,623
負債純資産合計	158,319,295,729

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	68,721,035,911円
期中追加設定元本額	18,738,596,240円
期中一部解約元本額	15,246,347,102円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（海外債券）	632,405,899円
e M A X I S 先進国債券インデックス	5,765,261,675円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	1,712,895,270円
e M A X I S バランス（波乗り型）	215,489,313円

	[令和 2年 6月25日現在]
コアバランス	1,585,842円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	30,264,719円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	25,141,922円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	13,809,217円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	5,129,913,396円
海外債券セレクション（ラップ向け）	1,614,122,610円
eMAXIS Slim バランス（８資産均等型）	3,109,728,159円
つみたて８資産均等バランス	1,276,007,879円
つみたて４資産均等バランス	359,766,692円
eMAXIS マイマネージャー １９７０s	731,265円
eMAXIS マイマネージャー １９８０s	323,854円
eMAXIS マイマネージャー １９９０s	48,275円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	13,498,863円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	8,060,967円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	3,413,798円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（先進国債券）	95,463,507円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	3,548,554円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	10,323,361,767円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	273,574,396円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	254,786,944円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	116,500,976円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	131,530,666円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	20,478,098円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	8,544,886円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,030,558円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,313,232,062円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	1,497,459,852円
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	26,577,183,334円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	643,218,215円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,392,975円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	1,817,535円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,033,971,441円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦs用）（適格機関投資家限定）	93,101,866円
アドバンスト・バランス（ＦＯＦs用）（適格機関投資家限定）	123,446,843円

	[令和 2年 6月25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）	144,912,574円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	16,995,493円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	2,673,080,978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）	136,112,055円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,694,598円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	4,288,868円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	2,011,946円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	1,326,445円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	38,946,114円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	21,466,730円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	42,920,229円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	30,363,609円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	48,063,826円
外国債券インデックスファンドi（適格機関投資家限定）	1,317,340,524円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,955,983,962円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	216,120,598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）	543,223,936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）	403,997,117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）	144,321,357円
合計	72,213,285,049円
2. 受益権の総数	72,213,285,049口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	984,071,776
合計	984,071,776

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和 2年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	49,106,300	—	49,243,000	136,700
	カナダドル	1,571,580	—	1,571,400	180
	オーストラリアドル	1,480,420	—	1,471,000	9,420
	イギリスポンド	7,999,140	—	7,981,800	17,340
	シンガポールドル	1,538,180	—	1,538,000	180
	スウェーデンクローネ	1,144,030	—	1,144,000	30
	ノルウェークローネ	1,108,010	—	1,107,000	1,010
	デンマーククローネ	1,617,120	—	1,617,000	120
	メキシコペソ	2,051,487	—	2,021,000	30,487
	ポーランドズロチ	1,627,092	—	1,621,200	5,892
	ユーロ	44,600,555	—	44,592,400	8,155
合計		113,843,914	—	113,907,800	63,886

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	2.1873円
(1万口当たり純資産額)	(21,873円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ドル	国債証券	0.125 T-NOTE 230515	12,700,000.00	12,670,730.46	
		0.5 T-NOTE 270430	3,300,000.00	3,298,453.12	
		0.625 T-NOTE 300515	2,210,000.00	2,197,914.05	
		1.125 T-NOTE 210831	2,200,000.00	2,224,578.12	
		1.125 T-NOTE 210930	3,400,000.00	3,440,507.81	
		1.25 T-BOND 500515	700,000.00	666,859.37	
		1.25 T-NOTE 211031	2,000,000.00	2,027,812.50	
		1.25 T-NOTE 230731	2,550,000.00	2,632,277.34	
		1.375 T-NOTE 230215	3,000,000.00	3,092,460.93	
		1.375 T-NOTE 230630	2,900,000.00	3,002,179.68	
		1.375 T-NOTE 230831	2,850,000.00	2,955,761.71	
		1.375 T-NOTE 230930	2,100,000.00	2,179,734.37	
		1.375 T-NOTE 250131	7,600,000.00	7,971,093.75	
		1.5 T-NOTE 211031	6,000,000.00	6,106,171.87	
		1.5 T-NOTE 220131	2,300,000.00	2,348,156.25	
		1.5 T-NOTE 230228	4,200,000.00	4,346,015.61	
		1.5 T-NOTE 230331	3,250,000.00	3,366,796.87	
		1.5 T-NOTE 241031	2,000,000.00	2,104,843.74	
		1.5 T-NOTE 241130	2,000,000.00	2,106,093.75	
		1.5 T-NOTE 260815	5,700,000.00	6,062,929.68	
		1.5 T-NOTE 270131	2,740,000.00	2,920,240.61	
		1.5 T-NOTE 300215	5,750,000.00	6,200,117.18	
		1.625 T-NOTE 220815	1,700,000.00	1,751,597.65	
		1.625 T-NOTE 220831	7,640,000.00	7,876,959.37	
		1.625 T-NOTE 221115	5,200,000.00	5,375,703.12	
		1.625 T-NOTE 221215	5,000,000.00	5,174,804.68	

1.625 T-NOTE 230531	2,800,000.00	2,915,937.50	
1.625 T-NOTE 231031	3,100,000.00	3,245,070.31	
1.625 T-NOTE 260215	5,120,000.00	5,469,600.00	
1.625 T-NOTE 260515	5,980,000.00	6,396,264.05	
1.625 T-NOTE 260930	3,550,000.00	3,805,156.25	
1.625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,647,562.50	
1.625 T-NOTE 290815	5,300,000.00	5,769,960.93	
1.75 T-NOTE 211130	3,700,000.00	3,782,382.81	
1.75 T-NOTE 220228	3,400,000.00	3,488,718.75	
1.75 T-NOTE 220331	2,100,000.00	2,157,914.06	
1.75 T-NOTE 220430	3,700,000.00	3,806,953.12	
1.75 T-NOTE 220515	1,400,000.00	1,441,289.06	
1.75 T-NOTE 220531	1,700,000.00	1,750,867.18	
1.75 T-NOTE 220630	4,900,000.00	5,052,933.59	
1.75 T-NOTE 220930	1,800,000.00	1,863,140.62	
1.75 T-NOTE 230131	2,700,000.00	2,808,000.00	
1.75 T-NOTE 230515	4,800,000.00	5,015,249.99	
1.75 T-NOTE 241231	2,850,000.00	3,035,695.30	
1.75 T-NOTE 261231	3,100,000.00	3,352,843.75	
1.875 T-NOTE 211130	2,300,000.00	2,355,074.21	
1.875 T-NOTE 220131	2,550,000.00	2,618,730.46	
1.875 T-NOTE 220228	5,100,000.00	5,244,234.37	
1.875 T-NOTE 220331	2,450,000.00	2,522,542.96	
1.875 T-NOTE 220430	5,700,000.00	5,877,234.37	
1.875 T-NOTE 220531	6,760,000.00	6,979,171.87	
1.875 T-NOTE 220731	4,500,000.00	4,657,500.00	
1.875 T-NOTE 220831	1,500,000.00	1,554,785.15	
1.875 T-NOTE 220930	2,000,000.00	2,075,312.50	
1.875 T-NOTE 221031	2,700,000.00	2,805,679.68	
2 T-NOTE 210831	1,850,000.00	1,889,673.82	
2 T-NOTE 211031	1,700,000.00	1,740,507.81	
2 T-NOTE 211115	2,650,000.00	2,715,732.42	
2 T-NOTE 211231	5,850,000.00	6,009,960.93	
2 T-NOTE 220215	2,200,000.00	2,264,539.06	
2 T-NOTE 220731	2,900,000.00	3,009,882.81	
2 T-NOTE 221031	2,850,000.00	2,970,011.71	
2 T-NOTE 221130	6,200,000.00	6,469,796.87	
2 T-NOTE 240430	2,000,000.00	2,133,750.00	
2 T-NOTE 240531	3,850,000.00	4,111,980.46	
2 T-NOTE 240630	2,200,000.00	2,352,796.87	
2 T-NOTE 250215	5,300,000.00	5,712,820.30	
2 T-NOTE 250815	5,300,000.00	5,744,703.12	

2 T-NOTE 261115	5,150,000.00	5,644,882.81
2.125 T-NOTE 210815	4,500,000.00	4,599,843.75
2.125 T-NOTE 210930	2,200,000.00	2,253,882.81
2.125 T-NOTE 211231	4,060,000.00	4,176,725.00
2.125 T-NOTE 220630	1,800,000.00	1,870,031.25
2.125 T-NOTE 221231	5,150,000.00	5,398,246.09
2.125 T-NOTE 231130	4,500,000.00	4,791,796.87
2.125 T-NOTE 240229	4,550,000.00	4,865,300.78
2.125 T-NOTE 240331	3,460,000.00	3,703,551.56
2.125 T-NOTE 240731	1,750,000.00	1,883,164.06
2.125 T-NOTE 240930	2,250,000.00	2,425,253.90
2.125 T-NOTE 241130	1,900,000.00	2,052,445.31
2.125 T-NOTE 250515	4,800,000.00	5,217,749.97
2.25 T-BOND 460815	3,080,000.00	3,630,309.35
2.25 T-NOTE 220415	2,700,000.00	2,800,089.84
2.25 T-NOTE 231231	4,900,000.00	5,246,828.12
2.25 T-NOTE 240131	7,300,000.00	7,828,679.68
2.25 T-NOTE 240430	5,000,000.00	5,382,421.87
2.25 T-NOTE 241031	2,800,000.00	3,036,687.50
2.25 T-NOTE 241115	7,250,000.00	7,869,082.03
2.25 T-NOTE 251115	6,570,000.00	7,227,513.28
2.25 T-NOTE 270215	4,750,000.00	5,297,363.28
2.25 T-NOTE 270815	4,700,000.00	5,269,507.81
2.25 T-NOTE 271115	3,000,000.00	3,372,187.50
2.375 T-NOTE 230131	5,000,000.00	5,281,250.00
2.375 T-NOTE 240815	4,300,000.00	4,671,546.87
2.375 T-NOTE 270515	4,390,000.00	4,946,295.30
2.375 T-NOTE 290515	4,120,000.00	4,746,368.74
2.5 T-BOND 450215	3,290,000.00	4,036,932.80
2.5 T-BOND 460215	3,170,000.00	3,904,053.12
2.5 T-BOND 460515	3,300,000.00	4,071,117.18
2.5 T-NOTE 230815	3,400,000.00	3,644,375.00
2.5 T-NOTE 240131	6,400,000.00	6,919,000.00
2.5 T-NOTE 240515	4,350,000.00	4,728,246.09
2.5 T-NOTE 250131	2,200,000.00	2,420,687.50
2.625 T-NOTE 230228	3,000,000.00	3,194,062.50
2.625 T-NOTE 230630	2,500,000.00	2,681,250.00
2.625 T-NOTE 250331	2,300,000.00	2,550,843.75
2.625 T-NOTE 251231	2,600,000.00	2,917,890.62
2.625 T-NOTE 260131	3,700,000.00	4,157,585.93
2.625 T-NOTE 290215	5,320,000.00	6,221,906.25
2.75 T-BOND 420815	2,450,000.00	3,126,046.87
2.75 T-BOND 421115	4,050,000.00	5,163,908.20

2.75 T-BOND 470815	3,340,000.00	4,338,607.81	
2.75 T-BOND 471115	2,650,000.00	3,444,585.93	
2.75 T-NOTE 210815	11,660,000.00	12,000,690.62	
2.75 T-NOTE 230430	2,300,000.00	2,466,031.25	
2.75 T-NOTE 230531	3,600,000.00	3,867,468.75	
2.75 T-NOTE 231115	8,050,000.00	8,734,250.00	
2.75 T-NOTE 240215	5,960,000.00	6,503,850.00	
2.75 T-NOTE 250228	2,650,000.00	2,950,402.33	
2.75 T-NOTE 250630	3,800,000.00	4,255,406.25	
2.75 T-NOTE 250831	5,840,000.00	6,559,050.00	
2.75 T-NOTE 280215	5,160,000.00	6,009,384.37	
2.875 T-BOND 430515	4,100,000.00	5,332,242.18	
2.875 T-BOND 450815	4,350,000.00	5,703,597.65	
2.875 T-BOND 461115	3,080,000.00	4,073,781.25	
2.875 T-NOTE 211015	4,700,000.00	4,863,949.21	
2.875 T-NOTE 250430	2,500,000.00	2,806,835.93	
2.875 T-NOTE 250531	2,830,000.00	3,182,202.34	
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	4,310,921.87	
2.875 T-NOTE 280515	4,640,000.00	5,465,412.48	
2.875 T-NOTE 280815	5,060,000.00	5,981,868.75	
3 T-BOND 420515	1,620,000.00	2,147,512.50	
3 T-BOND 441115	4,900,000.00	6,528,867.18	
3 T-BOND 450515	3,110,000.00	4,155,008.59	
3 T-BOND 451115	2,950,000.00	3,956,457.03	
3 T-BOND 470215	3,150,000.00	4,266,281.25	
3 T-BOND 470515	2,750,000.00	3,727,109.37	
3 T-BOND 480215	3,050,000.00	4,149,191.40	
3 T-BOND 480815	2,210,000.00	3,019,585.15	
3.125 T-BOND 411115	2,050,000.00	2,763,175.78	
3.125 T-BOND 420215	2,030,000.00	2,742,403.11	
3.125 T-BOND 430215	4,000,000.00	5,396,250.00	
3.125 T-BOND 440815	4,450,000.00	6,040,179.68	
3.125 T-BOND 480515	1,590,000.00	2,214,323.43	
3.125 T-NOTE 281115	9,250,000.00	11,164,316.40	
3.375 T-BOND 440515	4,240,000.00	5,969,787.50	
3.625 T-BOND 430815	3,450,000.00	5,015,976.55	
3.625 T-BOND 440215	4,550,000.00	6,632,691.40	
3.75 T-BOND 410815	1,560,000.00	2,288,325.00	
3.75 T-BOND 431115	3,950,000.00	5,853,097.65	
3.875 T-BOND 400815	1,610,000.00	2,389,969.51	
4.25 T-BOND 401115	1,670,000.00	2,599,589.83	
4.375 T-BOND 391115	1,350,000.00	2,115,386.71	

		4.375 T-BOND 400515	1,250,000.00	1,967,968.75	
		4.375 T-BOND 410515	1,370,000.00	2,169,630.46	
		4.5 T-BOND 390815	1,350,000.00	2,143,019.51	
		4.625 T-BOND 400215	1,900,000.00	3,071,171.87	
		4.75 T-BOND 410215	1,660,000.00	2,743,409.37	
		5.25 T-BOND 281115	550,000.00	760,589.84	
		5.25 T-BOND 290215	300,000.00	417,867.18	
		5.5 T-BOND 280815	600,000.00	835,734.37	
		6 T-BOND 260215	2,600,000.00	3,413,718.75	
		6.25 T-BOND 230815	2,130,000.00	2,532,370.31	
		8 T-BOND 211115	600,000.00	664,804.68	
アメリカドル合計			588,630,000.00	660,655,975.33 (70,729,828,718)	
カナダドル	国債証券	0.25 CAN GOVT 220801	1,200,000.00	1,199,556.00	
		0.5 CAN GOVT 220301	1,500,000.00	1,506,645.00	
		0.75 CAN GOVT 210901	3,120,000.00	3,140,311.20	
		1 CAN GOVT 220901	2,350,000.00	2,387,412.00	
		1 CAN GOVT 270601	1,200,000.00	1,246,308.00	
		1.25 CAN GOVT 250301	600,000.00	625,104.00	
		1.5 CAN GOVT 230601	850,000.00	879,605.50	
		1.5 CAN GOVT 240901	2,000,000.00	2,096,440.00	
		1.5 CAN GOVT 260601	1,370,000.00	1,459,392.50	
		1.75 CAN GOVT 230301	800,000.00	831,088.00	
		2 CAN GOVT 230901	2,400,000.00	2,527,944.00	
		2 CAN GOVT 280601	900,000.00	1,007,712.00	
		2 CAN GOVT 511201	1,160,000.00	1,462,098.80	
		2.25 CAN GOVT 240301	800,000.00	856,256.00	
		2.25 CAN GOVT 250601	1,300,000.00	1,420,211.00	
		2.25 CAN GOVT 290601	890,000.00	1,026,570.50	
		2.5 CAN GOVT 240601	1,500,000.00	1,626,855.00	
		2.75 CAN GOVT 220601	850,000.00	890,868.00	
		2.75 CAN GOVT 481201	860,000.00	1,224,098.20	
		2.75 CANADA GOVER 641201	270,000.00	434,905.20	
		3.25 CAN GOVT 210601	800,000.00	822,976.00	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,270,000.00	1,971,636.90	
		4 CAN GOVT 410601	1,040,000.00	1,634,131.20	
		5 CAN GOVT 370601	850,000.00	1,401,667.00	
		5.75 CAN GOVT 290601	900,000.00	1,312,290.00	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,770,000.00	2,870,037.30	
		8 CAN GOVT 270601	240,000.00	363,408.00	
カナダドル合計			32,790,000.00	38,225,527.30 (3,003,761,935)	
	国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	2,800,000.00	2,785,560.68	

オーストラリアドル		1 AUST GOVT 301221	2,300,000.00	2,306,404.81	
		1.25 AUST GOVT 320521	760,000.00	778,690.45	
		1.5 AUST GOVT 310621	1,020,000.00	1,074,036.54	
		2 AUST GOVT 211221	1,150,000.00	1,179,765.33	
		2.25 AUST GOVT 221121	2,100,000.00	2,200,311.75	
		2.25 AUST GOVT 280521	2,300,000.00	2,562,135.60	
		2.5 AUST GOVT 300521	2,700,000.00	3,102,584.31	
		2.75 AUST GOVT 240421	1,700,000.00	1,856,999.93	
		2.75 AUST GOVT 271121	1,950,000.00	2,238,718.17	
		2.75 AUST GOVT 281121	1,950,000.00	2,256,722.32	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,080,000.00	2,428,848.86	
		2.75 AUST GOVT 350621	500,000.00	602,312.95	
		3 AUST GOVT 470321	1,440,000.00	1,821,600.12	
		3.25 AUST GOVT 250421	1,800,000.00	2,044,927.62	
		3.25 AUST GOVT 290421	2,090,000.00	2,516,080.14	
		3.25 AUST GOVT 390621	820,000.00	1,048,595.66	
		3.75 AUST GOVT 370421	800,000.00	1,080,484.00	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,490,000.00	3,025,226.74	
		4.5 AUST GOVT 330421	1,270,000.00	1,794,396.33	
		4.75 AUST GOVT 270421	2,250,000.00	2,869,583.17	
		5.5 AUST GOVT 230421	1,750,000.00	2,007,353.60	
		5.75 AUST GOVT 220715	1,600,000.00	1,779,980.96	
オーストラリアドル合計			39,620,000.00	45,361,320.04 (3,336,778,702)	
イギリスポンド	国債証券	0.375 GILT 301022	730,000.00	740,439.00	
		0.5 GILT 220722	1,100,000.00	1,113,456.08	
		0.625 GILT 250607	1,500,000.00	1,548,644.40	
		0.75 GILT 230722	2,450,000.00	2,511,303.65	
		0.875 GILT 291022	790,000.00	843,088.00	
		1 GILT 240422	1,700,000.00	1,769,009.80	
		1.25 GILT 270722	1,770,000.00	1,922,197.34	
		1.5 GILT 260722	1,660,000.00	1,814,111.74	
		1.5 GILT 470722	1,740,000.00	2,108,507.64	
		1.625 GILT 281022	1,800,000.00	2,031,694.20	
		1.625 GILT 711022	460,000.00	701,487.12	
		1.75 GILT 220907	3,400,000.00	3,536,950.64	
		1.75 GILT 370907	1,760,000.00	2,109,360.00	
		1.75 GILT 490122	1,020,000.00	1,313,305.08	
		1.75 GILT 570722	1,280,000.00	1,785,743.36	
		2 GILT 250907	780,000.00	864,369.48	
		2.25 GILT 230907	1,700,000.00	1,825,870.38	
		2.5 GILT 650722	1,310,000.00	2,335,444.42	

		2.75 GILT 240907	510,000.00	570,220.80	
		3.25 GILT 440122	1,830,000.00	2,867,801.04	
		3.5 GILT 450122	1,750,000.00	2,880,181.50	
		3.5 GILT 680722	1,780,000.00	4,021,504.16	
		3.75 GILT 210907	300,000.00	313,589.82	
		3.75 GILT 520722	1,290,000.00	2,469,605.40	
		4 GILT 220307	1,050,000.00	1,122,905.70	
		4 GILT 600122	1,110,000.00	2,472,882.97	
		4.25 GILT 271207	980,000.00	1,286,357.01	
		4.25 GILT 320607	1,220,000.00	1,784,855.60	
		4.25 GILT 360307	1,290,000.00	2,027,977.00	
		4.25 GILT 390907	1,150,000.00	1,920,449.86	
		4.25 GILT 401207	1,220,000.00	2,078,453.97	
		4.25 GILT 461207	1,410,000.00	2,641,844.80	
		4.25 GILT 491207	1,060,000.00	2,084,528.69	
		4.25 GILT 551207	1,540,000.00	3,343,498.62	
		4.5 GILT 340907	1,410,000.00	2,207,671.68	
		4.5 GILT 421207	1,480,000.00	2,682,248.40	
		4.75 GILT 301207	1,190,000.00	1,751,237.32	
		4.75 GILT 381207	1,410,000.00	2,453,800.44	
		5 GILT 250307	1,130,000.00	1,397,431.67	
		6 GILT 281207	1,080,000.00	1,613,001.60	
		8 GILT 210607	300,000.00	322,812.72	
イギリスポンド合計			54,440,000.00	77,189,843.10 (10,269,336,726)	
シンガ ポール ドル	国債証券	1.25 SINGAPORGVOT 211001	550,000.00	556,490.00	
		1.75 SINGAPORGVOT 220401	350,000.00	358,846.25	
		1.75 SINGAPORGVOT 230201	550,000.00	569,800.00	
		1.875 SINGAPORGVOT 500301	250,000.00	278,116.25	
		2 SINGAPORGVOT 240201	100,000.00	105,610.00	
		2.125 SINGAPORGVOT 260601	460,000.00	499,100.00	
		2.25 SINGAPORGVOT 210601	420,000.00	427,512.66	
		2.25 SINGAPORGVOT 360801	260,000.00	296,388.30	
		2.375 SINGAPORGVOT 250601	300,000.00	326,190.00	
		2.375 SINGAPORGVOT 390701	200,000.00	235,291.00	
		2.625 SINGAPORGVOT 280501	300,000.00	340,560.00	
		2.75 SINGAPORGVOT 230701	450,000.00	481,725.00	
		2.75 SINGAPORGVOT 420401	290,000.00	366,415.00	
		2.75 SINGAPORGVOT 460301	520,000.00	669,760.00	
		2.875 SINGAPORGVOT 290701	590,000.00	688,889.90	
		2.875 SINGAPORGVOT 300901	300,000.00	354,000.00	
		3 SINGAPORGVOT 240901	600,000.00	661,842.00	

		3.125SINGAPORGOVT 220901	800,000.00	848,640.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	410,000.00	522,545.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	500,000.00	589,650.00	
シンガポールドル合計			8,200,000.00	9,177,371.36 (705,831,631)	
マレーシア アリン ギット	国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	900,000.00	922,178.97	
		3.48 MALAYSIAGOV 230315	1,200,000.00	1,237,616.76	
		3.502MALAYSIAGOV 270531	900,000.00	943,600.05	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	1,100,000.00	1,165,582.66	
		3.795 MALAYSIAGOV 220930	500,000.00	517,044.95	
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	200,000.00	208,670.12	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	500,000.00	527,143.85	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	600,000.00	629,598.24	
		3.882 MALAYSIAGOV 220310	500,000.00	514,470.75	
		3.882 MALAYSIAGOV 250314	1,000,000.00	1,058,364.10	
		3.892 MALAYSIAGOV 270315	500,000.00	535,753.00	
		3.899 MALAYSIAGOV 271116	1,100,000.00	1,177,879.78	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	1,000,000.00	1,070,372.90	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	1,700,000.00	1,815,707.95	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	800,000.00	855,420.24	
		4.048 MALAYSIA 210930	900,000.00	922,118.49	
		4.127 MALAYSIA 320415	1,060,000.00	1,142,930.16	
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	2,250,000.00	2,299,383.90	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	1,000,000.00	1,064,468.40	
		4.254 MALAYSIAGOV 350531	850,000.00	927,704.79	
		4.392 MALAYSIAGOV 260415	900,000.00	981,259.38	
		4.498 MALAYSIAGOV 300415	1,700,000.00	1,911,762.71	
		4.642 MALAYSIAGOV 331107	1,200,000.00	1,360,029.48	
		4.736 MALAYSIAGOV 460315	1,050,000.00	1,165,784.86	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	1,600,000.00	1,843,427.52	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	600,000.00	687,126.00	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	1,200,000.00	1,408,436.76	
		5.248 MALAYSIA 280915	860,000.00	1,006,165.34	
マレーシアリングット合計			27,670,000.00	29,900,002.11 (748,098,052)	
スウェー デンク ローネ	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	2,550,000.00	2,725,213.05	
		0.75 SWD GOVT 291112	4,900,000.00	5,257,259.00	
		1 SWD GOVT 261112	5,660,000.00	6,099,820.48	
		1.5 SWD GOVT 231113	5,100,000.00	5,419,265.10	
		2.5 SWD GOVT 250512	4,630,000.00	5,266,124.96	
		3.5 SWD GOVT 220601	6,900,000.00	7,414,822.80	
		3.5 SWD GOVT 390330	3,330,000.00	5,183,451.36	

スウェーデンクローネ合計			33,070,000.00	37,365,956.75 (427,466,545)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	2,800,000.00	2,984,898.00	
		1.5 NORWE GOVT 260219	4,160,000.00	4,402,062.08	
		1.75 NORWE GOVT 250313	2,300,000.00	2,444,668.39	
		1.75 NORWE GOVT 270217	3,050,000.00	3,291,486.80	
		1.75 NORWE GOVT 290906	2,200,000.00	2,413,884.00	
		2 NORWE GOVT 230524	4,150,000.00	4,360,737.00	
		2 NORWE GOVT 280426	2,850,000.00	3,154,950.00	
		3 NORWE GOVT 240314	4,400,000.00	4,836,876.00	
ノルウェークローネ合計			25,910,000.00	27,889,562.27 (309,016,349)	
デンマーククローネ	国債証券	0.5 DMK GOVT 271115	7,350,000.00	7,847,889.00	
		0.5 DMK GOVT 291115	4,950,000.00	5,332,239.00	
		1.5 DMK GOVT 231115	4,750,000.00	5,088,223.75	
		1.75 DMK GOVT 251115	4,850,000.00	5,447,626.70	
		3 DMK GOVT 211115	6,020,000.00	6,319,832.12	
		4.5 DMK GOVT 391115	10,160,000.00	19,045,326.40	
デンマーククローネ合計			38,080,000.00	49,081,136.97 (793,641,984)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	27,300,000.00	32,696,937.00	
		10 MEXICAN BONOS 361120	6,600,000.00	8,797,734.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	11,700,000.00	11,944,062.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 210610	26,740,000.00	27,161,358.22	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	19,400,000.00	20,030,245.86	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	10,500,000.00	11,024,580.00	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	6,500,000.00	6,726,332.60	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	23,150,000.00	25,608,067.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	9,150,000.00	10,240,405.50	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	9,500,000.00	10,649,785.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	13,240,000.00	14,204,798.80	
		8 MEXICAN BONOS 231207	23,450,000.00	25,801,097.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	12,800,000.00	14,068,736.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	22,000,000.00	25,840,980.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	12,100,000.00	14,138,729.00	
メキシコペソ合計			234,130,000.00	258,933,847.98 (1,219,578,423)	
イスラエルシェケル	国債証券	2.25 ISRAEL FIXED 280928	1,900,000.00	2,196,400.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 240331	2,000,000.00	2,283,400.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	1,400,000.00	2,081,590.00	
		4.25 ISRAEL FIXED 230331	1,000,000.00	1,123,450.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 220131	3,100,000.00	3,438,675.00	

		5.5 ISRAEL FIXED 420131	1,400,000.00	2,528,190.00	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	3,500,000.00	4,930,625.00	
イスラエルシェケル合計			14,300,000.00	18,582,330.00 (577,724,639)	
ポーランド ズロチ	国債証券	1.75 POLAND 210725	1,900,000.00	1,935,172.99	
		2.25 POLAND 220425	1,250,000.00	1,299,064.25	
		2.25 POLAND 241025	1,000,000.00	1,071,271.80	
		2.5 POLAND 230125	2,500,000.00	2,644,370.75	
		2.5 POLAND 240425	2,600,000.00	2,799,593.68	
		2.5 POLAND 260725	5,500,000.00	5,998,729.00	
		2.5 POLAND 270725	2,850,000.00	3,113,748.69	
		2.75 POLAND 280425	2,660,000.00	2,954,595.00	
		3.25 POLAND 250725	1,950,000.00	2,195,419.39	
		4 POLAND 231025	2,700,000.00	3,021,039.99	
		5.75 POLAND 211025	1,700,000.00	1,829,418.62	
		5.75 POLAND 220923	1,550,000.00	1,743,827.50	
		5.75 POLAND 290425	2,070,000.00	2,841,075.00	
		POLAND 220725	800,000.00	796,948.97	
ポーランドズロチ合計			31,030,000.00	34,244,275.63 (925,622,770)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 220920	400,000.00	405,422.40	
		0 AUSTRIA GOVT 230715	950,000.00	966,859.65	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	750,000.00	764,975.25	
		0 BUND 350515	750,000.00	777,326.25	
		0 BUND 500815	590,000.00	587,262.99	
		0 FINNISH GOVT 220415	250,000.00	252,660.80	
		0 FINNISH GOVT 230915	350,000.00	356,605.13	
		0 FINNISH GOVT 240915	850,000.00	869,563.60	
		0 IRISH GOVT 221018	250,000.00	252,957.00	
		0 NETH GOVT 220115	800,000.00	807,547.20	
		0 NETH GOVT 240115	1,250,000.00	1,277,527.50	
		0 O.A.T 220525	2,700,000.00	2,731,522.50	
		0 O.A.T 230325	3,100,000.00	3,151,252.30	
		0 O.A.T 250325	3,000,000.00	3,073,020.00	
		0 O.A.T 291125	3,200,000.00	3,253,980.80	
		0 OBL 220408	1,700,000.00	1,720,762.10	
		0 OBL 221007	2,000,000.00	2,031,412.00	
		0 OBL 230414	1,400,000.00	1,428,487.20	
		0 OBL 231013	2,150,000.00	2,201,223.75	
		0 SCHATS 220311	3,900,000.00	3,944,908.50	
		0.05 SPAIN GOVT 211031	2,200,000.00	2,213,323.20	
		0.125 FINNISH GOV 360415	200,000.00	201,957.80	

0.2 BEL GOVT 231022	1,150,000.00	1,179,878.84	
0.25 BUND 270215	3,600,000.00	3,818,329.20	
0.25 BUND 280815	2,250,000.00	2,404,012.50	
0.25 BUND 290215	5,700,000.00	6,099,028.50	
0.25 NETH GOVT 250715	1,350,000.00	1,406,511.00	
0.25 NETH GOVT 290715	400,000.00	422,118.60	
0.25 O.A.T 261125	2,050,000.00	2,136,245.55	
0.35 ITALY GOVT 211101	1,350,000.00	1,358,268.21	
0.35 ITALY GOVT 250201	1,500,000.00	1,483,689.30	
0.35 SPAIN GOVT 230730	1,600,000.00	1,631,672.00	
0.4 IRISH GOVT 350515	320,000.00	325,562.24	
0.4 SPAIN GOVT 220430	1,500,000.00	1,522,920.00	
0.45 ITALY GOVT 210601	1,300,000.00	1,307,623.20	
0.45 SPAIN GOVT 221031	1,450,000.00	1,478,707.10	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,150,000.00	1,221,524.25	
0.5 BEL GOVT 241022	800,000.00	835,466.40	
0.5 BUND 250215	3,400,000.00	3,591,783.80	
0.5 BUND 260215	2,600,000.00	2,775,767.80	
0.5 BUND 270815	2,300,000.00	2,488,151.50	
0.5 BUND 280215	2,200,000.00	2,389,065.80	
0.5 FINNISH GOVT 260415	400,000.00	422,431.60	
0.5 FINNISH GOVT 270915	1,000,000.00	1,063,438.00	
0.5 FINNISH GOVT 280915	250,000.00	266,815.25	
0.5 FINNISH GOVT 290915	200,000.00	213,851.00	
0.5 NETH GOVT 260715	1,350,000.00	1,434,343.95	
0.5 O.A.T 250525	3,050,000.00	3,204,613.65	
0.5 O.A.T 260525	3,250,000.00	3,434,008.50	
0.5 O.A.T 290525	2,500,000.00	2,663,225.00	
0.6 SPAIN GOVT 291031	2,100,000.00	2,149,875.00	
0.65 ITALY GOVT 231015	2,700,000.00	2,731,455.00	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	850,000.00	914,714.75	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,010,000.00	1,095,175.21	
0.75 FINNISH GOVT 310415	350,000.00	384,774.60	
0.75 NETH GOVT 270715	1,440,000.00	1,564,462.08	
0.75 NETH GOVT 280715	1,330,000.00	1,457,536.36	
0.75 O.A.T 280525	3,100,000.00	3,358,397.40	
0.75 O.A.T 281125	3,100,000.00	3,365,868.40	
0.75 SPAIN GOVT 210730	2,600,000.00	2,634,364.20	
0.8 BEL GOVT 250622	1,300,000.00	1,383,859.10	
0.8 BEL GOVT 270622	1,080,000.00	1,165,800.60	
0.8 BEL GOVT 280622	2,100,000.00	2,281,494.60	
0.8 IRISH GOVT 220315	500,000.00	511,592.00	

0.85 ITALY GOVT 270115	1,000,000.00	996,583.60
0.875 FINNISH GOV 250915	500,000.00	536,339.50
0.9 BEL GOVT 290622	1,060,000.00	1,165,382.02
0.9 IRISH GOVT 280515	1,200,000.00	1,298,631.96
0.9 ITALY GOVT 220801	3,200,000.00	3,254,099.20
0.95 ITALY GOVT 230315	1,980,000.00	2,019,681.18
1 BEL GOVT 260622	1,100,000.00	1,193,008.30
1 BEL GOVT 310622	1,350,000.00	1,507,450.50
1 BUND 240815	2,070,000.00	2,217,980.16
1 BUND 250815	2,800,000.00	3,047,122.40
1 IRISH GOVT 260515	970,000.00	1,043,712.72
1 O.A.T 251125	1,920,000.00	2,075,892.48
1 O.A.T 270525	2,900,000.00	3,175,616.00
1 SPAIN GOVT 501031	600,000.00	557,695.80
1.1 IRISH GOVT 290515	700,000.00	772,418.50
1.125 FINNISH GOV 340415	380,000.00	439,542.96
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	910,000.00	993,715.45
1.2 ITALY GOVT 220401	1,400,000.00	1,428,141.40
1.25 BEL GOVT 330422	940,000.00	1,087,694.68
1.25 BUND 480815	2,650,000.00	3,590,008.00
1.25 ITALY GOVT 261201	1,550,000.00	1,587,626.25
1.25 O.A.T 340525	2,070,000.00	2,404,233.37
1.25 O.A.T 360525	2,730,000.00	3,186,401.40
1.3 IRISH GOVT 330515	400,000.00	457,997.36
1.3 SPAIN GOVT 261031	1,950,000.00	2,106,237.90
1.35 IRISH GOVT 310318	340,000.00	386,794.20
1.35 ITALY GOVT 220415	1,150,000.00	1,176,333.85
1.35 ITALY GOVT 300401	1,900,000.00	1,921,441.50
1.375 FINNISH GOV 470415	240,000.00	313,684.08
1.4 SPAIN GOVT 280430	1,500,000.00	1,639,647.15
1.4 SPAIN GOVT 280730	1,900,000.00	2,079,521.50
1.45 BEL GOVT 370622	390,000.00	466,589.76
1.45 ITALY GOVT 220915	1,400,000.00	1,440,952.80
1.45 ITALY GOVT 241115	1,600,000.00	1,662,320.00
1.45 ITALY GOVT 250515	1,600,000.00	1,660,716.80
1.45 ITALY GOVT 360301	750,000.00	727,944.00
1.45 SPAIN GOVT 271031	2,100,000.00	2,297,748.60
1.45 SPAIN GOVT 290430	1,620,000.00	1,781,459.40
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	570,000.00	746,641.29
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	200,000.00	296,770.49
1.5 BUND 220904	1,300,000.00	1,363,228.10
1.5 BUND 230215	2,500,000.00	2,647,877.50
1.5 BUND 230515	2,000,000.00	2,129,148.00

1.5 BUND 240515	1,860,000.00	2,021,617.26	
1.5 FINNISH GOVT 230415	250,000.00	264,710.25	
1.5 IRISH GOVT 500515	410,000.00	502,040.49	
1.5 ITALY GOVT 250601	1,550,000.00	1,613,836.75	
1.5 O.A.T 310525	3,390,000.00	3,985,402.65	
1.5 O.A.T 500525	1,780,000.00	2,231,856.56	
1.5 SPAIN GOVT 270430	1,450,000.00	1,590,108.86	
1.6 BEL GOVT 470622	880,000.00	1,105,932.96	
1.6 ITALY GOVT 260601	1,350,000.00	1,412,681.85	
1.6 SPAIN GOVT 250430	1,800,000.00	1,951,698.60	
1.625 FINNISH GOV 220915	300,000.00	314,917.80	
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	700,000.00	768,056.80	
1.65 ITALY GOVT 320301	2,050,000.00	2,105,257.75	
1.7 BEL GOVT 500622	490,000.00	636,105.75	
1.7 IRISH GOVT 370515	400,000.00	488,270.40	
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1,200,000.00	1,293,916.80	
1.75 BUND 220704	2,300,000.00	2,413,882.20	
1.75 BUND 240215	4,450,000.00	4,854,562.85	
1.75 NETH GOVT 230715	1,000,000.00	1,072,941.00	
1.75 O.A.T 230525	6,850,000.00	7,321,643.05	
1.75 O.A.T 241125	3,550,000.00	3,915,206.25	
1.75 O.A.T 390625	1,820,000.00	2,313,198.16	
1.75 O.A.T 660525	1,190,000.00	1,687,788.90	
1.85 ITALY GOVT 240515	1,270,000.00	1,337,795.14	
1.85 SPAIN GOVT 350730	1,090,000.00	1,254,721.89	
1.9 BEL GOVT 380622	700,000.00	894,846.40	
1.95 SPAIN GOVT 260430	1,900,000.00	2,120,770.88	
1.95 SPAIN GOVT 300730	1,920,000.00	2,210,972.16	
2 BUND 220104	1,500,000.00	1,562,440.50	
2 BUND 230815	1,450,000.00	1,575,285.80	
2 FINNISH GOVT 240415	200,000.00	219,867.10	
2 IRISH GOVT 450218	590,000.00	792,240.20	
2 ITALY GOVT 251201	1,730,000.00	1,847,176.36	
2 ITALY GOVT 280201	1,800,000.00	1,927,389.60	
2 NETH GOVT 240715	950,000.00	1,051,671.85	
2 O.A.T 480525	2,120,000.00	2,925,368.92	
2.05 ITALY GOVT 270801	1,300,000.00	1,395,538.30	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	420,000.00	805,288.68	
2.1 ITALY GOVT 260715	1,350,000.00	1,449,855.45	
2.15 BEL GOVT 660622	570,000.00	892,834.32	
2.15 SPAIN GOVT 251031	1,200,000.00	1,343,046.00	
2.2 ITALY GOVT 270601	1,400,000.00	1,516,620.00	

2.25 BEL GOVT 230622	820,000.00	890,376.50
2.25 BEL GOVT 570622	360,000.00	547,071.69
2.25 ITALY GOVT 360901	1,260,000.00	1,355,142.60
2.25 NETH GOVT 220715	900,000.00	953,740.44
2.25 O.A.T 221025	3,850,000.00	4,108,374.65
2.25 O.A.T 240525	3,340,000.00	3,713,024.56
2.35 SPAIN GOVT 330730	1,740,000.00	2,110,295.31
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	590,000.00	788,083.06
2.4 IRISH GOVT 300515	800,000.00	989,812.56
2.45 ITALY GOVT 330901	1,550,000.00	1,715,350.74
2.45 ITALY GOVT 500901	1,080,000.00	1,129,229.64
2.5 BUND 440704	1,980,000.00	3,224,631.96
2.5 BUND 460815	2,030,000.00	3,388,019.25
2.5 ITALY GOVT 241201	1,800,000.00	1,949,760.00
2.5 ITALY GOVT 251115	1,410,000.00	1,541,053.01
2.5 NETH GOVT 330115	1,660,000.00	2,233,259.42
2.5 O.A.T 300525	3,070,000.00	3,888,062.90
2.6 BEL GOVT 240622	1,180,000.00	1,329,629.90
2.625 FINNISH GOV 420704	350,000.00	540,116.50
2.7 ITALY GOVT 470301	1,380,000.00	1,530,367.56
2.7 SPAIN GOVT 481031	1,020,000.00	1,374,315.15
2.75 FINNISH GOVT 280704	530,000.00	662,487.28
2.75 NETH GOVT 470115	1,230,000.00	2,116,117.83
2.75 O.A.T 271025	3,270,000.00	4,024,552.50
2.75 SPAIN GOVT 241031	2,050,000.00	2,312,881.75
2.8 ITALY GOVT 281201	1,550,000.00	1,761,024.75
2.8 ITALY GOVT 670301	660,000.00	726,157.60
2.9 SPAIN GOVT 461031	1,310,000.00	1,811,708.90
2.95 ITALY GOVT 380901	1,250,000.00	1,455,927.50
3 BEL GOVT 340622	610,000.00	855,669.57
3 ITALY GOVT 290801	1,460,000.00	1,690,408.44
3 O.A.T 220425	5,500,000.00	5,865,783.00
3.1 ITALY GOVT 400301	590,000.00	700,307.93
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	560,000.00	945,307.72
3.25 BUND 420704	1,270,000.00	2,229,916.80
3.25 ITALY GOVT 460901	1,150,000.00	1,395,345.60
3.25 NETH GOVT 210715	1,600,000.00	1,664,877.28
3.25 O.A.T 450525	2,010,000.00	3,318,968.28
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	1,250,000.00	1,371,300.00
3.4 IRISH GOVT 240318	600,000.00	686,603.88
3.45 ITALY GOVT 480301	1,190,000.00	1,496,448.80
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,120,000.00	1,836,110.08
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	1,050,000.00	1,102,391.11

3.5 ITALY GOVT 300301	1,910,000.00	2,302,354.11	
3.5 O.A.T 260425	2,550,000.00	3,146,052.30	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	600,000.00	646,665.36	
3.75 BEL GOVT 450622	850,000.00	1,494,278.75	
3.75 ITALY GOVT 210801	3,000,000.00	3,128,709.00	
3.75 ITALY GOVT 240901	1,500,000.00	1,697,925.00	
3.75 NETH GOVT 230115	300,000.00	333,878.85	
3.75 NETH GOVT 420115	1,300,000.00	2,362,360.00	
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	440,000.00	1,004,653.32	
3.8 SPAIN GOVT 240430	2,300,000.00	2,659,271.50	
3.85 ITALY GOVT 490901	920,000.00	1,237,423.92	
3.9 IRISH GOVT 230320	400,000.00	448,383.84	
4 BEL GOVT 220328	750,000.00	811,330.50	
4 BEL GOVT 320328	620,000.00	913,353.00	
4 BUND 370104	1,750,000.00	3,005,355.84	
4 FINNISH GOVT 250704	300,000.00	369,313.20	
4 ITALY GOVT 370201	2,260,000.00	2,962,048.66	
4 NETH GOVT 370115	1,650,000.00	2,783,107.80	
4 O.A.T 381025	1,890,000.00	3,161,338.35	
4 O.A.T 550425	1,440,000.00	2,965,204.80	
4 O.A.T 600425	1,310,000.00	2,843,369.41	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,100,000.00	1,844,219.30	
4.2 SPAIN GOVT 370131	1,470,000.00	2,237,462.01	
4.25 BEL GOVT 210928	950,000.00	1,008,020.49	
4.25 BEL GOVT 220928	1,100,000.00	1,221,930.05	
4.25 BEL GOVT 410328	1,380,000.00	2,429,156.04	
4.25 BUND 390704	1,650,000.00	3,069,168.30	
4.25 O.A.T 231025	3,590,000.00	4,176,221.87	
4.4 SPAIN GOVT 231031	2,350,000.00	2,721,476.25	
4.5 BEL GOVT 260328	930,000.00	1,196,458.95	
4.5 ITALY GOVT 230501	2,300,000.00	2,577,389.20	
4.5 ITALY GOVT 240301	2,120,000.00	2,433,948.68	
4.5 ITALY GOVT 260301	1,700,000.00	2,050,944.60	
4.5 O.A.T 410425	2,800,000.00	5,136,740.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	2,050,000.00	2,548,543.60	
4.7 SPAIN GOVT 410730	1,550,000.00	2,628,431.24	
4.75 BUND 280704	1,280,000.00	1,838,054.40	
4.75 BUND 340704	2,040,000.00	3,532,836.50	
4.75 BUND 400704	1,340,000.00	2,687,128.80	
4.75 ITALY GOVT 210901	3,000,000.00	3,173,829.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	1,700,000.00	1,933,869.00	
4.75 ITALY GOVT 280901	2,000,000.00	2,572,863.20	

	4.75 ITALY GOVT 440901	1,460,000.00	2,181,310.08	
	4.75 O.A.T 350425	2,400,000.00	4,048,776.00	
	4.8 SPAIN GOVT 240131	1,900,000.00	2,248,273.80	
	4.85 AUSTRIA GOVT 260315	550,000.00	720,295.40	
	4.9 SPAIN GOVT 400730	1,360,000.00	2,327,140.88	
	5 BEL GOVT 350328	1,520,000.00	2,596,471.60	
	5 ITALY GOVT 220301	1,500,000.00	1,626,444.00	
	5 ITALY GOVT 250301	2,370,000.00	2,848,145.13	
	5 ITALY GOVT 340801	2,460,000.00	3,490,870.87	
	5 ITALY GOVT 390801	1,750,000.00	2,608,335.09	
	5 ITALY GOVT 400901	1,850,000.00	2,766,983.95	
	5.15 SPAIN GOVT 281031	1,950,000.00	2,737,725.90	
	5.15 SPAIN GOVT 441031	1,160,000.00	2,146,222.72	
	5.25 ITALY GOVT 291101	2,100,000.00	2,849,280.00	
	5.4 IRISH GOVT 250313	700,000.00	892,478.30	
	5.4 SPAIN GOVT 230131	1,750,000.00	2,012,549.00	
	5.5 BEL GOVT 280328	1,200,000.00	1,744,766.40	
	5.5 BUND 310104	1,460,000.00	2,393,878.78	
	5.5 ITALY GOVT 220901	1,150,000.00	1,285,176.75	
	5.5 ITALY GOVT 221101	2,200,000.00	2,474,872.40	
	5.5 NETH GOVT 280115	1,150,000.00	1,673,491.50	
	5.5 O.A.T 290425	2,750,000.00	4,164,275.50	
	5.625 BUND 280104	1,250,000.00	1,845,555.00	
	5.75 ITALY GOVT 330201	1,930,000.00	2,859,188.85	
	5.75 O.A.T 321025	2,710,000.00	4,651,270.56	
	5.75 SPAIN GOVT 320730	2,650,000.00	4,263,945.40	
	5.85 SPAIN GOVT 220131	1,850,000.00	2,036,561.40	
	5.9 SPAIN GOVT 260730	1,700,000.00	2,310,229.28	
	6 ITALY GOVT 310501	2,530,000.00	3,706,064.17	
	6 O.A.T 251025	3,700,000.00	5,000,339.10	
	6 SPAIN GOVT 290131	2,450,000.00	3,639,620.76	
	6.25 AUSTRIA GOVT 270715	970,000.00	1,429,559.81	
	6.25 BUND 240104	1,130,000.00	1,411,095.41	
	6.25 BUND 300104	950,000.00	1,576,628.55	
	6.5 BUND 270704	1,200,000.00	1,812,234.00	
	6.5 ITALY GOVT 271101	2,070,000.00	2,864,569.50	
	7.25 ITALY GOVT 261101	1,400,000.00	1,949,517.36	
	7.5 NETH GOVT 230115	650,000.00	786,617.00	
	8.5 O.A.T 230425	1,300,000.00	1,637,864.02	
	9 ITALY GOVT 231101	1,200,000.00	1,546,143.00	
ユーロ合計		430,890,000.00	520,510,225.77 (62,731,892,409)	

合計		155,778,578,883 (155,778,578,883)	
----	--	--------------------------------------	--

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 164銘柄	100.00%	45.40%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.00%	1.93%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.00%	2.14%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.00%	6.59%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.00%	0.45%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.00%	0.48%
スウェーデンクローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.27%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.20%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.00%	0.51%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.00%	0.78%
イスラエルシェケル	国債証券 7銘柄	100.00%	0.37%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.00%	0.59%
ユーロ	国債証券 274銘柄	100.00%	40.27%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

新興国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	281,715,012
コール・ローン	55,718,682
国債証券	30,708,857,281
派生商品評価勘定	122,388
未収利息	364,442,499

[令和 2年 6月25日現在]

前払費用	43,664,705
流動資産合計	31,454,520,567
資産合計	31,454,520,567
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	278,399
前受収益	3,512
未払金	88,347,639
未払解約金	14,795,163
未払利息	81
流動負債合計	103,424,794
負債合計	103,424,794
純資産の部	
元本等	
元本	23,661,199,073
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,689,896,700
元本等合計	31,351,095,773
純資産合計	31,351,095,773
負債純資産合計	31,454,520,567

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	16,936,877,489円
期中追加設定元本額	8,599,440,741円
期中一部解約元本額	1,875,119,157円
元本の内訳	
e M A X I S バランス（8資産均等型）	2,798,970,437円
e M A X I S バランス（波乗り型）	353,745,885円
三菱U F J プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	649,402,002円
コアバランス	1,510,532円
海外債券セレクション（ラップ向け）	154,740,635円
e M A X I S S l i m バランス（8資産均等型）	5,100,791,193円

	[令和 2年 6月25日現在]
つみたて 8 資産均等バランス	2,094,889,973円
e M A X I S マイマネージャー 1 9 7 0 s	1,200,963円
e M A X I S マイマネージャー 1 9 8 0 s	2,124,821円
e M A X I S マイマネージャー 1 9 9 0 s	317,045円
e M A X I S 新興国債券インデックス	4,196,083,966円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国債券インデックスファンド	7,705,885,440円
新興国債券インデックスファンド（ラップ向け）	8,048,632円
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	45,024,818円
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	246,376,552円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	201,548,146円
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	56,224,323円
アドバンスト・バランス （ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	7,863,232円
アドバンスト・バランス （ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	14,049,651円
世界 8 資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	22,400,827円
合計	23,661,199,073円
2. 受益権の総数	23,661,199,073口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

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

２ 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 6月25日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	358,970,179
合計	358,970,179

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和 2年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	インドネシアルピア	13,955,739	—	14,076,127	120,388
	メキシコペソ	4,234,545	—	4,230,000	4,545
	ブラジルリアル	8,467,324	—	8,208,200	259,124

	チェココルナ	2,704,500	—	2,706,000	1,500
	ポーランドズロチ	4,067,730	—	4,053,000	14,730
	ルーマニアレイ	2,488,500	—	2,489,000	500
	合計	35,918,338	—	35,762,327	156,011

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.3250円
(1万口当たり純資産額)	(13,250円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
マレーシア リン ギット	国債証券	3.62 MALAYSIAGOV 211130	6,200,000.00	6,333,674.48	
		3.733 MALAYSIAGO 280615	5,900,000.00	6,251,761.54	
		3.8 MALAYSIAGOV 230817	7,600,000.00	7,929,464.56	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	3,800,000.00	4,006,293.25	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	5,600,000.00	6,042,251.60	

		3.899 MALAYSIAGOV 271116	7,100,000.00	7,602,678.58	
		3.9 MALAYSIAGOV 261130	7,020,000.00	7,514,017.75	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	8,400,000.00	8,981,912.52	
		4.059 MALAYSIAGOV 240930	6,700,000.00	7,122,274.87	
		4.16 MALAYSIAGOV 210715	4,800,000.00	4,905,352.32	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	5,500,000.00	5,854,576.20	
		4.369 MALAYSIA IN 281031	7,200,000.00	7,973,110.08	
		4.762 MALAYSIAGOV 370407	3,500,000.00	4,032,497.70	
マレーシアリングット合計			79,320,000.00	84,549,865.45 (2,115,437,633)	
タイバーツ	国債証券	1.45 THAILAND 241217	22,500,000.00	23,159,281.50	
		1.6 THAILAND 291217	11,000,000.00	11,403,807.80	
		1.875 THAILAND 220617	44,000,000.00	45,175,864.80	
		2 THAILAND 221217	42,300,000.00	43,817,186.79	
		2.125 THAILAND 261217	51,700,000.00	55,358,715.94	
		2.4 THAILAND 231217	48,100,000.00	50,985,692.16	
		2.875 THAILAND 281217	42,800,000.00	48,592,684.68	
		2.875 THAILAND 460617	42,200,000.00	49,506,199.94	
		3.3 THAILAND 380617	41,900,000.00	51,757,259.92	
		3.4 THAILAND 360617	60,000,000.00	74,123,646.00	
		3.625 THAILAND 230616	47,900,000.00	52,145,999.70	
		3.65 THAILAND 211217	49,700,000.00	52,018,236.62	
		3.65 THAILAND 310620	49,900,000.00	61,122,919.18	
		3.775 THAILAND 320625	61,000,000.00	75,910,022.60	
		3.85 THAILAND 251212	51,800,000.00	59,936,557.52	
4.875 THAILAND 290622	54,800,000.00	71,375,493.00			
タイバーツ合計			721,600,000.00	826,389,568.15 (2,867,571,801)	
フィリピンペソ	国債証券	6.25 PHILIPPI (GL) 360114	20,000,000.00	24,575,760.00	
フィリピンペソ合計			20,000,000.00	24,575,760.00 (52,592,126)	
インドネシアルピア	国債証券	10.5 INDONESIA 300815	7,050,000,000.00	8,583,939,000.00	
		11 INDONESIA 250915	1,650,000,000.00	1,959,705,000.00	
		5.625 INDONESIA 230515	38,200,000,000.00	37,722,500,000.00	
		6.125 INDONESIA 280515	37,700,000,000.00	35,468,160,000.00	
		6.5 INDONESIA 250615	28,200,000,000.00	28,200,000,000.00	
		6.625 INDONESIA 330515	27,900,000,000.00	25,578,720,000.00	
		7 INDONESIA 220515	17,750,000,000.00	18,163,575,000.00	
		7 INDONESIA 270515	18,450,000,000.00	18,560,700,000.00	
		7 INDONESIA 300915	15,800,000,000.00	15,697,300,000.00	
		7.5 INDONESIA 320815	8,900,000,000.00	8,814,560,000.00	
		7.5 INDONESIA 380515	17,100,000,000.00	16,923,870,000.00	

		8.25 INDONESIA 210715	13,400,000,000.00	13,846,890,000.00	
		8.25 INDONESIA 290515	9,500,000,000.00	10,180,200,000.00	
		8.25 INDONESIA 320615	8,800,000,000.00	9,226,800,000.00	
		8.25 INDONESIA 360515	18,900,000,000.00	19,625,760,000.00	
		8.375 INDONESIA 240315	32,700,000,000.00	34,828,770,000.00	
		8.375 INDONESIA 260915	26,730,000,000.00	28,828,305,000.00	
		8.375 INDONESIA 340315	24,300,000,000.00	25,614,630,000.00	
		8.375 INDONESIA 390415	12,200,000,000.00	12,855,140,000.00	
		8.75 INDONESIA 310515	12,100,000,000.00	13,224,090,000.00	
		9 INDONESIA 290315	15,500,000,000.00	17,232,900,000.00	
		9.5 INDONESIA 310715	6,150,000,000.00	7,045,440,000.00	
インドネシアルピア合計			398,980,000,000.00	408,181,954,000.00 (3,102,182,850)	
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	51,900,000.00	62,160,111.00	
		10 MEXICAN BONOS 361120	14,700,000.00	19,594,953.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	37,700,000.00	38,486,422.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	67,200,000.00	69,383,119.68	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	20,000,000.00	20,999,200.00	
		7.25 MEXICAN BONO 211209	27,500,000.00	28,457,561.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	59,700,000.00	66,038,946.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	29,300,000.00	32,791,681.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	18,400,000.00	20,626,952.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	41,900,000.00	44,953,253.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	48,300,000.00	53,142,558.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	38,000,000.00	42,332,380.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	27,300,000.00	30,005,976.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	50,200,000.00	58,964,418.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	34,200,000.00	39,962,358.00	
メキシコペソ合計			566,300,000.00	627,899,888.68 (2,957,408,475)	
ブラジル レアル	国債証券	10 (IN)BRAZIL NT 270101	14,770,000.00	18,089,338.90	
		10 (IN)BRAZIL NTN 250101	18,550,000.00	22,511,947.95	
		10(IN) BRAZIL NTN 290101	6,700,000.00	8,280,524.64	
		10(IN)BRAZIL NTN-F230101	25,700,000.00	30,382,781.58	
		BRAZIL-LTN 210701	10,300,000.00	10,054,263.80	
		BRAZIL-LTN 220101	16,600,000.00	15,861,390.57	
		BRAZIL-LTN 220701	17,800,000.00	16,559,754.34	
		BRAZIL-LTN 230701	26,700,000.00	23,234,784.78	
		BRAZIL-LTN 240101	9,000,000.00	7,536,546.54	
ブラジルレアル合計			146,120,000.00	152,511,333.10 (3,053,276,888)	
チリペソ	国債証券	4 BONOS TESORERIA 230301	400,000,000.00	445,263,080.00	

		4.5 BONOS TESORER 260301	1,200,000,000.00	1,430,932,320.00	
		4.7 BONOS TESORER 300901	1,000,000,000.00	1,239,926,000.00	
		5 BONOS TESORERIA 350301	1,100,000,000.00	1,424,828,680.00	
		6 BONOS TESORERIA 430101	890,000,000.00	1,371,465,792.00	
チリペソ合計			4,590,000,000.00	5,912,415,872.00 (772,752,754)	
チェココ ルナ	国債証券	0.25 CZECH REPUBL 270210	34,000,000.00	33,067,624.80	
		0.45 CZECH REPUBL 231025	48,900,000.00	49,087,022.94	
		0.95 CZECH REPUBL 300515	25,200,000.00	25,442,101.44	
		1 CZECH REPUBLIC 260626	29,800,000.00	30,387,060.00	
		2 CZECH REPUBLIC 331013	26,200,000.00	29,687,220.00	
		2.4 CZECH REPUBLI 250917	26,800,000.00	29,337,960.00	
		2.5 CZECH REPUBLI 280825	28,000,000.00	31,937,220.00	
		2.75 CZECH REPUBL 290723	28,000,000.00	32,766,095.60	
		3.85 CZECH REPUBL 210929	21,600,000.00	22,640,040.00	
		4.7 CZECH REPUBLI 220912	14,900,000.00	16,404,900.00	
		5.7 CZECH REPUBLI 240525	18,500,000.00	22,380,689.50	
チェココルナ合計			301,900,000.00	323,137,934.28 (1,457,352,083)	
コロンビ アペソ	国債証券	10 TITULOS DE TES 240724	8,900,000,000.00	10,929,780,280.00	
		4.375 COLOMBI(GL) 230321	1,680,000,000.00	1,689,525,432.00	
		6 TITULOS DE TESO 280428	7,380,000,000.00	7,500,236,436.00	
		6.25 TITULOS DE T 251126	5,690,000,000.00	6,131,895,642.00	
		7 TITULOS DE TESO 220504	7,410,000,000.00	7,920,811,314.00	
		7 TITULOS DE TESO 320630	6,000,000,000.00	6,181,008,600.00	
		7.25 TITULOS DE T 341018	3,300,000,000.00	3,433,867,800.00	
		7.5 TITULOS DE TE 260826	7,770,000,000.00	8,789,654,769.00	
		7.75 TITULOS DE T 300918	4,860,000,000.00	5,331,090,006.00	
		9.85 COLOMBI (GL) 270628	1,290,000,000.00	1,634,688,000.00	
コロンピアペソ合計			54,280,000,000.00	59,542,558,279.00 (1,708,871,422)	
ハンガ リーフォ リント	国債証券	1.75 HUNGARY 221026	307,000,000.00	313,385,600.00	
		2.5 HUNGARY 211027	40,000,000.00	41,157,000.00	
		2.5 HUNGARY 241024	150,000,000.00	158,545,950.00	
		2.75 HUNGARY 261222	243,000,000.00	262,998,754.20	
		3 HUNGARY 240626	329,000,000.00	354,168,500.00	
		3 HUNGARY 271027	358,000,000.00	392,887,064.20	
		3 HUNGARY 300821	235,000,000.00	255,004,727.50	
		3.25 HUNGARY 311022	135,000,000.00	150,585,115.50	
		5.5 HUNGARY 250624	412,000,000.00	497,428,200.00	
		6 HUNGARY 231124	333,000,000.00	388,261,350.00	
		6.75 HUNGARY 281022	182,000,000.00	251,478,500.00	

		7 HUNGARY 220624	185,000,000.00	208,430,250.00	
ハンガリーフォリント合計			2,909,000,000.00	3,274,331,011.40 (1,121,458,371)	
ペルーヌ エボソル	国債証券	5.35 PERU 400812	2,100,000.00	2,142,695.94	
		5.4 PERU 340812	2,600,000.00	2,769,571.48	
		5.7 PERU 240812	1,300,000.00	1,506,129.30	
		5.94 PERU 290212	4,100,000.00	4,731,930.13	
		6.15 PERU 320812	2,800,000.00	3,219,518.96	
		6.35 PERU 280812	3,900,000.00	4,612,046.01	
		6.9 PERU 370812	4,600,000.00	5,576,477.88	
		6.95 PERU 310812	5,300,000.00	6,489,239.97	
		8.2 PERU 260812	3,200,000.00	4,142,605.12	
ペルーヌエボソル合計			29,900,000.00	35,190,214.79 (1,073,301,551)	
ポーランド ズロチ	国債証券	1.75 POLAND 210725	7,000,000.00	7,129,584.70	
		2.25 POLAND 220425	7,400,000.00	7,690,460.36	
		2.25 POLAND 241025	6,000,000.00	6,427,630.80	
		2.5 POLAND 230125	7,700,000.00	8,144,661.91	
		2.5 POLAND 240425	8,100,000.00	8,721,811.08	
		2.5 POLAND 260725	9,600,000.00	10,470,508.80	
		2.5 POLAND 270725	7,700,000.00	8,412,584.18	
		2.75 POLAND 280425	7,400,000.00	8,219,550.00	
		2.75 POLAND 291025	7,400,000.00	8,320,089.36	
		3.25 POLAND 250725	6,800,000.00	7,655,821.48	
		4 POLAND 231025	6,400,000.00	7,160,983.68	
		5.75 POLAND 211025	4,300,000.00	4,627,352.98	
		5.75 POLAND 220923	5,600,000.00	6,300,280.00	
		ポーランドズロチ合計			91,400,000.00
南アフリ カランド	国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	61,100,000.00	70,174,877.50	
		6.25 SOUTH AFRICA 360331	22,400,000.00	14,925,389.02	
		6.5 SOUTH AFRICA 410228	22,300,000.00	14,046,770.00	
		7 SOUTH AFRICA 310228	28,500,000.00	23,568,075.00	
		7.75 SOUTH AFRICA 230228	25,400,000.00	27,120,342.00	
		8 SOUTH AFRICA 300131	46,700,000.00	43,256,980.38	
		8.25 SOUTH AFRICA 320331	29,500,000.00	25,823,096.99	
		8.5 SOUTH AFRICA 370131	34,300,000.00	27,758,887.43	
		8.75 SOUTH AFRICA 440131	35,000,000.00	27,752,621.40	
		8.75 SOUTH AFRICA 480228	55,300,000.00	42,968,100.00	
		8.875 SOUTH AFRIC 350228	29,600,000.00	25,591,585.76	
		9 SOUTH AFRICA 400131	25,600,000.00	21,189,731.06	
					415,700,000.00

南アフリカランド合計				(2,239,685,207)	
ウルグアイペソ	国債証券	8.5 URUGUAY(GL) 280315	7,000,000.00	6,311,738.58	
		9.875 URUGUAY(GL) 220620	8,200,000.00	8,191,800.00	
ウルグアイペソ合計			15,200,000.00	14,503,538.58 (36,838,987)	
ロシアルーブル	国債証券	6.5 RUSSIA OFZ 240228	90,000,000.00	95,471,100.00	
		6.9 RUSSIA OFZ 290523	92,200,000.00	101,695,678.00	
		7 RUSSIA GOVT 230125	36,500,000.00	38,666,275.00	
		7 RUSSIA GOVT BON 230816	62,000,000.00	66,355,190.00	
		7 RUSSIA OFZ 211215	82,500,000.00	85,580,550.00	
		7.05 RUSSIA GOVT 280119	106,700,000.00	118,416,727.00	
		7.1 RUSSIA OFZ 241016	87,400,000.00	95,266,874.00	
		7.25 RUSSIA OFZ 340510	76,300,000.00	86,590,962.50	
		7.4 RUSSIA OFZ 221207	86,700,000.00	92,504,998.50	
		7.4 RUSSIA OFZ 240717	98,000,000.00	107,803,430.00	
		7.5 RUSSIA OFZ 210818	66,900,000.00	69,272,274.00	
		7.6 RUSSIA GOVT 220720	76,000,000.00	80,811,180.00	
		7.65 RUSSIA OFZ 300410	8,000,000.00	9,254,040.00	
		7.7 RUSSIA OFZ 330323	95,700,000.00	111,922,107.00	
		7.7 RUSSIA OFZ 390316	73,000,000.00	87,723,735.00	
		7.75 RUSSIA OFZ 260916	139,600,000.00	159,297,560.00	
		7.95 RUSSIA OFZ 261007	79,300,000.00	91,532,025.00	
		8.15 RUSSIA GOVT 270203	111,000,000.00	129,699,615.00	
		8.5 RUSSIA OFZ 310917	96,200,000.00	118,609,790.00	
		ロシアルーブル合計			1,564,000,000.00
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	7,000,000.00	6,816,565.00	
		2.94 CHINA GOVT 241017	7,000,000.00	7,110,420.10	
		3.12 CHINA GOVT 261205	12,000,000.00	12,221,214.00	
		3.13 CHINA GOVT 291121	10,000,000.00	10,193,000.00	
		3.19 CHINA GOVT 240411	6,000,000.00	6,143,519.40	
		3.25 CHINA GOVT 260606	6,200,000.00	6,354,535.00	
		3.29 CHINA GOVT 231018	5,000,000.00	5,115,450.50	
		3.29 CHINA GOVT 290523	6,000,000.00	6,165,120.00	
中国元合計			59,200,000.00	60,119,824.00 (909,612,937)	
ドミニカペソ	国債証券	8.9 DOMINICAN 230215	8,000,000.00	7,500,000.00	
		9.75 DOMINICAN 260605	16,000,000.00	14,440,000.00	
ドミニカペソ合計			24,000,000.00	21,940,000.00 (39,930,800)	
ルーマニアレイ	国債証券	3.25 ROMANIA GOVE 240429	4,400,000.00	4,345,352.00	
		3.4 ROMANIA GOVER 220308	3,300,000.00	3,301,221.00	

		3.5 ROMANIA GOVER 221219	3,500,000.00	3,506,877.50	
		3.65 ROMANIA GOVE 310924	1,600,000.00	1,518,128.00	
		4.25 ROMANIA GOVE 230628	3,200,000.00	3,268,272.00	
		4.5 ROMANIA GOVER 240617	3,300,000.00	3,404,494.50	
		4.75 ROMANIA GOVE 250224	6,300,000.00	6,593,926.50	
		5 ROMANIA GOVERN 290212	2,760,000.00	2,969,263.20	
		5.8 ROMANIA GOV 270726	3,600,000.00	4,054,277.88	
		5.85 ROMANIA GOVE 230426	3,500,000.00	3,719,677.50	
ルーマニアレイ合計			35,460,000.00	36,681,490.08 (913,369,102)	
トルコリラ	国債証券	10.4 TURKEY GOVT 240320	2,400,000.00	2,425,200.00	
		10.5 TURKEY GOVT 270811	5,600,000.00	5,348,000.00	
		10.6 TURKEY GOVT 260211	6,200,000.00	6,110,100.00	
		10.7 TURKEY GOVT 220817	4,400,000.00	4,540,800.00	
		11 TURKEY GOVT 220302	4,400,000.00	4,549,600.00	
		11 TURKEY GOVT 270224	4,500,000.00	4,407,750.00	
		12.2 TURKEY GOVT 230118	4,600,000.00	4,889,800.00	
		12.4 TURKEY GOVT 280308	3,100,000.00	3,233,300.00	
		16.2 TURKEY GOVT 230614	2,800,000.00	3,267,600.00	
		7.1 TURKEY GOVT 230308	3,400,000.00	3,199,400.00	
		8 TURKEY GOVT 250312	4,000,000.00	3,627,720.00	
		8.5 TURKEY GOVT 220914	3,400,000.00	3,369,689.00	
		9 TURKEY GOVT 240724	4,000,000.00	3,901,920.00	
		9.2 TURKEY GOVT 210922	3,000,000.00	3,029,250.00	
		9.5 TURKEY GOVT 220112	3,700,000.00	3,737,185.00	
トルコリラ合計			59,500,000.00	59,637,314.00 (931,534,844)	
合計				30,708,857,281 (30,708,857,281)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
マレーシアリングット	国債証券 13銘柄	100.00%	6.89%
タイバーツ	国債証券 16銘柄	100.00%	9.34%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.17%
インドネシアルピア	国債証券 22銘柄	100.00%	10.10%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.00%	9.63%
ブラジルリアル	国債証券 9銘柄	100.00%	9.94%

チリペソ	国債証券	5銘柄	100.00%	2.52%
チェココルナ	国債証券	11銘柄	100.00%	4.75%
コロンビアペソ	国債証券	10銘柄	100.00%	5.56%
ハンガリーフォリント	国債証券	12銘柄	100.00%	3.65%
ペルーヌエボソル	国債証券	9銘柄	100.00%	3.50%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.00%	8.74%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.00%	7.29%
ウルグアイペソ	国債証券	2銘柄	100.00%	0.12%
ロシアルーブル	国債証券	19銘柄	100.00%	8.70%
中国元	国債証券	8銘柄	100.00%	2.96%
ドミニカペソ	国債証券	2銘柄	100.00%	0.13%
ルーマニアレイ	国債証券	10銘柄	100.00%	2.97%
トルコリラ	国債証券	15銘柄	100.00%	3.03%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,186,051,886
投資証券	31,793,932,420
未収配当金	172,544,770
未収利息	388,445
前払金	10,315,500
その他未収収益	331,694
差入委託証拠金	66,744,000
流動資産合計	43,230,308,715
資産合計	43,230,308,715
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,036,090
未払解約金	7,468,863
未払利息	16,408
受入担保金	10,879,281,231
流動負債合計	10,904,802,592
負債合計	10,904,802,592
純資産の部	
元本等	

[令和 2年 6月25日現在]

元本	11,373,375,169
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	20,952,130,954
元本等合計	32,325,506,123
純資産合計	32,325,506,123
負債純資産合計	43,230,308,715

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	8,310,966,054円
期中追加設定元本額	7,638,917,076円
期中一部解約元本額	4,576,507,961円
元本の内訳	
e M A X I S 国内リートインデックス	4,824,217,704円
e M A X I S バランス（８資産均等型）	1,291,783,375円
e M A X I S バランス（波乗り型）	164,227,138円
三菱ＵＦＪ < D C > J - R E I Tインデックスファンド	103,803,004円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	222,978,406円
J - R E I Tインデックスファンド（ラップ向け）	231,620,938円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）	183,256,289円
e M A X I S S l i m バランス（８資産均等型）	2,372,407,439円
つみたて８資産均等バランス	969,598,069円
e M A X I S マイマネージャー １９７０ｓ	477,395円
e M A X I S マイマネージャー １９８０ｓ	657,993円
e M A X I S マイマネージャー １９９０ｓ	148,620円
e M A X I S S l i m 国内リートインデックス	767,434,253円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	2,964,387円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	21,222,097円
e M A X I S 最適化バランス（マイゴールキーパー）	13,889,858円
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	20,878,755円
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	85,654,413円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	62,434,108円

	[令和 2年 6月25日現在]
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	26,029,292円
世界8資産バランスファンドV L（適格機関投資家限定）	7,691,636円
合計	11,373,375,169円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。	
投資証券	10,283,594,500円
3. 受益権の総数	11,373,375,169口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

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

区分	[令和 2年 6月25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	(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	6,189,724,059
合計	6,189,724,059

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[令和 2年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	549,052,000	—	531,040,000	18,012,000
合計		549,052,000	—	531,040,000	18,012,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	2.8422円
(1万口当たり純資産額)	(28,422円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	445	49,172,500	貸付有価証券 100口
	サンケイリアルエステート投資法人	530	51,304,000	貸付有価証券 97口
	S O S i L A 物流リート投資法人	815	103,912,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,215	777,600,000	貸付有価証券 845口
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	4,692	379,582,800	
	森ヒルズリート投資法人	4,208	599,640,000	貸付有価証券 2,925口
	産業ファンド投資法人	4,710	790,338,000	貸付有価証券 1,202口
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,469	1,099,673,000	貸付有価証券 2,412口
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,386	454,533,000	貸付有価証券 608口
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,833	702,039,000	
	G L P 投資法人	9,110	1,324,594,000	貸付有価証券 6,334口
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,592	521,380,000	貸付有価証券 407口
	日本プロロジスリート投資法人	5,504	1,725,504,000	
	星野リゾート・リート投資法人	557	271,537,500	貸付有価証券 149口
	O n e リート投資法人	570	148,143,000	貸付有価証券 152口
	イオンリート投資法人	3,947	453,510,300	貸付有価証券 1,003口

ヒューリックリート投資法人	3,111	426,207,000	貸付有価証券 794口
日本リート投資法人	1,188	427,680,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート 投資法人	23,498	345,420,600	貸付有価証券 6,278口
積水ハウス・リート投資法人	10,694	763,551,600	貸付有価証券 2,857口
トーセイ・リート投資法人	796	84,535,200	貸付有価証券 180口
ケネディクス商業リート投資法人	1,413	290,654,100	貸付有価証券 358口
ヘルスケア&メディカル投資法人	780	95,238,000	貸付有価証券 208口
サムティ・レジデンシャル投資法人	732	78,543,600	貸付有価証券 196口
野村不動産マスターファンド投資法人	11,808	1,516,147,200	貸付有価証券 8,210口
いちごホテルリート投資法人	606	43,450,200	貸付有価証券 162口
ラサルロジポート投資法人	3,401	556,063,500	貸付有価証券 811口
スターアジア不動産投資法人	1,214	114,844,400	貸付有価証券 324口
マリモ地方創生リート投資法人	361	41,839,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資 法人	1,041	500,200,500	貸付有価証券 241口
大江戸温泉リート投資法人	621	43,035,300	
さくら総合リート投資法人	791	65,890,300	貸付有価証券 211口
投資法人みらい	4,159	159,705,600	貸付有価証券 1,060口
森トラスト・ホテルリート投資法人	858	85,714,200	貸付有価証券 229口
三菱地所物流リート投資法人	720	277,560,000	貸付有価証券 156口
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法 人	688	103,544,000	
ザイマックス・リート投資法人	531	50,126,400	貸付有価証券 142口
タカラレーベン不動産投資法人	1,038	91,863,000	貸付有価証券 207口
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投 資法人	761	102,126,200	貸付有価証券 151口
日本ビルファンド投資法人	3,542	2,284,590,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,658	2,015,558,000	貸付有価証券 977口
日本リテールファンド投資法人	6,913	944,315,800	貸付有価証券 4,806口
オリックス不動産投資法人	7,287	1,060,987,200	貸付有価証券 5,067口
日本プライムリアルティ投資法人	2,404	777,694,000	

プレミア投資法人	3,304	387,889,600	貸付有価証券 883口
東急リアル・エステート投資法人	2,452	365,348,000	貸付有価証券 655口
グローバル・ワン不動産投資法人	2,540	256,286,000	貸付有価証券 679口
ユナイテッド・アーバン投資法人	8,212	966,552,400	
森トラスト総合リート投資法人	2,614	349,491,800	貸付有価証券 698口
インヴィンシブル投資法人	16,043	462,680,120	
フロンティア不動産投資法人	1,299	462,444,000	
平和不動産リート投資法人	2,278	241,695,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,390	700,987,000	貸付有価証券 1,662口
福岡リート投資法人	1,892	252,203,600	貸付有価証券 505口
ケネディクス・オフィス投資法人	1,131	684,255,000	貸付有価証券 786口
いちごオフィスリート投資法人	2,832	215,232,000	貸付有価証券 757口
大和証券オフィス投資法人	844	506,400,000	
阪急阪神リート投資法人	1,652	216,246,800	
スタートプロシード投資法人	570	118,503,000	貸付有価証券 152口
大和ハウスリート投資法人	5,218	1,340,504,200	貸付有価証券 3,628口
ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,782	563,179,600	貸付有価証券 8,192口
大和証券リビング投資法人	4,477	452,177,000	貸付有価証券 1,195口
ジャパンエクセレント投資法人	3,383	452,307,100	
合計	215,110	31,793,932,420	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

MUAM G - REITマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	440,345,592
コール・ローン	94,132,851
投資証券	31,424,046,146
派生商品評価勘定	224,560
未収入金	1,296,902
未収配当金	71,744,296
流動資産合計	32,031,790,347
資産合計	32,031,790,347
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,046
未払金	327,880,564
未払解約金	19,039,672
未払利息	138
流動負債合計	346,964,420
負債合計	346,964,420
純資産の部	
元本等	
元本	21,960,861,477
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,723,964,450
元本等合計	31,684,825,927
純資産合計	31,684,825,927
負債純資産合計	32,031,790,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 6月25日現在]
1. 期首	令和 1年 6月26日
期首元本額	14,308,755,763円
期中追加設定元本額	11,022,514,359円
期中一部解約元本額	3,370,408,645円
元本の内訳	

	[令和 2年 6月25日現在]
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	170,025,923円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	122,188,417円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（分配型）	52,414,941円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（バランス型）	100,939,420円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（株式重視型）	44,702,293円
ファンド・マネジャー（海外リート）	29,600,028円
e M A X I S 先進国リートインデックス	6,493,495,035円
e M A X I S バランス（８資産均等型）	2,495,050,695円
e M A X I S バランス（波乗り型）	316,135,474円
三菱ＵＦＪ < D C > 先進国 R E I T インデックスファンド	2,648,968,830円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	444,077,783円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）	530,707,663円
e M A X I S S l i m バランス（８資産均等型）	4,528,891,512円
つみたて８資産均等バランス	1,867,039,553円
e M A X I S マイマネージャー １９７０s	1,383,736円
e M A X I S マイマネージャー １９８０s	1,726,627円
e M A X I S マイマネージャー １９９０s	425,540円
e M A X I S S l i m 先進国リートインデックス	1,426,006,402円
三菱ＵＦＪ 先進国リートインデックスファンド	10,375,229円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	8,631,344円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	53,819,914円
e M A X I S 最適化バランス（マイゴールキーパー）	40,267,658円
e M A X I S 最適化バランス（マイディフェンダー）	60,500,627円
e M A X I S 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	245,624,824円
e M A X I S 最適化バランス（マイフォワード）	178,620,107円
e M A X I S 最適化バランス（マイストライカー）	73,923,823円
世界８資産バランスファンド V L（適格機関投資家限定）	15,318,079円
合計	21,960,861,477円
２．受益権の総数	21,960,861,477口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

１ 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

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

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 2年 6月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 6月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	5,971,180,758
合計	5,971,180,758

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和 2年 6月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	101,494,415	—	101,697,500	203,085
	カナダドル	3,928,950	—	3,928,500	450
	オーストラリアドル	2,942,384	—	2,942,000	384
	イギリスポンド	9,321,130	—	9,312,100	9,030
	香港ドル	7,723,240	—	7,733,600	10,360
	シンガポールドル	4,607,355	—	4,614,000	6,645
	ニュージーランドドル	3,326,832	—	3,297,120	29,712
	合計	133,344,306	—	133,524,820	180,514

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 6月25日現在]
1口当たり純資産額	1.4428円
(1万口当たり純資産額)	(14,428円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	23,879	295,383.23	
		AGREE REALTY CORP	14,599	960,176.23	
		ALEXANDER'S INC	532	130,207.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	34,632	5,661,639.36	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,193	360,168.90	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	38,068	1,331,237.96	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	28,262	206,029.98	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	70,228	1,887,026.36	
		AMERICOLD REALTY TRUST	55,006	2,008,269.06	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	40,972	1,483,186.40	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	56,972	560,034.76	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	149,000	60,345.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,040	10,500.92	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	38,614	5,852,723.98	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	6,046	45,465.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	39,649	3,556,118.81	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,240	16,785.60	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	47,443	467,787.98	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	82,385	1,015,807.05	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	16,070	167,449.40	
		BRT APARTMENTS CORP	2,200	24,288.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	26,583	2,366,418.66	
		CARETRUST REIT INC	25,440	431,971.20	
		CEDAR REALTY TRUST INC	17,360	18,228.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	14,036	82,391.32	
		CITY OFFICE REIT INC	14,782	141,611.56	
		CLIPPER REALTY INC	2,958	21,859.62	

COLONY CAPITAL INC	136,560	340,034.40	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	31,299	409,703.91	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,917	239,460.99	
CORECIVIC INC	31,673	296,142.55	
COREPOINT LODGING INC	13,390	51,283.70	
CORESITE REALTY CORP	11,083	1,321,647.75	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	31,251	772,837.23	
COUSINS PROPERTIES INC	40,641	1,176,150.54	
CUBESMART	53,278	1,425,719.28	
CYRUSONE INC	31,755	2,399,407.80	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	55,062	296,233.56	
DIGITAL REALTY TRUST INC	73,643	10,311,492.86	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	65,784	250,637.04	
DOUGLAS EMMETT INC	45,232	1,341,128.80	
DUKE REALTY CORP	101,320	3,503,645.60	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	202,000	27,674.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	21,092	491,443.60	
EASTGROUP PROPERTIES INC	10,647	1,227,492.63	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	38,760	250,777.20	
EPR PROPERTIES	20,998	705,112.84	
EQUINIX INC	24,294	16,753,871.22	
EQUITY COMMONWEALTH	33,764	1,055,125.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	50,156	3,100,643.92	
EQUITY RESIDENTIAL	95,993	5,517,677.64	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	26,012	407,347.92	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	17,952	4,088,927.04	
EXTRA SPACE STORAGE INC	35,567	3,218,102.16	
FARMLAND PARTNERS INC	8,298	56,011.50	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,231	1,585,980.57	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	35,022	1,285,657.62	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	19,540	454,891.20	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	28,441	128,553.32	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	12,907	107,386.24	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	56,399	2,022,468.14	
GEO GROUP INC/THE	33,888	389,373.12	
GETTY REALTY CORP	9,940	289,751.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	9,039	162,250.05	
GLADSTONE LAND CORP	5,839	88,285.68	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	10,234	113,290.38	
GLOBAL NET LEASE INC	24,845	384,600.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	37,090	1,093,784.10	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	60,277	1,592,518.34	

HEALTHPEAK PROPERTIES INC	147,938	3,844,908.62
HERSHA HOSPITALITY TRUST	12,629	71,101.27
HIGHWOODS PROPERTIES INC	28,848	1,059,010.08
HOST HOTELS & RESORTS INC	193,281	2,122,225.38
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	41,922	1,000,678.14
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25,557	279,593.58
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	17,641	344,881.55
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,040	463,478.40
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,318	224,595.42
INVITATION HOMES INC	149,129	4,066,747.83
IRON MOUNTAIN INC	78,731	1,970,636.93
JBG SMITH PROPERTIES	31,921	924,112.95
KILROY REALTY CORP	29,143	1,716,231.27
KIMCO REALTY CORP	118,080	1,512,604.80
KITE REALTY GROUP TRUST	22,449	244,918.59
LEXINGTON REALTY TRUST	74,832	779,001.12
LIFE STORAGE INC	12,849	1,193,286.63
LTC PROPERTIES INC	11,179	396,183.76
MACERICH CO/THE	33,681	286,962.12
MACK-CALI REALTY CORP	24,997	377,454.70
MANULIFE US REAL ESTATE INV	389,520	299,930.40
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	144,766	2,584,073.10
MID-AMERICA APARTMENT COMM	31,421	3,472,648.92
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	27,266	373,544.20
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	47,031	1,683,709.80
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	16,822	463,277.88
NATL HEALTH INVESTORS INC	12,330	708,358.50
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	25,020	77,311.80
NEXPOINT RESIDENTIAL	5,729	191,463.18
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	13,291	340,249.60
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	62,401	1,772,188.40
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,887	80,146.80
PARAMOUNT GROUP INC	50,837	391,444.90
PARK HOTELS & RESORTS INC	64,914	649,789.14
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	35,493	472,056.90
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12,160	16,659.20
PHYSICIANS REALTY TRUST	54,944	935,696.32
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	34,028	535,600.72
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,073	56,085.21
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12,356	89,210.32
PRIME US REIT	137,700	113,602.50
PROLOGIS INC	202,705	18,202,909.00
PS BUSINESS PARKS INC/CA	5,422	688,702.44

PUBLIC STORAGE	41,262	7,817,085.90	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	16,557	1,058,323.44	
REALTY INCOME CORP	94,126	5,596,731.96	
REGENCY CENTERS CORP	46,468	2,061,320.48	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	32,747	353,176.39	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	57,487	368,491.67	
RETAIL VALUE INC	5,644	68,800.36	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	33,954	1,348,652.88	
RLJ LODGING TRUST	44,559	407,714.85	
RPT REALTY	21,949	143,326.97	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	14,662	503,639.70	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	57,302	763,835.66	
SAFEHOLD INC	3,664	221,268.96	
SAUL CENTERS INC	3,270	100,258.20	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	9,710	104,770.90	
SERVICE PROPERTIES TRUST	46,848	344,801.28	
SIMON PROPERTY GROUP INC	83,885	5,461,752.35	
SITE CENTERS CORP	39,216	285,884.64	
SL GREEN REALTY CORP	20,739	1,033,216.98	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	28,202	996,376.66	
STAG INDUSTRIAL INC	41,114	1,162,292.78	
STORE CAPITAL CORP	61,474	1,461,851.72	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	29,775	164,060.25	
SUN COMMUNITIES INC	26,999	3,719,652.23	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	57,829	475,932.67	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	23,781	159,332.70	
TAUBMAN CENTERS INC	17,234	657,477.10	
TERRENO REALTY CORP	18,449	966,912.09	
UDR INC	81,078	2,950,428.42	
UMH PROPERTIES INC	10,151	123,436.16	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,370	258,580.10	
URBAN EDGE PROPERTIES	29,217	318,465.30	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	7,527	86,033.61	
VENTAS INC	102,576	3,527,588.64	
VEREIT INC	296,471	1,932,990.92	
VICI PROPERTIES INC	128,809	2,715,293.72	
VORNADO REALTY TRUST	43,583	1,646,565.74	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	39,549	34,407.63	
WASHINGTON REIT	22,897	489,308.89	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	33,595	618,148.00	
WELLTOWER INC	114,566	5,657,269.08	
WHITESTONE REIT	10,161	68,281.92	

		WP CAREY INC	47,438	3,181,192.28	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	30,310	278,548.90	
アメリカドル合計			6,994,787	218,668,388.75 (23,410,637,699)	
カナダドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	16,200	672,786.00	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	18,990	144,324.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,110	174,623.80	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,180	1,118,666.80	
		CHOICE PROPERTIES REIT	42,687	539,136.81	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	25,170	202,618.50	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	13,230	169,211.70	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	13,500	184,815.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,600	205,800.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,710	154,277.10	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	28,400	396,464.00	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	7,800	523,848.00	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	38,309	375,045.11	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18,000	257,040.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	14,300	245,960.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,000	101,650.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,400	65,208.00	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	8,650	299,290.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	22,200	235,986.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	42,270	648,421.80	
		SLATE OFFICE REIT	13,500	50,895.00	
		SLATE RETAIL REIT - U	5,100	51,051.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19,100	403,583.00	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	18,500	205,720.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	9,600	54,240.00	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	10,200	178,908.00	
カナダドル合計			451,706	7,659,569.62 (601,888,980)	
オーストラリアドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	102,505	292,139.25	
		APN INDUSTRIA REIT	37,415	97,653.15	
		ARENA REIT	87,610	207,635.70	
		BWP TRUST	135,120	529,670.40	
		CENTURIA OFFICE REIT	109,657	230,279.70	
		CHARTER HALL GROUP	125,335	1,263,376.80	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	118,459	552,018.94	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	133,924	478,108.68	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	89,786	227,158.58	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	519,762	488,576.28	
		DEXUS	300,868	3,038,766.80	

		GDI PROPERTY GROUP	135,692	158,759.64	
		GOODMAN GROUP	446,532	6,814,078.32	
		GPT GROUP	535,530	2,420,595.60	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	76,375	262,730.00	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	35,243	105,376.57	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	77,813	361,052.32	
		MIRVAC GROUP	1,079,566	2,580,162.74	
		NATIONAL STORAGE REIT	256,650	497,901.00	
		RURAL FUNDS GROUP	87,545	178,591.80	
		SCENTRE GROUP	1,424,353	3,219,037.78	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	291,081	672,397.11	
		STOCKLAND	657,617	2,380,573.54	
		VICINITY CENTRES	1,054,848	1,550,626.56	
		WAYPOINT REIT	189,524	521,191.00	
オーストラリアドル合計			8,108,810	29,128,458.26 (2,142,689,389)	
イギリス ポンド	投資証券	AEW UK REIT PLC	55,249	39,779.28	
		ASSURA PLC	716,691	561,169.05	
		BIG YELLOW GROUP PLC	43,908	425,248.98	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	221,354	158,489.46	
		BRITISH LAND CO PLC	257,255	988,630.96	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	235,230	361,313.28	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	7,568	7,413.61	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	175,540	188,529.96	
		DERWENT LONDON PLC	29,196	833,253.84	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	169,729	92,672.03	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	70,663	447,296.79	
		HAMMERSON PLC	213,418	204,027.60	
		INTU PROPERTIES PLC	370,136	14,331.66	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	206,642	1,169,593.72	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	243,316	515,829.92	
		LXI REIT PLC	133,354	152,823.68	
		NEWRIVER REIT PLC	86,314	56,621.98	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	154,320	106,480.80	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	336,105	508,862.97	
		RDI REIT PLC	61,359	45,467.01	
		REGIONAL REIT LTD	124,189	89,664.45	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	57,038	411,814.36	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	142,520	46,675.30	
		SEGRO PLC	304,626	2,686,801.32	
		SHAFTESBURY PLC	61,112	327,865.88	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	94,184	94,184.00	

		TRITAX BIG BOX REIT PLC	468,018	669,265.74	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	250,607	163,896.97	
		UNITE GROUP PLC/THE	99,222	890,517.45	
		WORKSPACE GROUP PLC	34,541	228,834.12	
イギリス債券合計			5,423,404	12,487,356.17 (1,661,317,864)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	536,000	2,111,840.00	
		FORTUNE REIT	382,000	2,643,440.00	
		LINK REIT	566,100	36,202,095.00	
		PROSPERITY REIT	332,000	756,960.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	262,000	1,013,940.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	420,000	1,520,400.00	
香港ドル合計			2,498,100	44,248,675.00 (611,074,201)	
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	137,000	169,880.00	
		ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	298,300	168,539.50	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	816,100	2,611,520.00	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	503,174	523,300.96	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	787,700	1,394,229.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	777,200	1,569,944.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	219,900	281,472.00	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	208,800	223,416.00	
		ESR-REIT	563,100	222,424.50	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	267,300	136,323.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	166,900	118,499.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	194,900	469,709.00	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	217,500	104,400.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	657,366	769,118.22	
		KEPPEL DC REIT	341,100	866,394.00	
		KEPPEL REIT	518,500	575,535.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	191,000	131,790.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	444,600	62,688.60	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	600,100	1,188,198.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	410,000	1,217,700.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	818,500	1,596,075.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	572,000	526,240.00	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	681,832	276,141.96	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	108,900	372,438.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	251,200	89,176.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	130,000	96,850.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	262,200	104,880.00	
		SPH REIT	247,600	219,126.00	

		STARHILL GLOBAL REIT	390,000	208,650.00	
		SUNTEC REIT	653,100	960,057.00	
シンガポールドル合計			12,435,872	17,254,714.74 (1,327,060,110)	
ニュージーランドドル	投資証券	ARGOSY PROPERTY LTD	246,011	293,983.14	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	305,048	651,277.48	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	442,401	477,793.08	
		PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	283,051	469,864.66	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	96,128	246,087.68	
ニュージーランドドル合計			1,372,639	2,139,006.04 (146,949,714)	
韓国ウォン	投資証券	LOTTE REIT CO LTD	23,500	132,305,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,775	58,266,000.00	
韓国ウォン合計			32,275	190,571,000.00 (16,960,819)	
イスラエルシェケル	投資証券	REIT 1 LTD	40,351	494,299.75	
イスラエルシェケル合計			40,351	494,299.75 (15,367,779)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	7,440	740,280.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	43,324	576,209.20	
		ALTAREA	1,040	141,232.00	
		BEFIMMO	6,052	235,422.80	
		COFINIMMO	6,780	831,228.00	
		COVIVIO	13,011	841,161.15	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	10,710	128,520.00	
		GECINA SA	15,052	1,664,751.20	
		HAMBORNER REIT AG	17,956	154,529.33	
		HIBERNIA REIT PLC	198,048	214,684.03	
		ICADE	7,719	480,893.70	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,911	46,740.96	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	67,247	531,587.53	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5,979	135,723.30	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	117,806	161,394.22	
		KLEPIERRE	57,111	983,451.42	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,746	90,831.60	
		MERCIALYS	8,281	61,320.80	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	99,419	751,110.54	
		MONTEA	3,074	272,971.20	
		NSI NV	4,658	162,098.40	
		RETAIL ESTATES	2,885	168,195.50	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	37,688	1,922,088.00	

	VASTNED RETAIL NV	5,244	97,538.40	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	35,346	878,348.10	
	WERELDHAVE NV	11,261	91,608.23	
ユーロ合計		816,788	12,363,919.61 (1,490,099,591)	
合計			31,424,046,146 (31,424,046,146)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 156銘柄	100.00%	74.50%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.00%	1.92%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.00%	6.82%
イギリスポンド	投資証券 30銘柄	100.00%	5.29%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.00%	1.94%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.00%	4.22%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.00%	0.47%
韓国ウォン	投資証券 2銘柄	100.00%	0.05%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.00%	0.05%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.00%	4.74%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

２【ファンドの現況】

【つみたて８資産均等バランス】

【純資産額計算書】

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	22,453,278,061
負債総額	6,278,432
純資産総額（ - ）	22,446,999,629
発行済口数	21,358,413,608口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0510
（10,000口当たり）	（10,510）

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	394,286,581,409
負債総額	104,045,795,941
純資産総額（ - ）	290,240,785,468
発行済口数	166,776,892,948口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.7403
（10,000口当たり）	（17,403）

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	476,214,098,585
負債総額	3,718,388,351
純資産総額（ - ）	472,495,710,234
発行済口数	165,513,521,550口

1口当たり純資産価額（ / ）	2.8547
（ 10,000口当たり ）	（ 28,547 ）

新興国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	123,905,628,121
負債総額	393,692,482
純資産総額（ - ）	123,511,935,639
発行済口数	52,964,490,441口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.3320
（ 10,000口当たり ）	（ 23,320 ）

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	598,716,434,344
負債総額	4,269,697,790
純資産総額（ - ）	594,446,736,554
発行済口数	442,067,678,533口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3447
（ 10,000口当たり ）	（ 13,447 ）

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	160,293,279,316
負債総額	591,615,963
純資産総額（ - ）	159,701,663,353
発行済口数	72,478,769,634口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.2034

（ 10,000口当たり ）	（ 22,034 ）
----------------	------------

新興国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	31,689,713,570
負債総額	86,785,270
純資産総額（ - ）	31,602,928,300
発行済口数	23,769,322,379口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3296
（ 10,000口当たり ）	（ 13,296 ）

東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	43,643,760,914
負債総額	11,321,457,078
純資産総額（ - ）	32,322,303,836
発行済口数	11,439,226,033口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.8256
（ 10,000口当たり ）	（ 28,256 ）

MUAM G - REITマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	32,685,432,019
負債総額	306,060,451
純資産総額（ - ）	32,379,371,568
発行済口数	22,193,598,517口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.4590
（ 10,000口当たり ）	（ 14,590 ）

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められ、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、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2020年6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 6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	872	13,948,829
追加型公社債投資信託	16	1,318,010
単位型株式投資信託	64	334,950
単位型公社債投資信託	20	101,305
合 計	972	15,703,095

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

3【委託会社等の経理状況】

（１）財務諸表の作成方法について

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

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

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（自 平成31年4月1日 至 令和2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。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)		第35期 (令和2年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	53,969,686	2	56,398,457
有価証券		1,403,513		1,960,318
前払費用		514,587		575,904
未収入金		2,284		14,559
未収委託者報酬		9,995,458		10,296,453
未収収益	2	560,483	2	638,994
金銭の信託	2	100,000	2	100,000

その他		153,256		254,330
流動資産合計		66,699,271		70,239,017
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	617,032	1	584,048
器具備品	1	665,247	1	871,893
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		1,910,713		2,084,375
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,670,753		3,369,611
ソフトウェア仮勘定		536,345		1,374,932
無形固定資産合計		4,222,921		4,760,365
投資その他の資産				
投資有価証券		21,408,781		16,704,756
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	824,268	1	819,255
長期差入保証金		593,536		565,358
前払年金費用		415,234		375,031
繰延税金資産		1,496,180		1,912,824
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		25,079,767		20,718,993
固定資産合計		31,213,401		27,563,734
資産合計		97,912,673		97,802,752

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	293,258	687,565
未払金		
未払収益分配金	170,281	131,478
未払償還金	448,695	395,400
未払手数料	2 3,990,054	2 4,026,078
その他未払金	2 3,961,765	2 3,818,195
未払費用	2 3,803,995	2 4,402,578
未払消費税等	194,852	629,469
未払法人税等	573,657	617,341
賞与引当金	901,135	933,517
役員賞与引当金	140,100	124,590
その他	868,992	701,285
流動負債合計	15,346,788	16,467,499
固定負債		
長期未払金	43,200	32,400
退職給付引当金	860,851	1,010,401
役員退職慰労引当金	144,303	130,784

時効後支払損引当金	247,767	238,811
固定負債合計	1,296,122	1,412,398
負債合計	16,642,910	17,879,897
(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	26,069,594	25,847,605
利益剰余金合計	33,410,184	33,188,194
株主資本合計	80,143,028	79,921,039

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2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	1,126,733	1,815
評価・換算差額等合計	1,126,733	1,815
純資産合計	81,269,762	79,922,854
負債純資産合計	97,912,673	97,802,752

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,375,414	67,967,489
投資顧問料	2,505,299	2,385,084
その他営業収益	18,844	16,085
営業収益合計	72,899,557	70,368,658
営業費用		
支払手数料	2 28,533,952	2 27,106,451
広告宣伝費	739,643	696,418
公告費	500	1,000
調査費		
調査費	1,794,755	1,857,271
委託調査費	12,194,996	11,579,175
事務委託費	1,016,816	847,769
営業雑経費		

通信費	170,794	153,731
印刷費	427,442	427,118
協会費	48,375	52,053
諸会費	16,175	15,990
事務機器関連費	1,841,631	1,953,926
営業費用合計	46,785,083	44,690,907
一般管理費		
給料		
役員報酬	349,083	331,987
給料・手当	6,453,717	6,611,427
賞与引当金繰入	901,135	933,517
役員賞与引当金繰入	140,100	124,590
福利厚生費	1,234,293	1,276,950
交際費	13,011	11,871
旅費交通費	200,426	165,891
租税公課	373,201	360,165
不動産賃借料	654,886	647,402
退職給付費用	428,912	422,919
役員退職慰労引当金繰入	51,159	48,183
固定資産減価償却費	1,252,321	1,307,555
諸経費	523,213	427,212
一般管理費合計	12,575,461	12,669,674
営業利益	13,539,012	13,008,076

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	181,073	90,965
受取利息	2 1,913	2 4,169
投資有価証券償還益	416,706	585,179
収益分配金等時効完成分	44,392	101,734
受取賃貸料	2 38,388	2 65,808
その他	11,871	19,987
営業外収益合計	694,346	867,845
営業外費用		
投資有価証券償還損	118,173	96,379
時効後支払損引当金繰入	1,166	-
事務過誤費	420	3,483
賃貸関連費用	35,994	20,339
その他	1,481	1,920
営業外費用合計	157,235	122,122
経常利益	14,076,123	13,753,799
特別利益		
投資有価証券売却益	501,778	174,842
特別利益合計	501,778	174,842
特別損失		
投資有価証券売却損	135,399	75,963
投資有価証券評価損	62,310	163,865
固定資産除却損	1 4,848	1 8,832

固定資産売却損		225		435
システム関連費		322,986		-
商標使用料		90,000		-
特別損失合計		615,770		249,096
税引前当期純利益		13,962,130		13,679,545
法人税、住民税及び事業税	2	4,420,179	2	4,146,534
法人税等調整額		100,112		79,824
法人税等合計		4,320,066		4,226,359
当期純利益		9,642,064		9,453,186

（３）【株主資本等変動計算書】

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				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	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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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				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
当期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	221,989	221,989	221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,124,917	1,124,917	1,124,917
当期変動額合計	1,124,917	1,124,917	1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

[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。

(3) 「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

（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 令和2年3月31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 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31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）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定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、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定め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

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で未定であります。

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
建物	551,025千円	599,542千円
器具備品	1,350,407千円	1,408,613千円
投資不動産	138,024千円	145,391千円

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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
預金	240,211千円	314,247千円
未収収益	25,307千円	15,773千円
金銭の信託	100,000千円	100,000千円
未払手数料	671,568千円	712,210千円
その他未払金	3,217,341千円	3,029,426千円
未払費用	444,754千円	432,019千円

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
建物	2,547千円	—
器具備品	2,301千円	8,832千円
計	4,848千円	8,832千円

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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
支払手数料	5,298,064千円	5,234,629千円
受取利息	3千円	2千円
受取賃貸料	38,388千円	65,808千円

法人税、住民税及び事業税

3,216,517千円

3,030,180千円

（株主資本等変動計算書関係）

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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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

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
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

(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2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	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2年6月29日

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
1年内	675,956千円	675,956千円
1年超	675,956千円	—
合計	1,351,912千円	675,956千円

(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	-

第35期(令和2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	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(4) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,328,625	85,328,625	-
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
非上場株式	55,360	31,360
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

第35期(令和2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	56,398,457	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
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	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,655,228	5,652,257	4,813,929	27,375

（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	株式	-	-	-

上額が取得原価を超えないもの	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

第35期(令和2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	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
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	8,774,369	9,937,087	1,162,718
	小計	8,774,369	9,937,087	1,162,718
合計		18,633,714	18,631,098	2,616

3.売却したその他有価証券

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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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	8,940	-	15,060
債券	-	-	-
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

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。

当事業年度において、有価証券について163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,729,252 千円	3,712,289 千円

勤務費用	193,531	204,225
利息費用	24,351	17,557
数理計算上の差異の発生額	15,898	52,430
退職給付の支払額	218,947	162,904
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,712,289	3,718,736

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
年金資産の期首残高	2,723,393 千円	2,666,937 千円
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の発生額	4,606	164,633
事業主からの拠出額	102,564	51,282
退職給付の支払額	203,077	140,518
年金資産の期末残高	2,666,937	2,460,824

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,125,760 千円	2,969,807 千円
年金資産	2,666,937	2,460,824
	458,822	508,982
非積立型制度の退職給付債務	586,529	748,929
未積立退職給付債務	1,045,351	1,257,911
未認識数理計算上の差異	114,968	203,136
未認識過去勤務費用	484,766	419,405
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370
退職給付引当金	860,851	1,010,401
前払年金費用	415,234	375,031
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
勤務費用	193,531 千円	204,225 千円
利息費用	24,351	17,557
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の費用処理額	43,633	24,035
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	5,986	6,427
確定給付制度に係る退職給付費用	284,199	269,848

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
債券	63.9 %	64.7 %
株式	33.2	32.3
その他	2.9	3.0
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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
割引率	0.035～0.49%	0.095～0.52%
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144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	436,050千円	427,046千円
投資有価証券評価損	223,821	226,322
未払事業税	109,109	117,461
賞与引当金	275,927	285,842
役員賞与引当金	19,428	19,703
役員退職慰労引当金	44,185	40,046
退職給付引当金	263,592	309,384
減価償却超過額	157,741	96,767
委託者報酬	264,398	213,044
長期差入保証金	31,721	40,180
時効後支払損引当金	75,866	73,124
連結納税適用による時価評価	148,858	57,656
その他	71,320	123,248
繰延税金資産 小計	2,122,023	2,029,829
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,122,023	2,029,829
繰延税金負債		
前払年金費用	127,144	114,834
連結納税適用による時価評価	1,320	1,260
その他有価証券評価差額金	497,269	801
その他	108	109
繰延税金負債 合計	625,842	117,005
繰延税金資産の純額	1,496,180	1,912,824

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34期（平成31年3月31日現在）及び第35期（令和2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34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）及び第35期（自平成31年4月1日至令和2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34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）及び第35期（自平成31年4月1日至令和2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	㈱三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有間接100.0%	連結納税	連結納税に伴う支払（注1）	3,216,517千円	その他未払金	3,217,341千円
親会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有直接100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	5,298,064千円	未払手数料	671,568千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料（注3）	695,834千円	未払費用	365,510千円

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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)	3,030,180 千円	その他未払金	3,029,426 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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) 投資助言料 (注3)	5,234,629 千円 583,270 千円	未払手数料 未払費用	712,210 千円 302,681 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。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

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 取引銀行	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) コーラブル預 金の預入 (注3) コーラブル預 金に係る受取 利息 (注3)	4,629,670 千円 20,000,000 千円 1,578 千円	未払手数料 現金及び 預金 未収収益	734,633 千円 20,000,000 千円 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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
----	--------	-----	-----	-------	------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	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）	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
						取引銀行	コーラブル預金の払戻（注3）	20,000,000 千円		
							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）	4,126 千円	未収収益	997 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注）1．㈱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

㈱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、

㈱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、㈱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㈱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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
1株当たり純資産額	384,107.08円	377,741.17円
1株当たり当期純利益金額	45,571.50円	44,678.80円

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

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
当期純利益金額（千円）	9,642,064	9,453,186

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）	9,642,064	9,453,186
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

4【利害関係人との取引制限】

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

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（2020年3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 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社秋田銀行	14,100 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社山形銀行	12,008 百万円	銀行業務を営んでいます。

株式会社七十七銀行	24,658	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社群馬銀行	48,652	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社千葉銀行	145,069	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社横浜銀行	215,628	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社山梨中央銀行	15,400	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社八十二銀行	52,243	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社十六銀行	36,839	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社京都銀行	42,103	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社広島銀行	54,573	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社阿波銀行	23,452	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社百十四銀行	37,322	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社伊予銀行	20,948	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社四国銀行	25,000	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社佐賀銀行	16,062	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社十八銀行	24,404	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社親和銀行	36,878	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社大分銀行	19,598	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社宮崎銀行	14,697	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社琉球銀行	56,967	百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279	百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社あおぞら銀行	100,000	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社東日本銀行	38,300	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社大光銀行	10,000	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社福岡中央銀行	2,500	百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社熊本銀行	33,847	百万円	銀行業務を営んでいます。
京都信用金庫	12,175	百万円	金融業務を営んでいます。
労働金庫連合会	120,000	百万円	金融業務を営んでいます。
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000	百万円	銀行業務を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
いちよし証券株式会社	14,577	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
とちぎんＴＴ証券株式会社	301	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エース証券株式会社	8,831	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
静銀ティーエム証券株式会社	3,000	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
むさし証券株式会社	5,000	百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
浜銀ＴＴ証券株式会社	3,307 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
F F G 証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
丸八証券株式会社	3,751 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

京都信用金庫および労働金庫連合会の資本金の額は「出資金」を記載しております。

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6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 9月24日	有価証券届出書
2019年 9月24日	有価証券報告書
2020年 3月24日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年 3月24日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

令和2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
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 青木 裕晃 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

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和2年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

（注）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７月29日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたて８資産均等バランスの令和１年６月26日から令和２年６月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、つみたて８資産均等バランスの令和２年６月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

（注）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。