

**【表紙】**

|                                          |                                                                                                                   |
|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 【提出書類】                                   | 有価証券届出書                                                                                                           |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿                                                                                                           |
| 【提出日】                                    | 2021年6月24日提出                                                                                                      |
| 【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 横川 直                                                                                                        |
| 【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                                                                                                              |
| 【電話番号】                                   | 03-6250-4740                                                                                                      |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | 三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）<br>三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）<br>三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）<br>三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | １兆円を上限とします。<br>三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）<br>１兆円を上限とします。<br>三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）<br>１兆円を上限とします。              |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。                                                                                                       |

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）  
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）  
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）  
（以上を総称して、あるいは個別に「ファンド」といいます。）  
愛称として「ファーストラップ（ささえ）」を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。  
信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。  
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。  
基準価額は、販売会社にてご確認ください。  
なお、下記においてもご照会いただけます。  
三菱UFJ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/>  
（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。  
なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

### （５）【申込手数料】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率  
申込手数料は販売会社にご確認ください。  
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、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位  
申込単位は販売会社にご確認ください。

### （７）【申込期間】

2021年 6月25日から2022年 6月24日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認ください。

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）

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

## １【ファンドの性格】

## （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、各ファンドについて、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<br>(収益の源泉) | 独立区分  | 補足分類       |
|---------|--------|-------------------|-------|------------|
| 単位型     | 国内     | 株式                | MMF   | インデックス型    |
|         | 海外     | 債券                | MR F  |            |
| 追加型     |        | 不動産投信             |       | 特殊型<br>( ) |
|         | 内外     | その他資産<br>( )      | E T F |            |
|         |        | 資産複合              |       |            |

## 属性区分表

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

※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、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

#### 商品分類の定義

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

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

#### 属性区分の定義

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

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

|                 |                   |                                                                                                                          |
|-----------------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | エマージング            | 信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                     |
| 投資形態            | ファミリーファンド         | 信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。                                                         |
|                 | ファンド・オブ・ファンズ      | 一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。                                                               |
| 為替ヘッジ           | あり                | 信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。                                                                       |
|                 | なし                | 信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。                                                                 |
| 対 象 イ ン<br>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]

各ファンドは、世界の株式や債券を主な投資対象とし、投資環境等の変化に合わせて組入比率を変更する投資信託です。

## ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

## ファンドの特色

三菱UFJ バランス・イノベーション  
(株式抑制型)

三菱UFJ バランス・イノベーション  
(株式重視型)

三菱UFJ バランス・イノベーション  
(新興国投資型)

### 投資対象

「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)」、「三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)」は、マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。

「三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)」は、上記に加え、マザーファンドへの投資を通じて、新興国の株式、債券にも実質的な投資を行います。

◆以下、各ファンドを「株式抑制型」、「株式重視型」、「新興国投資型」という場合があります。

### <各ファンドの特徴>

| 各ファンド    | 特徴                                                                                                                                                                                                   |
|----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 「株式抑制型」  | <ul style="list-style-type: none"> <li>国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドです。</li> <li>国内株式、先進国株式の組入比率を抑えて、比較的安定的な基準価額の上昇をめざすファンドです。</li> </ul>                                                           |
| 「株式重視型」  | <ul style="list-style-type: none"> <li>国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドで、「株式抑制型」と比較して国内株式、先進国株式の組入比率を高めることが可能です。</li> <li>「株式抑制型」と比較して、株式相場上昇局面における株式の値上がり益の獲得をめざすファンドで、値動きはより大きくなる傾向があります。</li> </ul> |
| 「新興国投資型」 | <ul style="list-style-type: none"> <li>国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に加え、新興国の株式・債券にも投資するファンドです。</li> <li>より一層の値上がり益の獲得をめざすファンドで、3つのファンドの中では最も値動きが大きくなる傾向があります。</li> </ul>                                     |

1 運用期間、市況動向によっては、上記の傾向とならない場合があります。



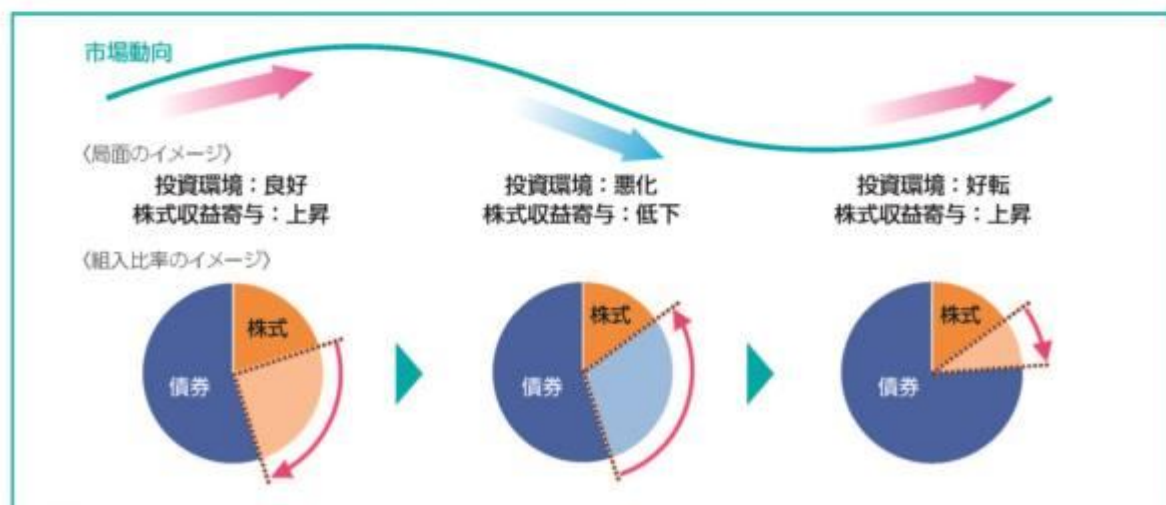
## &lt;各ファンドが投資対象とするマザーファンドと運用目標&gt;

| 各ファンド                     | 各マザーファンド               | 主要投資対象             | 運用目標                                                                  |
|---------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------------------------------------------------------|
| 「株式抑制型」<br>および<br>「株式重視型」 | TOPIXマザーファンド           | 国内株式               | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。                             |
|                           | 外国株式インデックスマザーファンド      | 先進国株式<br>(国内株式を除く) | 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。                    |
|                           | 国内債券インデックスマザーファンド      | 国内債券               | NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。                                    |
|                           | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド  | 先進国債券<br>(国内債券を除く) | FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。                  |
|                           | マネー・マーケット・マザーファンド      | 国内の<br>短期公社債等      | 安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。                                              |
| 「新興国投資型」                  | 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。            |
|                           | ヘッジ付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・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ・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。 |

・「新興国投資型」のみ新興国株式および新興国債券への実質的な投資を行います。

## ■運用方法・運用プロセス

## &lt;(ご参考)「株式抑制型」の組入比率変更のイメージ&gt;



！ 上図はファンドの組入比率の変更をご理解いただくために、「株式抑制型」における組入比率の変更をイメージとして示したものであり、上記と同じ条件での「株式重視型」、「新興国投資型」の組入比率とは異なります。また、各投資環境における組入比率については実際の比率と異なり、投資環境等によっては、株式の組入れを行わない場合があります。

- 各資産の組入比率は以下の範囲で決定します。

#### <各資産の組入比率>

|       | 「株式抑制型」                         | 「株式重視型」                             | 「新興国投資型」   |
|-------|---------------------------------|-------------------------------------|------------|
| 国内株式  | 0.0%～22.0%                      | 0.0%～42.5%                          | 0.0%～33.0% |
| 先進国株式 | 0.0%～22.0%                      | 0.0%～42.5%                          | 0.0%～33.0% |
| 新興国株式 | 投資を行いません                        | 投資を行いません                            | 0.0%～32.0% |
| 国内債券  | 0.0%～51.0%                      | 0.0%～51.0%                          | 0.0%～32.7% |
| 先進国債券 | 0.0%～25.0%<br>(原則、25.0%固定とします。) | 0.0%～25.0%<br>(原則、13.0%～25.0%とします。) | 0.0%～32.7% |
| 新興国債券 | 投資を行いません                        | 投資を行いません                            | 0.0%～32.7% |

1 上記以外に短期金融資産を組み入れます。

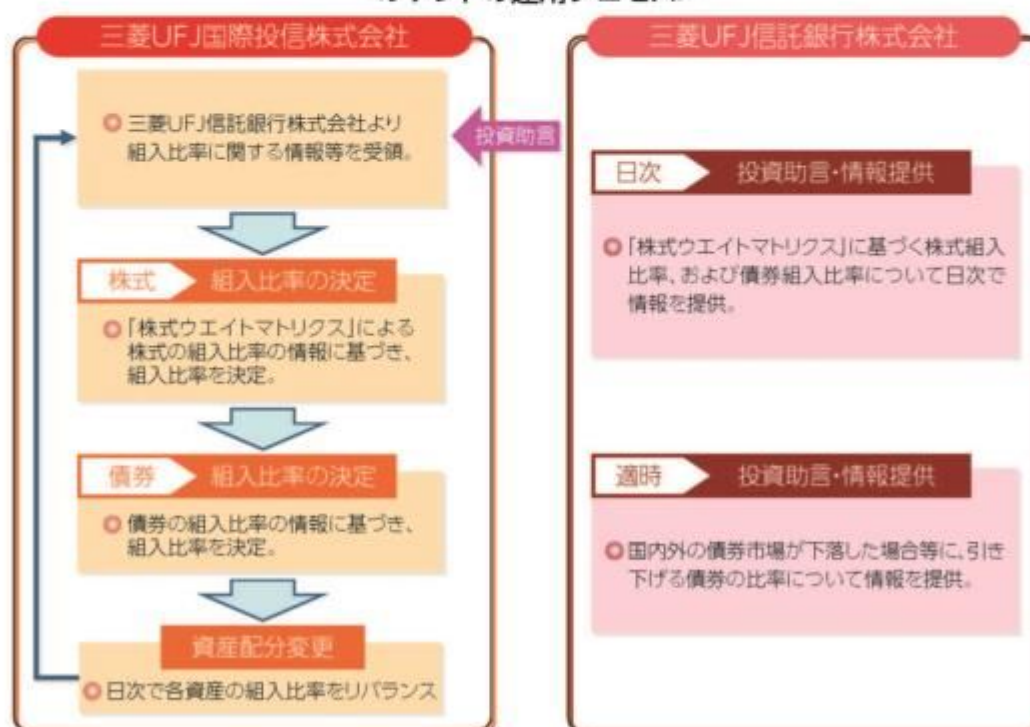
1 上記組入比率は、今後、変更となる場合があります。

- 三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、三菱UFJ国際投信株式会社が各ファンドの運用を行います。

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

- ファンドの運用プロセスは以下のとおりです。

#### <ファンドの運用プロセス>



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

・ファンドは、年金運用に実績のある三菱UFJ信託銀行株式会社による助言をもとに運営します。なお、ファンドのベースとなっている「下方リスク抑制/バランス」は、内外株式下落による損失回避と中期的な収益確保をめざし、機動的に投資比率をコントロールする運用商品であり、三菱UFJ信託銀行株式会社が三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)のサポートを受け、独自に開発したモデルに基づく運用手法で年金顧客向けに提供されております。

- 株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウェイトマトリクス」を活用します。
- ◆ 「投資環境」は、株式市場や景気の方角性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。なお、「新興国投資型」は上記各指標に加え、新興国通貨の下落率を活用した指標も用います。
- ◆ 「株式部分の収益寄与」は、過去の株式の収益率に組入比率を勘案して算出します。
- ❗ 「株式ウェイトマトリクス」は、各ファンドごとおよび各資産（国内株式、先進国株式、新興国株式）ごとに異なります。また、「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。

＜株式ウェイトマトリクスのイメージ＞



❗ 上記の株式ウェイトマトリクスはイメージであり、実際の運用に用いるものとは異なる場合があります。

- 「株式抑制型」は、株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、残りは国内債券等に投資します。
- 「株式重視型」は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りは国内債券等に投資します。
- 「新興国投資型」は、株式部分以外への投資については、国内債券、先進国債券、新興国債券の組入比率が均等になるよう投資を行います。
- なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。



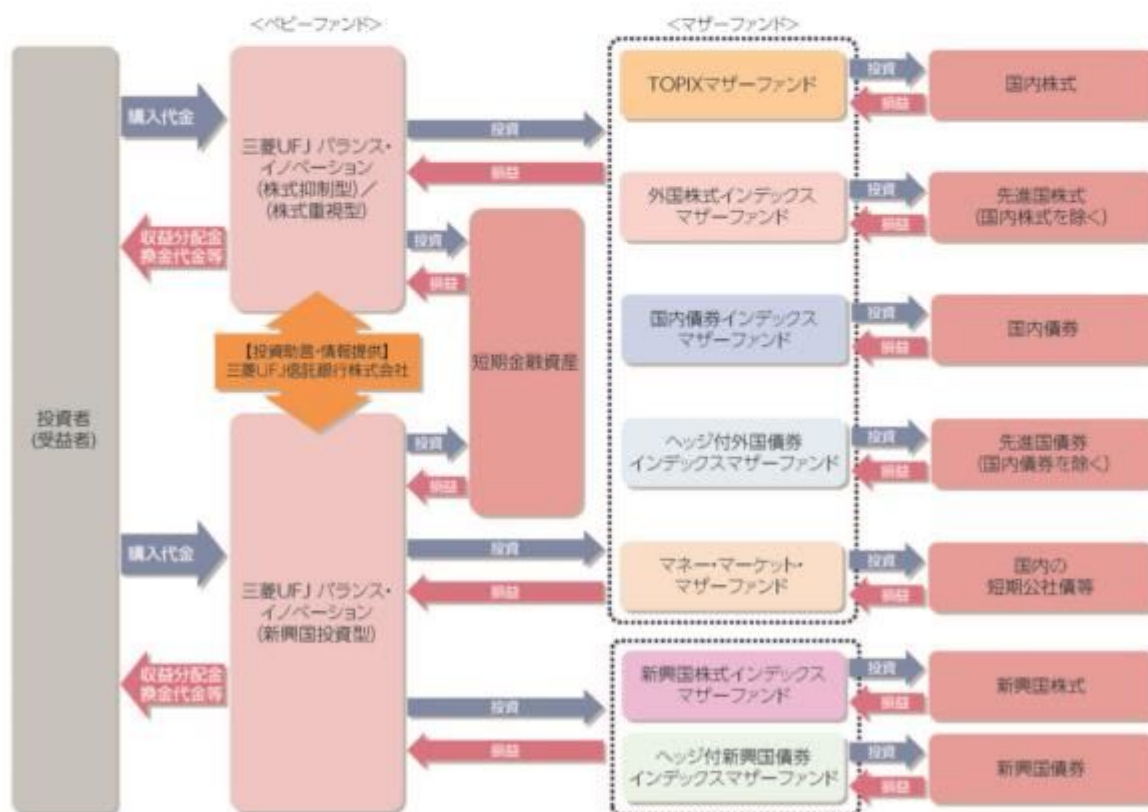
為替対応  
方針

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な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。

- 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
  - その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないため、各ファンドは為替相場の変動による影響を受けます。
- ❗ 為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

## ■ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンド等への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および国内の短期金融資産へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



- ❗ スイッチングの取扱いについては、スイッチングの取扱いを行わない販売会社もあるため、詳しくは、販売会社にご確認下さい。
- ❗ スイッチングの際の購入時手数料は、販売会社が定めるものとします。また、換金するファンドに対して税金がかかります。

## 分配方針

年1回の決算時(3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。

## ■主な投資制限

|        |                         |
|--------|-------------------------|
| 株式     | 株式への実質投資割合に制限を設けません。    |
| 外貨建資産  | 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 |
| デリバティブ | デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 |



## 指数について

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。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。

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。

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、円ヘッジ・円ベース)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。

・JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(米ドルベース)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流動性の高い米ドル建ての新興国国債のパフォーマンスを表す代表的な指数です。JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ・円換算ベース)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・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスの著作権は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。

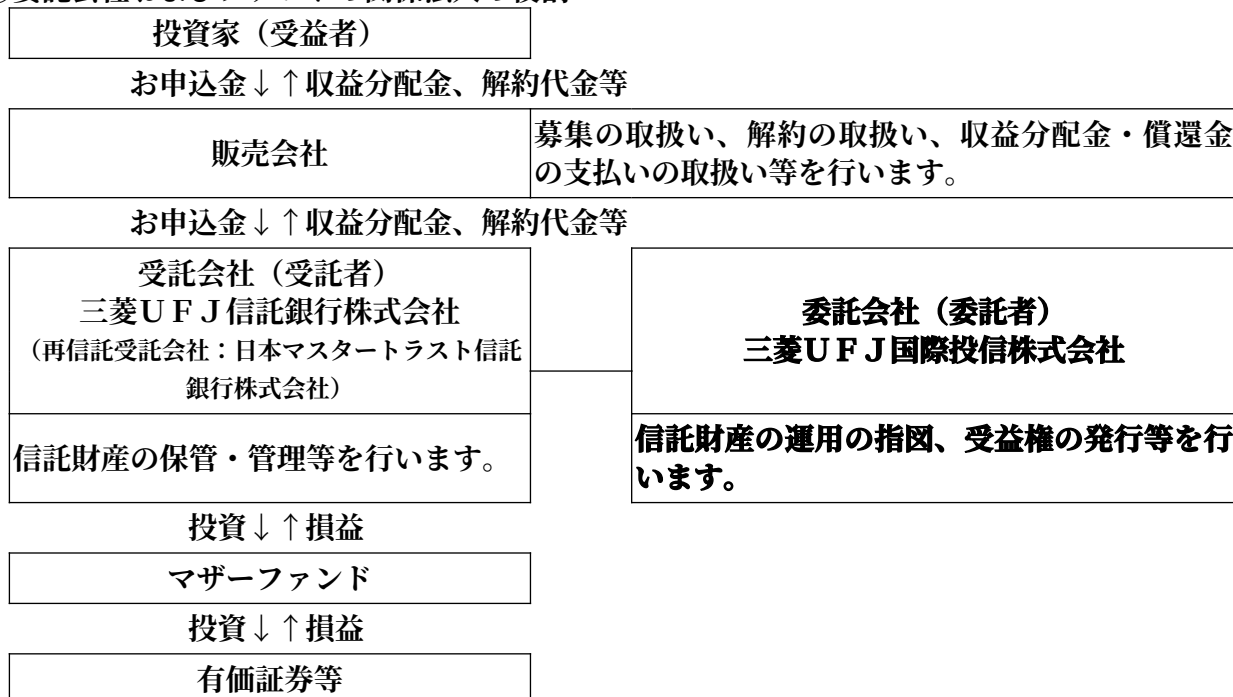
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

|             |                                   |
|-------------|-----------------------------------|
| 2013年10月25日 | 設定日、信託契約締結、運用開始                   |
| 2020年6月25日  | ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」を追加  |
| 2020年12月25日 | ファンドの投資対象から「日本債券インデックスマザーファンド」を削除 |

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ①委託会社およびファンドの関係法人の役割



## ②委託会社と関係法人との契約の概要

|                                      | 概要                                                                                                                      |
|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「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。<br>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<br>「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。                                                                 |

## ③委託会社の概況（2021年3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】

#### 「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）」

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、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

株式の実質組入比率は、株式組入れを比較的抑えつつ、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、原則として、先進国債券を一定の比率とし、残りの部分は国内債券等を組入れます。

国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な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。

#### 「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）」

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、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、株式の実質組入比率に応じて先進国債券の組入比率を決定し、残りの部分は国内債券等を組入れます。

国内外の債券市場が下落した場合等に債券の実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な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。

#### 「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。



株式の実質組入比率は、相場の局面判断や株式の収益率等に基づいて決定します。

債券の実質組入比率は、原則として、国内債券、先進国債券および新興国債券を均等とします。

国内外の債券市場が下落した場合等に債券への実質組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等の組入れを行う場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## （２）【投資対象】

### ①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ａ. 有価証券先物取引等

ｂ. スワップ取引

ｃ. 金利先渡し取引および為替先渡し取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### ②有価証券の指図範囲

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンドの受益証券のほか、次に掲げるものとします。

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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、国内債券インデックスマザーファンド受益証券、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・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。

### ＜ファンド共通＞

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す。）
  19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から23. に該当するものを除きます。）
  25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### ③金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当するものを除きます。）
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの

#### ④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

#### <マザーファンドの概要>

## ＴＯＰＩＸマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### ①投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### ②投資態度

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

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

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

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

### （投資制限）

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑤外貨建資産への投資は行いません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

### （基本方針）

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

### （運用方法）

#### ①投資対象

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

#### ②投資態度

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

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

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

### （投資制限）

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

#### 国内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総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。

##### （運用方法）

###### ①投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

###### ②投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

##### （投資制限）

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資は行いません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

#### ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

##### （基本方針）

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

##### （運用方法）

###### ①投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

###### ②投資態度

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑩金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

マネー・マーケット・マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

（運用方法）

- ①投資対象  
わが国の公社債等を主要投資対象とします。
- ②投資態度  
わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。  
なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

- ①株式への投資は行いません。
- ②外貨建資産への投資は行いません。
- ③有価証券先物取引等を行うことができます。
- ④スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑤金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

新興国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

- ①投資対象  
新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
- ②投資態度  
主として対象インデックスに採用されている新興国の株式等に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。  
株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。  
対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の投資比率が100%を超える場合があります。  
組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。  
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

**（投資制限）**

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

**ヘッジ付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・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ・円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

**（運用方法）****①投資対象**

新興国の米ドル建ての公社債を主要投資対象とします。

**②投資態度**

新興国の米ドル建ての公社債を主要投資対象とし、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ・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。

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為替変動リスクの低減をはかります。

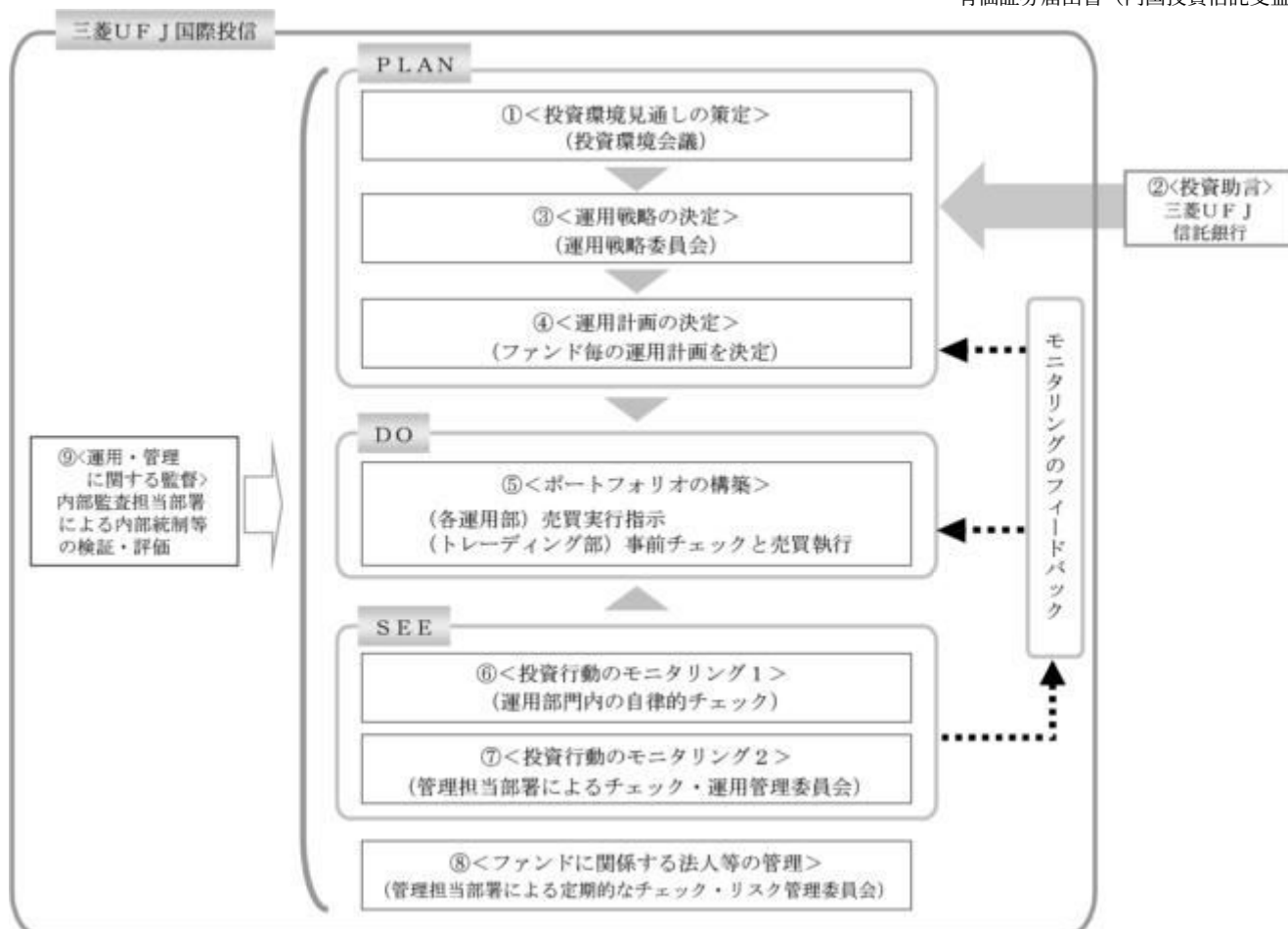
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

**（投資制限）**

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。
- ⑩金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
- ⑪外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

**（３）【運用体制】**





#### ①投資環境見通しの策定

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

#### ②投資助言

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

#### ③運用戦略の決定

運用戦略委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。

#### ④運用計画の決定

③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。

#### ⑤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。

#### ⑥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。

#### ⑦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。

#### ⑧ファンドに関係する法人等の管理

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

#### ⑨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。

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

#### （５）【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

##### ①新株引受権証券および新株予約権証券

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

##### ②投資信託証券

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

##### ③同一銘柄の転換社債等

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

##### ④スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった

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

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

#### ⑤信用取引

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

#### ⑥外国為替予約取引

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

#### ⑦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。

#### ⑧資金の借入れ

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

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

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

⑨投資する株式等の範囲

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

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

⑪有価証券の貸付

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

⑫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⑦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。

⑬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。

⑭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。

### ⑮信用リスクの分散規制

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

### ＜その他法令等に定められた投資制限＞

#### ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

## 3【投資リスク】

### （1）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

#### ①価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### ②為替変動リスク

組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。しかし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。そのため、為替相場の変動によっては、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

なお、為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分がヘッジコストとなります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

その他の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。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### ③信用リスク

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

#### ④流動性リスク

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

#### ⑤カントリーリスク

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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

#### ※留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

#### （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。

##### ①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。

##### ②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。

##### ③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。

##### ④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

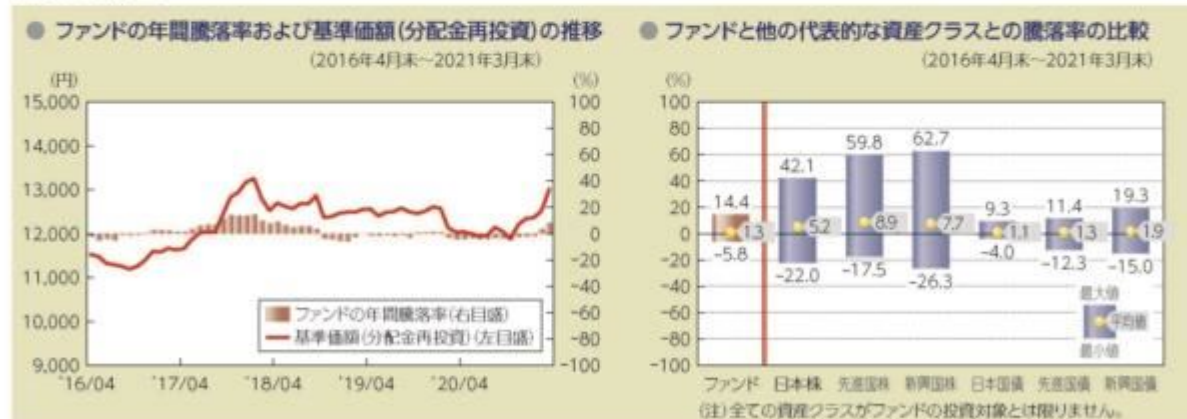
下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

### 株式抑制型



- 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。

### 株式重視型



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 新興国投資型



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

### 代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名                           | 注記等                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 日本株   | 東証株価指数(TOPIX)<br>(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<br>(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<br>(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の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】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

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、

分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

※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1.43%（税抜1.3%）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 | 0.75%  | 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 | 0.5%   | 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 | 0.05%  | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等         |

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

## （４）【その他の手数料等】

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

### ①個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償

還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

## 1. 収益分配金の課税

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

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

## 2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

## ②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

## ◇個別元本について

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

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

③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

## ◇収益分配金について

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

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

※上記は2021年3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】

### 【三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

#### （１）【投資状況】

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 24,966,924,283 | 96.35   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 946,245,745    | 3.65    |
| 純資産総額                    |      | 25,913,170,028 | 100.00  |

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

#### （２）【投資資産】

##### ①【投資有価証券の主要銘柄】

##### a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 3月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                   | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|-----------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックスマザーファンド     | 9,536,803,781 | 0.9775          | 9,322,225,696   | 0.9760          | 9,307,920,490   | 35.92           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド | 4,742,837,220 | 1.3687          | 6,491,521,303   | 1.3606          | 6,453,104,321   | 24.90           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド     | 1,232,246,249 | 3.7138          | 4,576,316,119   | 3.8323          | 4,722,337,300   | 18.22           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | TOPIXマザーファンド          | 2,016,171,496 | 2.2066          | 4,448,884,024   | 2.2238          | 4,483,562,172   | 17.30           |

（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 3年 3月31日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 96.35   |
| 合計        | 96.35   |

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



②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和3年3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<br>(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26年 3月25日） | 941,919,658    | 941,919,658    | 10,168                 | 10,168 |
| 第2計算期間末日（平成27年 3月25日） | 21,743,970,931 | 21,743,970,931 | 11,001                 | 11,001 |
| 第3計算期間末日（平成28年 3月25日） | 52,322,002,817 | 52,322,002,817 | 10,915                 | 10,915 |
| 第4計算期間末日（平成29年 3月27日） | 46,411,260,274 | 46,411,260,274 | 10,781                 | 10,781 |
| 第5計算期間末日（平成30年 3月26日） | 27,872,022,932 | 27,872,022,932 | 11,124                 | 11,124 |
| 第6計算期間末日（平成31年 3月25日） | 30,377,735,462 | 30,377,735,462 | 11,215                 | 11,215 |
| 第7計算期間末日（令和 2年 3月25日） | 28,457,787,754 | 28,457,787,754 | 11,015                 | 11,015 |
| 第8計算期間末日（令和 3年 3月25日） | 25,856,771,935 | 25,856,771,935 | 11,347                 | 11,347 |
| 令和 2年 3月末日            | 28,486,359,102 | —              | 11,040                 | —      |
| 4月末日                  | 28,330,781,204 | —              | 11,043                 | —      |
| 5月末日                  | 28,188,892,185 | —              | 11,003                 | —      |
| 6月末日                  | 28,060,784,358 | —              | 10,965                 | —      |
| 7月末日                  | 27,963,327,591 | —              | 11,003                 | —      |
| 8月末日                  | 28,039,869,060 | —              | 11,065                 | —      |
| 9月末日                  | 27,799,974,606 | —              | 11,042                 | —      |
| 10月末日                 | 27,124,484,212 | —              | 10,950                 | —      |
| 11月末日                 | 27,115,231,648 | —              | 11,103                 | —      |
| 12月末日                 | 26,704,265,768 | —              | 11,166                 | —      |
| 令和 3年 1月末日            | 26,323,637,929 | —              | 11,159                 | —      |
| 2月末日                  | 25,826,502,286 | —              | 11,154                 | —      |
| 3月末日                  | 25,913,170,028 | —              | 11,401                 | —      |

②【分配の推移】

|  |            |
|--|------------|
|  | 1万口当たりの分配金 |
|--|------------|



|        |    |
|--------|----|
| 第1計算期間 | 0円 |
| 第2計算期間 | 0円 |
| 第3計算期間 | 0円 |
| 第4計算期間 | 0円 |
| 第5計算期間 | 0円 |
| 第6計算期間 | 0円 |
| 第7計算期間 | 0円 |
| 第8計算期間 | 0円 |

### ③【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 1.68   |
| 第2計算期間 | 8.19   |
| 第3計算期間 | △0.78  |
| 第4計算期間 | △1.22  |
| 第5計算期間 | 3.18   |
| 第6計算期間 | 0.81   |
| 第7計算期間 | △1.78  |
| 第8計算期間 | 3.01   |

（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 | 941,256,105    | 14,895,373     | 926,360,732    |
| 第2計算期間 | 21,162,714,048 | 2,322,836,403  | 19,766,238,377 |
| 第3計算期間 | 35,213,444,969 | 7,042,824,390  | 47,936,858,956 |
| 第4計算期間 | 14,107,298,059 | 18,996,501,741 | 43,047,655,274 |
| 第5計算期間 | 4,023,376,097  | 22,015,232,045 | 25,055,799,326 |
| 第6計算期間 | 5,274,825,327  | 3,244,462,370  | 27,086,162,283 |
| 第7計算期間 | 1,987,264,985  | 3,238,817,169  | 25,834,610,099 |
| 第8計算期間 | 525,345,517    | 3,573,208,348  | 22,786,747,268 |

### 【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

#### （１）【投資状況】

令和 3年 3月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 26,264,020,191 | 97.04   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 802,140,837    | 2.96    |
| 純資産総額                    |      | 27,066,161,028 | 100.00  |

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

## （２）【投資資産】

### ①【投資有価証券の主要銘柄】

#### a 評価額上位３０銘柄

令和 ３年 ３月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                   | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|-----------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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     | 2,531,454,142 | 3.7170          | 9,409,558,514   | 3.8323          | 9,701,291,708   | 35.84           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ＴＯＰＩＸマザーファンド          | 4,104,351,229 | 2.2083          | 9,063,733,680   | 2.2238          | 9,127,256,263   | 33.72           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド | 4,871,837,923 | 1.3686          | 6,667,939,743   | 1.3606          | 6,628,622,678   | 24.49           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックスマザーファンド     | 826,690,105   | 0.9782          | 808,668,261     | 0.9760          | 806,849,542     | 2.98            |

（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 ３年 ３月31日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 97.04   |
| 合計        | 97.04   |

（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。

### ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

### ①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和3年3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<br>(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26年 3月25日） | 1,343,219,066  | 1,343,219,066  | 10,292                 | 10,292 |
| 第2計算期間末日（平成27年 3月25日） | 24,655,190,688 | 24,655,190,688 | 11,765                 | 11,765 |
| 第3計算期間末日（平成28年 3月25日） | 61,738,348,442 | 61,738,348,442 | 11,488                 | 11,488 |
| 第4計算期間末日（平成29年 3月27日） | 43,553,330,759 | 43,553,330,759 | 11,535                 | 11,535 |
| 第5計算期間末日（平成30年 3月26日） | 27,531,362,672 | 27,531,362,672 | 12,321                 | 12,321 |
| 第6計算期間末日（平成31年 3月25日） | 31,437,259,282 | 31,437,259,282 | 12,534                 | 12,534 |
| 第7計算期間末日（令和 2年 3月25日） | 28,750,760,854 | 28,750,760,854 | 12,010                 | 12,010 |
| 第8計算期間末日（令和 3年 3月25日） | 26,855,099,280 | 26,855,099,280 | 12,862                 | 12,862 |
| 令和 2年 3月末日            | 28,807,519,630 | —              | 12,038                 | —      |
| 4月末日                  | 28,689,351,512 | —              | 12,040                 | —      |
| 5月末日                  | 28,583,567,454 | —              | 11,997                 | —      |
| 6月末日                  | 28,268,136,895 | —              | 11,947                 | —      |
| 7月末日                  | 28,223,059,867 | —              | 11,961                 | —      |
| 8月末日                  | 28,521,311,838 | —              | 12,146                 | —      |
| 9月末日                  | 28,113,346,713 | —              | 12,052                 | —      |
| 10月末日                 | 27,282,279,414 | —              | 11,884                 | —      |
| 11月末日                 | 27,497,303,351 | —              | 12,199                 | —      |
| 12月末日                 | 27,241,446,129 | —              | 12,343                 | —      |
| 令和 3年 1月末日            | 26,793,174,205 | —              | 12,364                 | —      |
| 2月末日                  | 26,582,175,141 | —              | 12,520                 | —      |
| 3月末日                  | 27,066,161,028 | —              | 13,012                 | —      |

## ②【分配の推移】

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

## ③【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 2.92   |
| 第2計算期間 | 14.31  |
| 第3計算期間 | △2.35  |
| 第4計算期間 | 0.40   |
| 第5計算期間 | 6.81   |
| 第6計算期間 | 1.72   |
| 第7計算期間 | △4.18  |
| 第8計算期間 | 7.09   |

（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 | 1,311,088,736  | 5,967,768      | 1,305,120,968  |
| 第2計算期間 | 25,095,132,460 | 5,444,511,240  | 20,955,742,188 |
| 第3計算期間 | 43,638,216,569 | 10,852,980,012 | 53,740,978,745 |
| 第4計算期間 | 5,975,078,368  | 21,959,271,960 | 37,756,785,153 |
| 第5計算期間 | 5,921,593,950  | 21,334,148,864 | 22,344,230,239 |
| 第6計算期間 | 5,496,470,932  | 2,758,727,653  | 25,081,973,518 |
| 第7計算期間 | 2,340,829,162  | 3,484,699,835  | 23,938,102,845 |
| 第8計算期間 | 424,139,994    | 3,482,947,344  | 20,879,295,495 |

#### 【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

##### （１）【投資状況】

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 7,580,286,417 | 94.99   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 399,809,268   | 5.01    |
| 純資産総額                    |      | 7,980,095,685 | 100.00  |

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

##### （２）【投資資産】

##### ①【投資有価証券の主要銘柄】

##### a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 3月31日現在

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                    | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|-----------|------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 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     | 704,517,064   | 3.1143          | 2,194,077,493   | 3.2207          | 2,269,038,108   | 28.43           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ＴＯＰＩＸマザーファンド           | 1,019,025,204 | 2.2066          | 2,248,581,016   | 2.2238          | 2,266,108,248   | 28.40           |
| 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      | 570,575,739   | 3.7138          | 2,119,004,180   | 3.8323          | 2,186,617,404   | 27.40           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックスマザーファンド      | 294,992,701   | 0.9779          | 288,473,363     | 0.9760          | 287,912,876     | 3.61            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド  | 210,774,454   | 1.3680          | 288,339,454     | 1.3606          | 286,779,722     | 3.59            |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド | 248,690,142   | 1.1512          | 286,292,092     | 1.1413          | 283,830,059     | 3.56            |

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

## b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 3年 3月31日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 94.99   |
| 合計        | 94.99   |

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

### ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

### ①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和3年3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<br>(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26年 3月25日) | 125,120,227   | 125,120,227   | 10,035                 | 10,035 |
| 第2計算期間末日 | (平成27年 3月25日) | 1,066,640,671 | 1,066,640,671 | 10,816                 | 10,816 |
| 第3計算期間末日 | (平成28年 3月25日) | 1,296,388,956 | 1,296,388,956 | 10,811                 | 10,811 |
| 第4計算期間末日 | (平成29年 3月27日) | 1,185,983,561 | 1,185,983,561 | 11,276                 | 11,276 |

|          |               |               |               |        |        |
|----------|---------------|---------------|---------------|--------|--------|
| 第5計算期間末日 | (平成30年 3月26日) | 8,838,464,673 | 8,838,464,673 | 12,488 | 12,488 |
| 第6計算期間末日 | (平成31年 3月25日) | 9,471,549,757 | 9,471,549,757 | 12,185 | 12,185 |
| 第7計算期間末日 | (令和 2年 3月25日) | 8,417,184,461 | 8,417,184,461 | 11,099 | 11,099 |
| 第8計算期間末日 | (令和 3年 3月25日) | 7,842,260,783 | 7,842,260,783 | 12,768 | 12,768 |
|          | 令和 2年 3月末日    | 8,432,052,205 | —             | 11,132 | —      |
|          | 4月末日          | 8,356,943,830 | —             | 11,106 | —      |
|          | 5月末日          | 8,511,911,126 | —             | 11,333 | —      |
|          | 6月末日          | 8,491,815,711 | —             | 11,413 | —      |
|          | 7月末日          | 8,459,191,400 | —             | 11,500 | —      |
|          | 8月末日          | 8,737,737,966 | —             | 11,965 | —      |
|          | 9月末日          | 8,389,953,696 | —             | 11,631 | —      |
|          | 10月末日         | 8,077,328,655 | —             | 11,486 | —      |
|          | 11月末日         | 8,184,376,206 | —             | 11,915 | —      |
|          | 12月末日         | 8,069,357,885 | —             | 12,093 | —      |
|          | 令和 3年 1月末日    | 8,084,296,400 | —             | 12,303 | —      |
|          | 2月末日          | 8,017,339,041 | —             | 12,638 | —      |
|          | 3月末日          | 7,980,095,685 | —             | 13,019 | —      |

## ②【分配の推移】

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

## ③【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 0.35   |
| 第2計算期間 | 7.78   |
| 第3計算期間 | △0.04  |
| 第4計算期間 | 4.30   |
| 第5計算期間 | 10.74  |
| 第6計算期間 | △2.42  |
| 第7計算期間 | △8.91  |
| 第8計算期間 | 15.03  |



（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 | 128,985,856   | 4,305,586     | 124,680,270   |
| 第2計算期間 | 1,152,904,287 | 291,375,437   | 986,209,120   |
| 第3計算期間 | 551,196,595   | 338,236,484   | 1,199,169,231 |
| 第4計算期間 | 468,990,819   | 616,395,704   | 1,051,764,346 |
| 第5計算期間 | 7,312,217,505 | 1,286,533,821 | 7,077,448,030 |
| 第6計算期間 | 1,589,895,766 | 894,060,789   | 7,773,283,007 |
| 第7計算期間 | 619,203,622   | 808,866,213   | 7,583,620,416 |
| 第8計算期間 | 97,832,324    | 1,539,250,882 | 6,142,201,858 |

（参考）

TOPIXマザーファンド

投資状況

令和 3年 3月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 株式                       | 日本   | 501,752,522,500 | 98.07   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 9,887,695,502   | 1.93    |
| 純資産総額                    |      | 511,640,218,002 | 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 3年 3月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域 | 時価合計           | 投資比率（％） |
|----------|----|------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本   | 10,180,340,000 | 1.99    |

（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 3年 3月31日現在

| 国／<br>地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|-------------------|--------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本       | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 1,896,400  | 8,158.76        | 15,472,273,410  | 8,616.00        | 16,339,382,400  | 3.19            |
| 日本       | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 1,457,500  | 9,075.18        | 13,227,076,460  | 9,330.00        | 13,598,475,000  | 2.66            |
| 日本       | 株式 | ソニー               | 電気機器   | 1,172,700  | 11,217.27       | 13,154,496,200  | 11,595.00       | 13,597,456,500  | 2.66            |
| 日本       | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 183,800    | 51,470.80       | 9,460,333,120   | 50,270.00       | 9,239,626,000   | 1.81            |
| 日本       | 株式 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 12,630,000 | 619.47          | 7,823,979,140   | 591.70          | 7,473,171,000   | 1.46            |
| 日本       | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 1,281,400  | 5,127.16        | 6,569,953,680   | 5,401.00        | 6,920,841,400   | 1.35            |
| 日本       | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 107,100    | 62,320.94       | 6,674,573,500   | 61,810.00       | 6,619,851,000   | 1.29            |
| 日本       | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 339,000    | 18,348.53       | 6,220,153,600   | 18,610.00       | 6,308,790,000   | 1.23            |
| 日本       | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 1,557,500  | 4,168.85        | 6,492,998,790   | 3,985.00        | 6,206,637,500   | 1.21            |
| 日本       | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 2,148,500  | 2,971.03        | 6,383,275,140   | 2,842.00        | 6,106,037,000   | 1.19            |
| 日本       | 株式 | 日本電産              | 電気機器   | 450,500    | 13,076.54       | 5,890,985,600   | 13,435.00       | 6,052,467,500   | 1.18            |
| 日本       | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 238,500    | 21,758.69       | 5,189,448,390   | 22,320.00       | 5,323,320,000   | 1.04            |
| 日本       | 株式 | 第一三共              | 医薬品    | 1,607,100  | 3,163.69        | 5,084,372,400   | 3,225.00        | 5,182,897,500   | 1.01            |
| 日本       | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器   | 109,600    | 43,601.79       | 4,778,756,400   | 46,790.00       | 5,128,184,000   | 1.00            |
| 日本       | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 1,277,700  | 4,141.10        | 5,291,092,895   | 4,007.00        | 5,119,743,900   | 1.00            |
| 日本       | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 1,473,100  | 3,544.20        | 5,220,972,500   | 3,395.00        | 5,001,174,500   | 0.98            |
| 日本       | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 1,473,900  | 3,276.25        | 4,828,868,890   | 3,319.00        | 4,891,874,100   | 0.96            |
| 日本       | 株式 | 村田製作所             | 電気機器   | 549,900    | 8,884.38        | 4,885,523,130   | 8,842.00        | 4,862,215,800   | 0.95            |
| 日本       | 株式 | HOYA              | 精密機器   | 368,400    | 12,736.60       | 4,692,164,499   | 13,005.00       | 4,791,042,000   | 0.94            |
| 日本       | 株式 | 伊藤忠商事             | 卸売業    | 1,289,600  | 3,512.55        | 4,529,790,480   | 3,587.00        | 4,625,795,200   | 0.90            |
| 日本       | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 900,000    | 5,332.88        | 4,799,592,750   | 5,004.00        | 4,503,600,000   | 0.88            |
| 日本       | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 164,300    | 26,207.84       | 4,305,949,090   | 26,185.00       | 4,302,195,500   | 0.84            |
| 日本       | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 2,508,800  | 1,650.07        | 4,139,697,600   | 1,599.00        | 4,011,571,200   | 0.78            |
| 日本       | 株式 | SMC               | 機械     | 54,800     | 64,753.03       | 3,548,466,500   | 64,310.00       | 3,524,188,000   | 0.69            |
| 日本       | 株式 | 三菱商事              | 卸売業    | 1,122,500  | 3,199.33        | 3,591,254,160   | 3,130.00        | 3,513,425,000   | 0.69            |
| 日本       | 株式 | 三井物産              | 卸売業    | 1,496,900  | 2,348.16        | 3,514,975,090   | 2,302.00        | 3,445,863,800   | 0.67            |
| 日本       | 株式 | 花王                | 化学     | 448,200    | 7,133.51        | 3,197,242,530   | 7,313.00        | 3,277,686,600   | 0.64            |
| 日本       | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 612,000    | 5,462.08        | 3,342,795,260   | 5,265.00        | 3,222,180,000   | 0.63            |
| 日本       | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業    | 721,300    | 4,435.74        | 3,199,504,550   | 4,463.00        | 3,219,161,900   | 0.63            |
| 日本       | 株式 | オリエンタルランド         | サービス業  | 190,200    | 16,504.13       | 3,139,087,400   | 16,625.00       | 3,162,075,000   | 0.62            |

(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 3年 3月31日現在

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

|    |            |       |
|----|------------|-------|
| 株式 | 水産・農林業     | 0.09  |
|    | 鉱業         | 0.17  |
|    | 建設業        | 2.36  |
|    | 食料品        | 3.27  |
|    | 繊維製品       | 0.48  |
|    | パルプ・紙      | 0.25  |
|    | 化学         | 7.23  |
|    | 医薬品        | 5.40  |
|    | 石油・石炭製品    | 0.44  |
|    | ゴム製品       | 0.60  |
|    | ガラス・土石製品   | 0.81  |
|    | 鉄鋼         | 0.76  |
|    | 非鉄金属       | 0.75  |
|    | 金属製品       | 0.62  |
|    | 機械         | 5.56  |
|    | 電気機器       | 17.13 |
|    | 輸送用機器      | 7.22  |
|    | 精密機器       | 2.49  |
|    | その他製品      | 2.33  |
|    | 電気・ガス業     | 1.34  |
|    | 陸運業        | 3.35  |
|    | 海運業        | 0.23  |
|    | 空運業        | 0.45  |
|    | 倉庫・運輸関連業   | 0.17  |
|    | 情報・通信業     | 9.06  |
|    | 卸売業        | 4.69  |
|    | 小売業        | 4.61  |
|    | 銀行業        | 5.06  |
|    | 証券、商品先物取引業 | 0.77  |
|    | 保険業        | 1.81  |
|    | その他金融業     | 1.10  |
|    | 不動産業       | 1.99  |
|    | サービス業      | 5.48  |
|    | 小計         | 98.07 |
| 合計 |            | 98.07 |

（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 3年 3月31日現在

| 資産の種類    | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量  | 通貨 | 簿価金額（円）        | 評価金額（円）        | 投資比率（％） |
|----------|-------|---------------|----|-----|----|----------------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | ＴＯＰＩＸ ２１年０６月限 | 買建 | 521 | 円  | 10,222,903,300 | 10,180,340,000 | 1.99    |

（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 3年 3月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国／地域     | 時価合計            | 投資比率（％） |
|-------|----------|-----------------|---------|
| 株式    | アメリカ     | 619,256,175,475 | 68.25   |
|       | イギリス     | 41,207,969,342  | 4.54    |
|       | カナダ      | 31,056,819,602  | 3.42    |
|       | フランス     | 29,575,719,259  | 3.26    |
|       | ドイツ      | 27,201,813,703  | 3.00    |
|       | スイス      | 26,768,297,356  | 2.95    |
|       | オーストラリア  | 19,077,267,778  | 2.10    |
|       | オランダ     | 15,701,198,840  | 1.73    |
|       | スウェーデン   | 10,496,625,651  | 1.16    |
|       | 香港       | 9,049,391,072   | 1.00    |
|       | スペイン     | 6,924,847,511   | 0.76    |
|       | デンマーク    | 6,732,887,150   | 0.74    |
|       | イタリア     | 5,528,190,832   | 0.61    |
|       | フィンランド   | 2,926,880,945   | 0.32    |
|       | シンガポール   | 2,784,837,813   | 0.31    |
|       | ベルギー     | 2,520,835,122   | 0.28    |
|       | アイルランド   | 2,071,176,458   | 0.23    |
|       | ノルウェー    | 1,831,898,081   | 0.20    |
|       | イスラエル    | 897,775,381     | 0.10    |
|       | ルクセンブルグ  | 892,022,949     | 0.10    |
|       | ニュージーランド | 750,477,863     | 0.08    |
|       | オーストリア   | 530,909,872     | 0.06    |
|       | ポルトガル    | 454,705,406     | 0.05    |
| 小計    |          | 864,238,723,461 | 95.25   |
| 投資証券  | アメリカ     | 16,162,042,540  | 1.78    |
|       | オーストラリア  | 1,204,695,981   | 0.13    |
|       | イギリス     | 503,161,008     | 0.06    |
|       | シンガポール   | 436,187,395     | 0.05    |

|                          |      |                 |        |
|--------------------------|------|-----------------|--------|
|                          | 香港   | 346,641,187     | 0.04   |
|                          | フランス | 272,533,909     | 0.03   |
|                          | オランダ | 204,645,787     | 0.02   |
|                          | カナダ  | 123,242,944     | 0.01   |
|                          | 小計   | 19,253,150,751  | 2.12   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 23,836,183,443  | 2.63   |
| 純資産総額                    |      | 907,328,057,655 | 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 3年 3月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域    | 時価合計           | 投資比率（％） |
|----------|----|---------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ    | 17,394,584,706 | 1.92    |
|          | 買建 | カナダ     | 820,672,776    | 0.09    |
|          | 買建 | ドイツ     | 3,226,599,552  | 0.36    |
|          | 買建 | オーストラリア | 849,083,400    | 0.09    |
|          | 買建 | イギリス    | 1,127,209,869  | 0.12    |
|          | 買建 | スイス     | 697,209,039    | 0.08    |

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名                  | 業種                 | 数量        | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円)    | 評価単価<br>(円) | 評価金額<br>(円)    | 投資比率<br>(%) |
|------|----|----------------------|--------------------|-----------|-------------|----------------|-------------|----------------|-------------|
| 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 | 2,736,374 | 10,066.73   | 27,546,363,043 | 13,274.12   | 36,322,981,468 | 4.00        |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP       | ソフトウェア・サービス        | 1,155,997 | 21,732.93   | 25,123,202,284 | 25,668.11   | 29,672,262,202 | 3.27        |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC       | 小売                 | 68,641    | 296,003.57  | 20,317,981,087 | 338,251.15  | 23,217,897,592 | 2.56        |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A    | メディア・娯楽            | 64,591    | 168,149.83  | 10,860,966,141 | 226,564.69  | 14,634,040,131 | 1.61        |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-CLASS A | メディア・娯楽            | 386,861   | 25,487.25   | 9,860,023,072  | 31,884.47   | 12,334,861,817 | 1.36        |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC            | 自動車・自動車部品          | 122,036   | 33,042.69   | 4,032,398,070  | 70,369.49   | 8,587,611,106  | 0.95        |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO  | 銀行                 | 490,598   | 10,942.18   | 5,368,214,625  | 17,102.48   | 8,390,442,876  | 0.92        |

|      |    |                              |                        |           |            |               |            |               |      |
|------|----|------------------------------|------------------------|-----------|------------|---------------|------------|---------------|------|
| 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 | 423,713   | 16,580.03  | 7,025,174,933 | 18,268.25  | 7,740,498,021 | 0.85 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C            | メディア・娯楽                | 31,650    | 159,760.06 | 5,056,406,073 | 227,568.83 | 7,202,553,577 | 0.79 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES      | ソフトウェア・サービス            | 272,404   | 21,162.08  | 5,764,636,267 | 23,459.44  | 6,390,447,745 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC       | ヘルスケア機器・サービス           | 152,792   | 33,405.25  | 5,104,056,084 | 41,356.82  | 6,318,992,403 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 各種金融                   | 220,688   | 21,023.82  | 4,639,706,774 | 28,584.21  | 6,308,193,218 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | WALT DISNEY CO/THE           | メディア・娯楽                | 291,345   | 13,477.13  | 3,926,495,928 | 20,540.02  | 5,984,233,962 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 家庭用品・パーソナル用品           | 398,495   | 13,457.24  | 5,362,645,198 | 14,995.66  | 5,975,699,317 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC               | 小売                     | 173,285   | 27,398.45  | 4,747,741,517 | 33,746.62  | 5,847,783,428 | 0.64 |
| スイス  | 株式 | NESTLE SA-REG                | 食品・飲料・タバコ              | 463,752   | 12,350.93  | 5,727,770,305 | 12,442.65  | 5,770,305,214 | 0.64 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A           | ソフトウェア・サービス            | 143,399   | 33,153.21  | 4,754,137,494 | 39,656.32  | 5,686,676,918 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP                  | 半導体・半導体製造装置            | 99,614    | 42,956.41  | 4,279,060,549 | 57,001.25  | 5,678,123,285 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP         | 銀行                     | 1,253,091 | 2,714.02   | 3,400,920,498 | 4,316.58   | 5,409,071,183 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | PAYPAL HOLDINGS INC          | ソフトウェア・サービス            | 179,153   | 18,659.48  | 3,342,903,164 | 26,187.34  | 4,691,541,132 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP                   | 半導体・半導体製造装置            | 659,518   | 6,465.46   | 4,264,089,886 | 7,059.97   | 4,656,181,713 | 0.51 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV              | 半導体・半導体製造装置            | 68,531    | 40,283.82  | 2,760,690,589 | 67,015.74  | 4,592,655,678 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CLASS A         | メディア・娯楽                | 734,608   | 4,414.57   | 3,242,985,577 | 6,086.83   | 4,471,438,273 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 電気通信サービス               | 666,100   | 6,295.88   | 4,193,686,012 | 6,486.49   | 4,320,656,917 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP             | エネルギー                  | 679,464   | 4,993.91   | 3,393,184,504 | 6,276.14   | 4,264,417,916 | 0.47 |
| アメリカ | 株式 | NETFLIX INC                  | メディア・娯楽                | 71,097    | 51,500.00  | 3,661,495,842 | 56,837.40  | 4,040,969,118 | 0.45 |
| 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 | 113,112   | 39,323.62  | 4,447,973,802 | 35,687.18  | 4,036,648,587 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | ADOBE INC                    | ソフトウェア・サービス            | 77,225    | 45,036.04  | 3,477,908,341 | 51,531.07  | 3,979,487,390 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC                     | 電気通信サービス               | 1,146,388 | 3,262.21   | 3,739,762,600 | 3,402.11   | 3,900,147,594 | 0.43 |
| 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     | 680,092   | 4,851.56   | 3,299,508,792 | 5,731.45   | 3,897,917,850 | 0.43 |

（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 3年 3月31日現在

| 種類   | 業種                     | 投資比率（％） |
|------|------------------------|---------|
| 株式   | エネルギー                  | 3.33    |
|      | 素材                     | 4.39    |
|      | 資本財                    | 6.62    |
|      | 商業・専門サービス              | 1.15    |
|      | 運輸                     | 2.03    |
|      | 自動車・自動車部品              | 2.00    |
|      | 耐久消費財・アパレル             | 1.89    |
|      | 消費者サービス                | 1.67    |
|      | メディア・娯楽                | 6.94    |
|      | 小売                     | 5.63    |
|      | 食品・生活必需品小売り            | 1.32    |
|      | 食品・飲料・タバコ              | 3.92    |
|      | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.82    |
|      | ヘルスケア機器・サービス           | 5.06    |
|      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.22    |
|      | 銀行                     | 6.18    |
|      | 各種金融                   | 4.50    |
|      | 保険                     | 3.19    |
|      | 不動産                    | 0.44    |
|      | ソフトウェア・サービス            | 11.17   |
|      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 5.55    |
|      | 電気通信サービス               | 1.80    |
|      | 公益事業                   | 3.03    |
|      | 半導体・半導体製造装置            | 4.40    |
|      | 小計                     | 95.25   |
| 投資証券 | —                      | 2.12    |
| 合計   |                        | 97.37   |

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

令和 3年 3月31日現在



| 資産の種類    | 地域      | 取引所名              | 資産の名称        | 建別 | 数量  | 通貨        | 簿価金額           | 簿価金額（円）        | 評価金額        | 評価金額（円）        | 投資比率（％） |
|----------|---------|-------------------|--------------|----|-----|-----------|----------------|----------------|-------------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ    | シカゴ商業取引所          | SP EMINI2106 | 買建 | 796 | アメリカドル    | 157,360,816.08 | 17,421,415,948 | 157,118,460 | 17,394,584,706 | 1.92    |
|          | カナダ     | モントリオール取引所        | SP/TSE602106 | 買建 | 42  | カナダドル     | 9,392,515.5    | 824,475,011    | 9,349,200   | 820,672,776    | 0.09    |
|          | ドイツ     | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO ST 2106 | 買建 | 642 | ユーロ       | 24,337,223.8   | 3,158,971,649  | 24,858,240  | 3,226,599,552  | 0.36    |
|          | オーストラリア | シドニー先物取引所         | SPI 200 2106 | 買建 | 60  | オーストラリアドル | 10,210,065     | 861,321,083    | 10,065,000  | 849,083,400    | 0.09    |
|          | イギリス    | インターコンチネンタル取引所    | FTSE100 2106 | 買建 | 110 | イギリスポンド   | 7,383,542      | 1,123,996,598  | 7,404,650   | 1,127,209,869  | 0.12    |
|          | スイス     | ユーレックス・チューリッヒ取引所  | SWISS IX2106 | 買建 | 54  | スイスフラン    | 5,816,909.9    | 683,196,068    | 5,936,220   | 697,209,039    | 0.08    |

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

## 新興国株式インデックスマザーファンド

### 投資状況

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国／地域    | 時価合計           | 投資比率（％） |
|-------|---------|----------------|---------|
| 株式    | 香港      | 44,243,692,058 | 20.88   |
|       | アメリカ    | 30,748,540,378 | 14.51   |
|       | 台湾      | 28,465,365,148 | 13.43   |
|       | 韓国      | 27,122,926,122 | 12.80   |
|       | インド     | 19,789,279,234 | 9.34    |
|       | 中国      | 8,928,987,959  | 4.21    |
|       | ブラジル    | 8,838,265,175  | 4.17    |
|       | 南アフリカ   | 7,609,428,305  | 3.59    |
|       | サウジアラビア | 5,436,336,591  | 2.57    |
|       | タイ      | 3,809,489,333  | 1.80    |
|       | メキシコ    | 3,472,137,133  | 1.64    |
|       | マレーシア   | 2,891,350,072  | 1.36    |
|       | インドネシア  | 2,531,366,360  | 1.19    |
|       | カタール    | 1,344,030,330  | 0.63    |
|       | フィリピン   | 1,329,813,307  | 0.63    |
|       | ポーランド   | 1,274,889,457  | 0.60    |

|                          |          |                 |        |
|--------------------------|----------|-----------------|--------|
|                          | チリ       | 1,159,807,800   | 0.55   |
|                          | アラブ首長国連邦 | 1,112,146,083   | 0.52   |
|                          | クウェート    | 1,016,935,570   | 0.48   |
|                          | トルコ      | 530,473,598     | 0.25   |
|                          | ハンガリー    | 423,857,767     | 0.20   |
|                          | コロンビア    | 334,758,868     | 0.16   |
|                          | チェコ      | 220,732,070     | 0.10   |
|                          | ギリシャ     | 215,082,169     | 0.10   |
|                          | イギリス     | 107,587,240     | 0.05   |
|                          | 小計       | 202,957,278,127 | 95.77  |
| 投資証券                     | メキシコ     | 90,581,639      | 0.04   |
|                          | 南アフリカ    | 80,030,821      | 0.04   |
|                          | 小計       | 170,612,460     | 0.08   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —        | 8,783,616,285   | 4.15   |
| 純資産総額                    |          | 211,911,506,872 | 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 3年 3月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|----------|----|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 8,844,754,752 | 4.17    |

（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 3年 3月31日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名                             | 業種                  | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|---------------------------------|---------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 台湾   | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR<br>MANUFAC | 半導体・半<br>導体製造装<br>置 | 5,597,000 | 1,348.98        | 7,550,273,250   | 2,316.36        | 12,964,666,920  | 6.12            |

|       |    |                              |                        |            |           |                |           |                |      |
|-------|----|------------------------------|------------------------|------------|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| 香港    | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD         | メディア・娯楽                | 1,307,600  | 6,700.26  | 8,761,270,049  | 8,679.28  | 11,349,026,528 | 5.36 |
| アメリカ  | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 小売                     | 430,660    | 23,962.77 | 10,319,810,087 | 25,380.26 | 10,930,266,002 | 5.16 |
| 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     | 1,086,489  | 5,222.55  | 5,674,245,814  | 8,039.15  | 8,734,458,909  | 4.12 |
| 香港    | 株式 | MEITUAN-CLASS B              | 小売                     | 819,100    | 2,432.01  | 1,992,063,528  | 4,180.86  | 3,424,545,702  | 1.62 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS            | 小売                     | 99,024     | 23,064.90 | 2,283,978,902  | 26,270.50 | 2,601,410,982  | 1.23 |
| 香港    | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 銀行                     | 21,994,550 | 87.76     | 1,930,394,122  | 93.98     | 2,067,135,787  | 0.98 |
| インド   | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | エネルギー                  | 646,449    | 2,524.37  | 1,631,881,393  | 3,084.53  | 1,993,995,213  | 0.94 |
| 香港    | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険                     | 1,372,500  | 1,164.21  | 1,597,890,106  | 1,332.15  | 1,828,378,620  | 0.86 |
| アメリカ  | 株式 | JD.COM INC-ADR               | 小売                     | 196,428    | 6,202.86  | 1,218,416,366  | 9,188.92  | 1,804,963,142  | 0.85 |
| 韓国    | 株式 | SK HYNIX INC                 | 半導体・半導体製造装置            | 124,025    | 8,872.66  | 1,100,432,121  | 13,154.10 | 1,631,437,253  | 0.77 |
| インド   | 株式 | INFOSYS LTD                  | ソフトウェア・サービス            | 772,547    | 1,199.35  | 926,557,197    | 2,105.65  | 1,626,718,226  | 0.77 |
| ブラジル  | 株式 | VALE SA                      | 素材                     | 841,030    | 1,067.03  | 897,404,430    | 1,859.86  | 1,564,199,065  | 0.74 |
| インド   | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 銀行                     | 386,622    | 2,726.50  | 1,054,127,690  | 3,960.58  | 1,531,250,454  | 0.72 |
| アメリカ  | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR         | メディア・娯楽                | 61,328     | 13,167.90 | 807,561,424    | 24,160.24 | 1,481,699,401  | 0.70 |
| 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     | 2,840,272  | 323.27    | 918,195,376    | 502.45    | 1,427,123,069  | 0.67 |
| アメリカ  | 株式 | PINDUODUO INC-ADR            | 小売                     | 89,388     | 10,537.46 | 941,923,342    | 14,994.56 | 1,340,333,944  | 0.63 |
| 韓国    | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 185,040    | 4,532.80  | 838,751,014    | 7,237.20  | 1,339,171,488  | 0.63 |
| 台湾    | 株式 | MEDIATEK INC                 | 半導体・半導体製造装置            | 342,236    | 1,908.63  | 653,203,883    | 3,767.47  | 1,289,367,285  | 0.61 |
| アメリカ  | 株式 | NIO INC - ADR                | 自動車・自動車部品              | 291,284    | 2,044.54  | 595,543,633    | 4,157.16  | 1,210,914,339  | 0.57 |
| 香港    | 株式 | XIAOMI CORP-CLASS B          | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 3,037,200  | 242.04    | 735,132,052    | 364.54    | 1,107,193,037  | 0.52 |
| 香港    | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H     | 銀行                     | 13,945,350 | 72.58     | 1,012,155,069  | 79.17     | 1,104,114,719  | 0.52 |
| アメリカ  | 株式 | NETEASE INC-ADR              | メディア・娯楽                | 94,538     | 8,810.07  | 832,886,511    | 11,392.05 | 1,076,982,474  | 0.51 |
| インド   | 株式 | ICICI BANK LTD               | 銀行                     | 1,164,497  | 548.71    | 638,973,345    | 899.00    | 1,046,887,461  | 0.49 |
| 香港    | 株式 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 744,000    | 781.58    | 581,497,910    | 1,399.08  | 1,040,915,520  | 0.49 |
| 韓国    | 株式 | NAVER CORP                   | メディア・娯楽                | 28,018     | 23,345.75 | 654,101,407    | 36,821.70 | 1,031,670,391  | 0.49 |
| インド   | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | ソフトウェア・サービス            | 212,355    | 3,254.38  | 691,083,892    | 4,800.99  | 1,019,515,505  | 0.48 |
| アメリカ  | 株式 | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 銀行                     | 578,028    | 1,211.33  | 700,183,214    | 1,705.48  | 985,819,558    | 0.47 |
| アメリカ  | 株式 | GAZPROM PJSC-SPON ADR        | エネルギー                  | 1,297,152  | 558.38    | 724,316,348    | 652.96    | 846,998,202    | 0.40 |
| 韓国    | 株式 | SAMSUNG SDI CO LTD           | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 12,610     | 34,239.96 | 431,765,977    | 65,526.00 | 826,282,860    | 0.39 |

（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 3年 3月31日現在

| 種類   | 業種                     | 投資比率（％） |
|------|------------------------|---------|
| 株式   | エネルギー                  | 4.64    |
|      | 素材                     | 7.67    |
|      | 資本財                    | 2.46    |
|      | 商業・専門サービス              | 0.31    |
|      | 運輸                     | 1.30    |
|      | 自動車・自動車部品              | 3.18    |
|      | 耐久消費財・アパレル             | 1.40    |
|      | 消費者サービス                | 1.31    |
|      | メディア・娯楽                | 8.82    |
|      | 小売                     | 10.98   |
|      | 食品・生活必需品小売り            | 1.16    |
|      | 食品・飲料・タバコ              | 3.24    |
|      | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.02    |
|      | ヘルスケア機器・サービス           | 1.14    |
|      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 3.10    |
|      | 銀行                     | 12.68   |
|      | 各種金融                   | 2.02    |
|      | 保険                     | 2.77    |
|      | 不動産                    | 2.01    |
|      | ソフトウェア・サービス            | 2.35    |
|      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 8.97    |
|      | 電気通信サービス               | 2.42    |
|      | 公益事業                   | 1.91    |
|      | 半導体・半導体製造装置            | 8.90    |
|      | 小計                     | 95.77   |
| 投資証券 | —                      | 0.08    |
| 合計   |                        | 95.86   |

（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

| 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 2106 | 買建 | 1,216 | アメリカドル | 81,096,763.6 | 8,978,222,698 | 79,891,200 | 8,844,754,752 | 4.17    |

（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。

国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 3月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計            | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-----------------|---------|
| 国債証券                     | 日本   | 127,371,452,230 | 82.21   |
| 地方債証券                    | 日本   | 7,783,885,420   | 5.02    |
| 特殊債券                     | 日本   | 9,498,884,219   | 6.13    |
| 社債券                      | 日本   | 8,397,874,000   | 5.42    |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 1,884,822,858   | 1.22    |
| 純資産総額                    |      | 154,936,918,727 | 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 3年 3月31日現在  
（単位：円）

| 資産の種類  | 建別 | 国／地域 | 時価合計        | 投資比率（％） |
|--------|----|------|-------------|---------|
| 債券先物取引 | 買建 | 日本   | 302,320,000 | 0.20    |

（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 3年 3月31日現在

| 国／地域 | 種類   | 銘柄名           | 数量            | 簿価単価（円） | 簿価金額（円）       | 評価単価（円） | 評価金額（円）       | 利率（％）    | 償還期限（年/月/日） | 投資比率（％） |
|------|------|---------------|---------------|---------|---------------|---------|---------------|----------|-------------|---------|
| 日本   | 国債証券 | 第142回利付国債（5年） | 2,213,000,000 | 100.85  | 2,231,869,200 | 100.84  | 2,231,611,330 | 0.100000 | 2024/12/20  | 1.44    |

|    |      |                |               |        |               |        |               |          |            |      |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|----------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第１４６回利付国債（５年）  | 2,000,000,000 | 100.87 | 2,017,486,000 | 100.92 | 2,018,480,000 | 0.100000 | 2025/12/20 | 1.30 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３７回利付国債（５年）  | 1,900,000,000 | 100.62 | 1,911,941,000 | 100.59 | 1,911,305,000 | 0.100000 | 2023/9/20  | 1.23 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４０回利付国債（５年）  | 1,890,000,000 | 100.75 | 1,904,267,500 | 100.75 | 1,904,345,100 | 0.100000 | 2024/6/20  | 1.23 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３８回利付国債（５年）  | 1,850,000,000 | 100.67 | 1,862,492,000 | 100.66 | 1,862,376,500 | 0.100000 | 2023/12/20 | 1.20 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４３回利付国債（１０年） | 1,750,000,000 | 101.04 | 1,768,231,700 | 100.96 | 1,766,957,500 | 0.100000 | 2026/6/20  | 1.14 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５０回利付国債（１０年） | 1,620,000,000 | 101.03 | 1,636,811,000 | 100.94 | 1,635,260,400 | 0.100000 | 2028/3/20  | 1.06 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３６回利付国債（５年）  | 1,610,000,000 | 100.51 | 1,618,227,600 | 100.53 | 1,618,597,400 | 0.100000 | 2023/6/20  | 1.04 |
| 日本 | 国債証券 | 第４２１回利付国債（２年）  | 1,600,000,000 | 100.43 | 1,606,967,000 | 100.44 | 1,607,072,000 | 0.100000 | 2023/2/1   | 1.04 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４５回利付国債（５年）  | 1,570,000,000 | 101.02 | 1,586,014,000 | 100.94 | 1,584,805,100 | 0.100000 | 2025/9/20  | 1.02 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６１回利付国債（１０年） | 1,580,000,000 | 100.00 | 1,580,038,700 | 100.09 | 1,581,516,800 | 0.100000 | 2030/12/20 | 1.02 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４５回利付国債（１０年） | 1,510,000,000 | 101.11 | 1,526,788,800 | 100.97 | 1,524,737,600 | 0.100000 | 2026/12/20 | 0.98 |
| 日本 | 国債証券 | 第３２５回利付国債（１０年） | 1,500,000,000 | 101.88 | 1,528,305,000 | 101.36 | 1,520,445,000 | 0.800000 | 2022/9/20  | 0.98 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３５回利付国債（５年）  | 1,500,000,000 | 100.63 | 1,509,531,500 | 100.46 | 1,506,945,000 | 0.100000 | 2023/3/20  | 0.97 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４９回利付国債（１０年） | 1,480,000,000 | 101.11 | 1,496,493,300 | 100.94 | 1,493,956,400 | 0.100000 | 2027/12/20 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４１回利付国債（５年）  | 1,420,000,000 | 100.84 | 1,432,065,500 | 100.80 | 1,431,388,400 | 0.100000 | 2024/9/20  | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第３３３回利付国債（１０年） | 1,400,000,000 | 102.45 | 1,434,402,000 | 102.18 | 1,430,646,000 | 0.600000 | 2024/3/20  | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４８回利付国債（１０年） | 1,410,000,000 | 101.14 | 1,426,178,000 | 100.94 | 1,423,268,100 | 0.100000 | 2027/9/20  | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５２回利付国債（１０年） | 1,380,000,000 | 100.97 | 1,393,432,700 | 100.82 | 1,391,343,600 | 0.100000 | 2028/9/20  | 0.90 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５３回利付国債（１０年） | 1,353,000,000 | 101.07 | 1,367,555,000 | 100.77 | 1,363,445,160 | 0.100000 | 2028/12/20 | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第３６０回利付国債（１０年） | 1,340,000,000 | 100.63 | 1,348,510,100 | 100.18 | 1,342,519,200 | 0.100000 | 2030/9/20  | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５９回利付国債（１０年） | 1,310,000,000 | 100.37 | 1,314,864,700 | 100.32 | 1,314,192,000 | 0.100000 | 2030/6/20  | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 第１３２回利付国債（５年）  | 1,300,000,000 | 100.38 | 1,305,058,000 | 100.27 | 1,303,562,000 | 0.100000 | 2022/6/20  | 0.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第３４６回利付国債（１０年） | 1,250,000,000 | 101.13 | 1,264,142,800 | 100.95 | 1,261,975,000 | 0.100000 | 2027/3/20  | 0.81 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５６回利付国債（１０年） | 1,250,000,000 | 100.85 | 1,260,715,600 | 100.54 | 1,256,862,500 | 0.100000 | 2029/9/20  | 0.81 |
| 日本 | 国債証券 | 第３３９回利付国債（１０年） | 1,230,000,000 | 102.38 | 1,259,314,000 | 102.18 | 1,256,850,900 | 0.400000 | 2025/6/20  | 0.81 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４４回利付国債（５年）  | 1,210,000,000 | 100.83 | 1,220,126,700 | 100.91 | 1,221,023,100 | 0.100000 | 2025/6/20  | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第３５４回利付国債（１０年） | 1,210,000,000 | 100.96 | 1,221,666,800 | 100.67 | 1,218,179,600 | 0.100000 | 2029/3/20  | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４２回利付国債（２０年） | 970,000,000   | 119.27 | 1,156,974,600 | 118.79 | 1,152,350,300 | 1.800000 | 2032/12/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第１４７回利付国債（２０年） | 950,000,000   | 117.85 | 1,119,619,000 | 117.29 | 1,114,293,000 | 1.600000 | 2033/12/20 | 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 3年 3月31日現在

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 82.21   |
| 地方債証券 | 5.02    |
| 特殊債券  | 6.13    |
| 社債券   | 5.42    |
| 合計    | 98.78   |

（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 3年 3月31日現在

| 資産の種類  | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額（円）     | 評価金額（円）     | 投資比率（％） |
|--------|-------|---------------|----|----|----|-------------|-------------|---------|
| 債券先物取引 | 大阪取引所 | 長期国債先物２１年０６月限 | 買建 | 2  | 円  | 301,562,200 | 302,320,000 | 0.20    |

（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。

## ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

## 投資状況

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国／地域    | 時価合計            | 投資比率（％） |
|-------|---------|-----------------|---------|
| 国債証券  | アメリカ    | 115,164,912,329 | 44.50   |
|       | フランス    | 27,248,497,785  | 10.53   |
|       | イタリア    | 25,460,855,115  | 9.84    |
|       | ドイツ     | 19,648,474,777  | 7.59    |
|       | イギリス    | 17,668,154,516  | 6.83    |
|       | スペイン    | 15,586,138,615  | 6.02    |
|       | ベルギー    | 6,266,933,635   | 2.42    |
|       | オーストラリア | 6,204,605,576   | 2.40    |
|       | カナダ     | 5,091,030,960   | 1.97    |
|       | オランダ    | 4,968,680,888   | 1.92    |
|       | オーストリア  | 4,093,629,826   | 1.58    |
|       | アイルランド  | 2,269,496,778   | 0.88    |
|       | メキシコ    | 2,012,252,432   | 0.78    |
|       | フィンランド  | 1,736,273,318   | 0.67    |



|                          |        |                 |        |
|--------------------------|--------|-----------------|--------|
|                          | ポーランド  | 1,618,582,920   | 0.63   |
|                          | デンマーク  | 1,232,356,388   | 0.48   |
|                          | マレーシア  | 1,229,125,059   | 0.47   |
|                          | イスラエル  | 1,162,494,270   | 0.45   |
|                          | シンガポール | 1,091,087,734   | 0.42   |
|                          | スウェーデン | 913,053,529     | 0.35   |
|                          | ノルウェー  | 632,931,082     | 0.24   |
|                          | 小計     | 261,299,567,532 | 100.98 |
| コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) | —      | △2,530,624,696  | △0.98  |
| 純資産総額                    |        | 258,768,942,836 | 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。

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 3年 3月31日現在

| 国／<br>地域 | 種類   | 銘柄名                       | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|---------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| アメリカ     | 国債証券 | 2.875 T-NOTE<br>250731    | 11,900,000 | 12,323.40       | 1,466,485,418   | 12,089.01       | 1,438,592,552   | 2.875000  | 2025/7/31       | 0.56            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2 T-NOTE 250815           | 12,150,000 | 11,893.54       | 1,445,065,195   | 11,678.17       | 1,418,898,281   | 2.000000  | 2025/8/15       | 0.55            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.125 T-NOTE<br>250515    | 12,000,000 | 11,922.08       | 1,430,649,975   | 11,732.66       | 1,407,919,828   | 2.125000  | 2025/5/15       | 0.54            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.75 T-NOTE<br>280215     | 11,400,000 | 12,610.56       | 1,437,603,946   | 12,089.87       | 1,378,246,088   | 2.750000  | 2028/2/15       | 0.53            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.25 T-NOTE<br>270815     | 11,300,000 | 12,205.77       | 1,379,252,858   | 11,747.36       | 1,327,452,686   | 2.250000  | 2027/8/15       | 0.51            |
| アメリカ     | 国債証券 | 0.625 T-NOTE<br>300815    | 13,200,000 | 10,673.13       | 1,408,853,944   | 10,045.20       | 1,325,966,751   | 0.625000  | 2030/8/15       | 0.51            |
| アメリカ     | 国債証券 | 3.125 T-NOTE<br>281115    | 10,600,000 | 12,999.77       | 1,377,976,233   | 12,398.65       | 1,314,257,438   | 3.125000  | 2028/11/15      | 0.51            |
| アメリカ     | 国債証券 | 3 T-NOTE 250930           | 10,500,000 | 12,421.66       | 1,304,274,510   | 12,168.58       | 1,277,701,515   | 3.000000  | 2025/9/30       | 0.49            |
| フランス     | 国債証券 | 2.5 O.A.T 300525          | 7,800,000  | 16,479.90       | 1,285,432,293   | 16,092.29       | 1,255,198,711   | 2.500000  | 2030/5/25       | 0.49            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.375 T-NOTE<br>270515    | 10,500,000 | 12,280.16       | 1,289,416,882   | 11,846.83       | 1,243,917,667   | 2.375000  | 2027/5/15       | 0.48            |
| フランス     | 国債証券 | 0.5 O.A.T 250525          | 9,100,000  | 13,595.28       | 1,237,171,254   | 13,556.24       | 1,233,618,013   | 0.500000  | 2025/5/25       | 0.48            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2 T-NOTE 250215           | 10,500,000 | 11,833.86       | 1,242,555,414   | 11,672.12       | 1,225,572,673   | 2.000000  | 2025/2/15       | 0.47            |
| イタリア     | 国債証券 | 5.25 ITALY GOVT<br>291101 | 6,680,000  | 18,232.43       | 1,217,926,651   | 18,159.13       | 1,213,030,340   | 5.250000  | 2029/11/1       | 0.47            |
| フランス     | 国債証券 | 5.5 O.A.T 290425          | 6,340,000  | 19,496.72       | 1,236,092,517   | 19,046.16       | 1,207,526,801   | 5.500000  | 2029/4/25       | 0.47            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.875 T-NOTE<br>280815    | 9,850,000  | 12,745.35       | 1,255,417,631   | 12,193.66       | 1,201,076,355   | 2.875000  | 2028/8/15       | 0.46            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.25 T-NOTE<br>271115     | 9,900,000  | 12,113.83       | 1,199,269,397   | 11,732.66       | 1,161,533,858   | 2.250000  | 2027/11/15      | 0.45            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.875 T-NOTE<br>280515    | 9,400,000  | 12,735.10       | 1,197,100,310   | 12,185.88       | 1,145,473,123   | 2.875000  | 2028/5/15       | 0.44            |
| アメリカ     | 国債証券 | 1.75 T-NOTE<br>230515     | 10,000,000 | 11,481.83       | 1,148,183,789   | 11,440.32       | 1,144,032,164   | 1.750000  | 2023/5/15       | 0.44            |

|      |      |                     |            |           |               |           |               |          |            |      |
|------|------|---------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|----------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | 2 T-NOTE 221130     | 10,000,000 | 11,455.89 | 1,145,589,023 | 11,416.96 | 1,141,696,875 | 2.000000 | 2022/11/30 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.875 T-NOTE 220930 | 10,000,000 | 11,397.94 | 1,139,794,047 | 11,364.20 | 1,136,420,852 | 1.875000 | 2022/9/30  | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.25 T-NOTE 251115  | 9,500,000  | 12,054.41 | 1,145,169,535 | 11,802.72 | 1,121,258,770 | 2.250000 | 2025/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.25 T-NOTE 241115  | 9,500,000  | 11,904.78 | 1,130,954,545 | 11,756.01 | 1,116,821,722 | 2.250000 | 2024/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.375 T-NOTE 240815 | 9,200,000  | 11,910.83 | 1,095,797,201 | 11,793.20 | 1,084,975,298 | 2.375000 | 2024/8/15  | 0.42 |
| フランス | 国債証券 | 1.75 O.A.T 230525   | 7,800,000  | 13,722.36 | 1,070,344,766 | 13,657.76 | 1,065,305,567 | 1.750000 | 2023/5/25  | 0.41 |
| フランス | 国債証券 | 4.5 O.A.T 410425    | 4,610,000  | 24,400.60 | 1,124,867,717 | 22,935.66 | 1,057,333,926 | 4.500000 | 2041/4/25  | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.5 T-NOTE 230815   | 9,050,000  | 11,737.85 | 1,062,275,856 | 11,677.31 | 1,056,796,576 | 2.500000 | 2023/8/15  | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | 2.625 T-NOTE 290215 | 8,800,000  | 12,600.18 | 1,108,816,005 | 11,988.68 | 1,055,004,026 | 2.625000 | 2029/2/15  | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.625 T-NOTE 260515 | 9,200,000  | 11,738.71 | 1,079,962,211 | 11,440.32 | 1,052,509,591 | 1.625000 | 2026/5/15  | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | 0.125 T-NOTE 230815 | 9,500,000  | 11,064.51 | 1,051,128,742 | 11,048.07 | 1,049,567,558 | 0.125000 | 2023/8/15  | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | 1.75 T-NOTE 240630  | 9,000,000  | 11,650.49 | 1,048,544,789 | 11,549.30 | 1,039,437,161 | 1.750000 | 2024/6/30  | 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 3年 3月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 100.98  |
| 合計   | 100.98  |

（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。

ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計          | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 国債証券                     | アメリカ | 4,799,441,743 | 101.48  |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | △70,126,255   | △1.48   |

|       |               |        |
|-------|---------------|--------|
| 純資産総額 | 4,729,315,488 | 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 3年 3月31日現在

| 国／<br>地域 | 種類   | 銘柄名                        | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|----------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| アメリカ     | 国債証券 | 6 TURKEY 270325            | 1,400,000 | 10,655.17       | 149,172,425     | 10,550.80       | 147,711,297     | 6.000000  | 2027/3/25       | 3.12            |
| アメリカ     | 国債証券 | 7.375 TURKEY<br>250205     | 990,000   | 11,499.44       | 113,844,532     | 11,380.10       | 112,663,013     | 7.375000  | 2025/2/5        | 2.38            |
| アメリカ     | 国債証券 | 5.625 RUSSIA<br>420404     | 800,000   | 13,530.97       | 108,247,811     | 13,483.59       | 107,868,739     | 5.625000  | 2042/4/4        | 2.28            |
| アメリカ     | 国債証券 | 6.75 MEXICO 340927         | 720,000   | 14,382.00       | 103,550,428     | 14,204.86       | 102,275,049     | 6.750000  | 2034/9/27       | 2.16            |
| アメリカ     | 国債証券 | FRN ARGENTINA<br>300709    | 2,750,000 | 3,812.18        | 104,835,173     | 3,697.71        | 101,687,135     | 0.125000  | 2030/7/9        | 2.15            |
| アメリカ     | 国債証券 | 4.75 RUSSIA 260527         | 800,000   | 12,465.51       | 99,724,113      | 12,411.60       | 99,292,876      | 4.750000  | 2026/5/27       | 2.10            |
| アメリカ     | 国債証券 | 8.25 BRAZIL 340120         | 670,000   | 14,781.88       | 99,038,653      | 14,642.28       | 98,103,297      | 8.250000  | 2034/1/20       | 2.07            |
| アメリカ     | 国債証券 | 4.5 COLOMBIA<br>260128     | 800,000   | 12,204.17       | 97,633,377      | 12,148.81       | 97,190,537      | 4.500000  | 2026/1/28       | 2.06            |
| アメリカ     | 国債証券 | 9.5 PHILIPPINE<br>300202   | 520,000   | 17,323.15       | 90,080,404      | 17,241.18       | 89,654,148      | 9.500000  | 2030/2/2        | 1.90            |
| アメリカ     | 国債証券 | 5.75 MEXICO 101012         | 690,000   | 12,519.17       | 86,382,280      | 12,265.06       | 84,628,932      | 5.750000  | 2110/10/12      | 1.79            |
| アメリカ     | 国債証券 | 5.25 RUSSIA 470623         | 600,000   | 13,129.81       | 78,778,911      | 13,080.38       | 78,482,319      | 5.250000  | 2047/6/23       | 1.66            |
| アメリカ     | 国債証券 | 9.375 PANAMA<br>290401     | 480,000   | 16,261.30       | 78,054,271      | 16,198.53       | 77,752,962      | 9.375000  | 2029/4/1        | 1.64            |
| アメリカ     | 国債証券 | 4.35 INDONESIA<br>270108   | 600,000   | 12,478.89       | 74,873,355      | 12,441.70       | 74,650,203      | 4.350000  | 2027/1/8        | 1.58            |
| アメリカ     | 国債証券 | 4.5 MEXICO 290422          | 600,000   | 12,325.39       | 73,952,397      | 12,288.75       | 73,732,527      | 4.500000  | 2029/4/22       | 1.56            |
| アメリカ     | 国債証券 | 4.375 RUSSIA<br>290321     | 600,000   | 12,205.25       | 73,231,543      | 12,113.71       | 72,682,266      | 4.375000  | 2029/3/21       | 1.54            |
| アメリカ     | 国債証券 | 3.75 MEXICO 280111         | 600,000   | 11,903.37       | 71,420,239      | 11,856.21       | 71,137,264      | 3.750000  | 2028/1/11       | 1.50            |
| アメリカ     | 国債証券 | FRN ARGENTINA<br>350709    | 2,150,000 | 3,368.35        | 72,419,562      | 3,288.19        | 70,696,251      | 0.125000  | 2035/7/9        | 1.49            |
| アメリカ     | 国債証券 | 4.625 BRAZIL<br>280113     | 600,000   | 11,784.80       | 70,708,816      | 11,683.28       | 70,099,690      | 4.625000  | 2028/1/13       | 1.48            |
| アメリカ     | 国債証券 | 3.7 INDONESIA<br>491030    | 600,000   | 11,389.94       | 68,339,687      | 11,238.82       | 67,432,979      | 3.700000  | 2049/10/30      | 1.43            |
| アメリカ     | 国債証券 | 6.125 COLOMBIA<br>410118   | 500,000   | 13,412.51       | 67,062,583      | 13,014.29       | 65,071,464      | 6.125000  | 2041/1/18       | 1.38            |
| アメリカ     | 国債証券 | 3.125 COLOMBIA<br>310415   | 600,000   | 10,957.52       | 65,745,134      | 10,826.10       | 64,956,657      | 3.125000  | 2031/4/15       | 1.37            |
| アメリカ     | 国債証券 | 6.375 PHILIPPINE<br>341023 | 400,000   | 15,266.88       | 61,067,546      | 15,191.18       | 60,764,734      | 6.375000  | 2034/10/23      | 1.28            |
| アメリカ     | 国債証券 | 5.35 INDONESIA<br>490211   | 400,000   | 14,004.48       | 56,017,931      | 13,812.67       | 55,250,711      | 5.350000  | 2049/2/11       | 1.17            |
| アメリカ     | 国債証券 | 5.25 INDONESIA<br>420117   | 400,000   | 13,393.45       | 53,573,826      | 13,279.48       | 53,117,936      | 5.250000  | 2042/1/17       | 1.12            |
| アメリカ     | 国債証券 | 5.1 RUSSIA 350328          | 400,000   | 12,885.14       | 51,540,597      | 12,729.40       | 50,917,610      | 5.100000  | 2035/3/28       | 1.08            |
| アメリカ     | 国債証券 | 6.7 PANAMA 360126          | 340,000   | 15,004.58       | 51,015,577      | 14,882.80       | 50,601,522      | 6.700000  | 2036/1/26       | 1.07            |
| アメリカ     | 国債証券 | 2.844 PERU 300620          | 450,000   | 11,331.83       | 50,993,248      | 11,235.95       | 50,561,811      | 2.844000  | 2030/6/20       | 1.07            |

|      |      |                        |         |           |            |           |            |          |           |      |
|------|------|------------------------|---------|-----------|------------|-----------|------------|----------|-----------|------|
| アメリカ | 国債証券 | 6.75 TURKEY 400530     | 500,000 | 10,220.50 | 51,102,518 | 10,043.83 | 50,219,163 | 6.750000 | 2040/5/30 | 1.06 |
| アメリカ | 国債証券 | 5.375 HUNGARY 240325   | 400,000 | 12,550.86 | 50,203,442 | 12,546.76 | 50,187,057 | 5.375000 | 2024/3/25 | 1.06 |
| アメリカ | 国債証券 | 3.75 PHILIPPINE 290114 | 400,000 | 12,330.67 | 49,322,688 | 12,300.14 | 49,200,564 | 3.750000 | 2029/1/14 | 1.04 |

（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 3年 3月31日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 101.48  |
| 合計   | 101.48  |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

《参考情報》

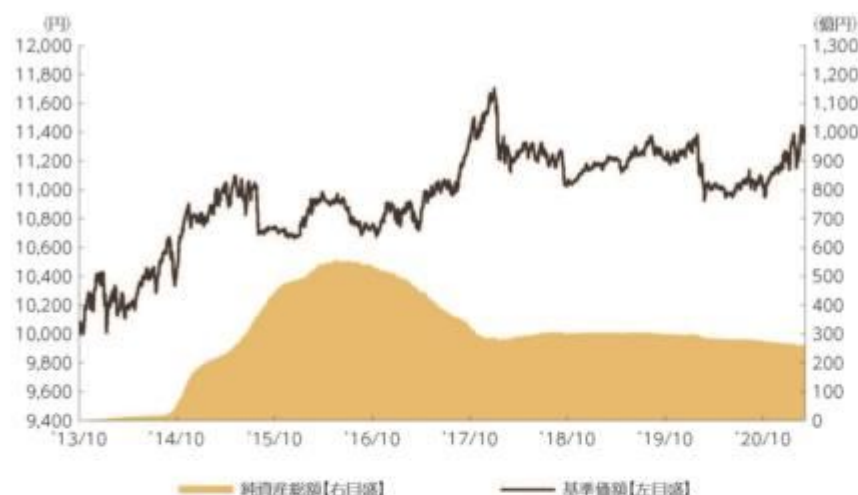


## 運用実績

2021年3月31日現在

### 株式抑制型

#### ■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2021年3月31日



#### ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,401円 |
| 純資産総額 | 259.1億円 |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

#### ■分配の推移

|          |    |
|----------|----|
| 2021年 3月 | 0円 |
| 2020年 3月 | 0円 |
| 2019年 3月 | 0円 |
| 2018年 3月 | 0円 |
| 2017年 3月 | 0円 |
| 2016年 3月 | 0円 |
| 設定来累計    | 0円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

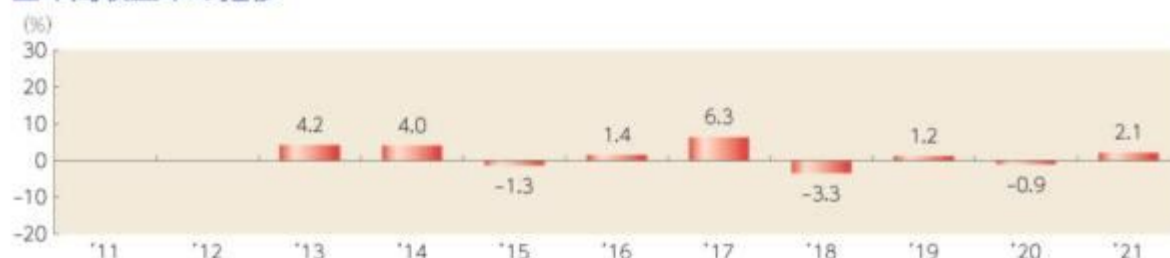
#### ■主要な資産の状況

| 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              | 比率   |
|--------------------|--------|--------------|-------|-----------------|----|--------------------|------|
| 国内株式               | 17.0%  | 1 円          | 81.9% | APPLE INC       | 株式 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 0.7% |
| 国内債券               | 35.5%  | 2 アメリカドル     | 13.0% | MICROSOFT CORP. | 株式 | ソフトウェア・サービス        | 0.6% |
| 外国株式               | 17.7%  | 3 ユーロ        | 2.0%  | トヨタ自動車          | 株式 | 輸送用機器              | 0.6% |
| 外国債券               | 25.1%  | 4 イギリスポンド    | 0.9%  | AMAZON.COM INC  | 株式 | 小売                 | 0.5% |
|                    |        | 5 カナダドル      | 0.6%  | ソフトバンクグループ      | 株式 | 情報・通信業             | 0.5% |
|                    |        | 6 スイスフラン     | 0.6%  | 第142回利付国債(5年)   | 債券 | 国債                 | 0.5% |
|                    |        | 7 オーストラリアドル  | 0.4%  | 第146回利付国債(5年)   | 債券 | 国債                 | 0.5% |
|                    |        | 8 スウェーデンクローネ | 0.2%  | 第137回利付国債(5年)   | 債券 | 国債                 | 0.4% |
|                    |        | 9 香港ドル       | 0.2%  | 第140回利付国債(5年)   | 債券 | 国債                 | 0.4% |
|                    |        | 10 デンマーククローネ | 0.1%  | 第138回利付国債(5年)   | 債券 | 国債                 | 0.4% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 4.7%   |              |       |                 |    |                    |      |
| 合計                 | 100.0% |              |       |                 |    |                    |      |

| その他資産の状況      | 比率   |
|---------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建) | 0.8% |
| 債券先物取引 (買建)   | 0.1% |

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

#### ■年間収益率の推移

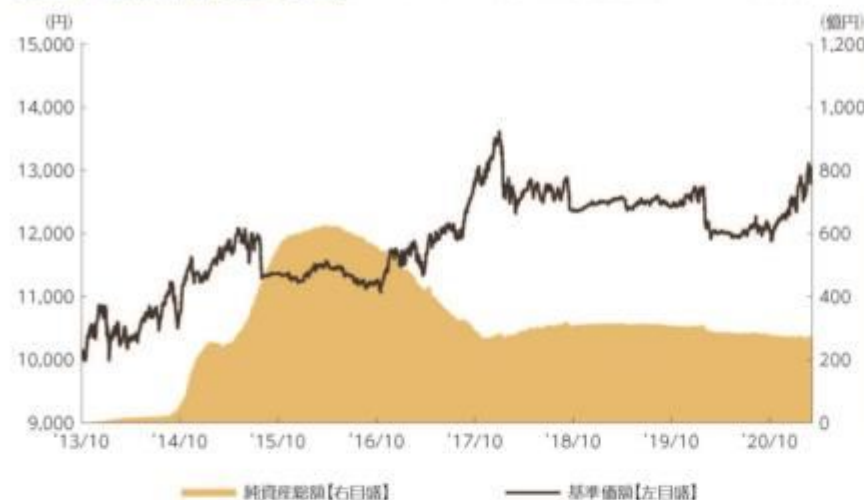


- 収益率は基準価額で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2021年は年初から3月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

## 株式重視型

## ■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2021年3月31日



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

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 13,012円 |
| 純資産総額 | 270.6億円 |

●純資産総額は表示桁未満切捨て

## ■分配の推移

|          |    |
|----------|----|
| 2021年 3月 | 0円 |
| 2020年 3月 | 0円 |
| 2019年 3月 | 0円 |
| 2018年 3月 | 0円 |
| 2017年 3月 | 0円 |
| 2016年 3月 | 0円 |
| 設定来累計    | 0円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

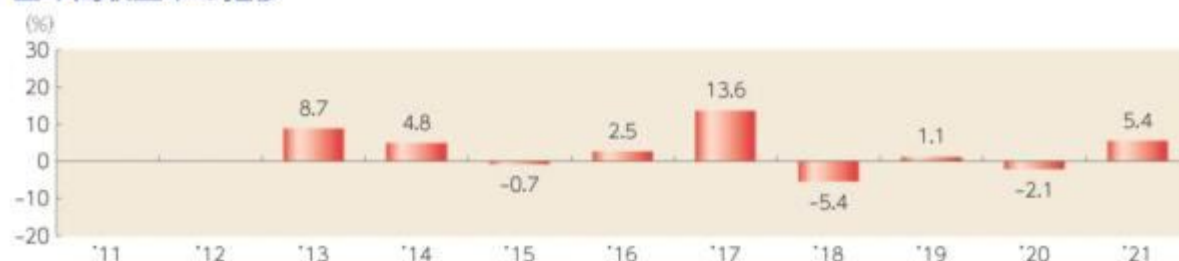
## ■主要な資産の状況

| 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              | 比率   |
|--------------------|--------|--------------|-------|---------------------|----|--------------------|------|
| 国内株式               | 33.1%  | 1 円          | 64.3% | APPLE INC           | 株式 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1.4% |
| 国内債券               | 2.9%   | 2 アメリカドル     | 25.6% | MICROSOFT CORP      | 株式 | ソフトウェア・サービス        | 1.2% |
| 外国株式               | 34.9%  | 3 ユーロ        | 3.8%  | トヨタ自動車              | 株式 | 輸送用機器              | 1.1% |
| 外国債券               | 24.7%  | 4 イギリスポンド    | 1.7%  | AMAZON.COM INC      | 株式 | 小売                 | 0.9% |
|                    |        | 5 カナダドル      | 1.3%  | ソフトバンクグループ          | 株式 | 情報・通信業             | 0.9% |
|                    |        | 6 スイスフラン     | 1.1%  | 2,875 T-NOTE 250731 | 債券 | 国債                 | 0.1% |
|                    |        | 7 オーストラリアドル  | 0.8%  | 2 T-NOTE 250815     | 債券 | 国債                 | 0.1% |
|                    |        | 8 スウェーデンクローネ | 0.4%  | 2,125 T-NOTE 250515 | 債券 | 国債                 | 0.1% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 4.4%   | 9 香港ドル       | 0.4%  | 2,75 T-NOTE 280215  | 債券 | 国債                 | 0.1% |
| 合計                 | 100.0% | 10 デンマーククローネ | 0.3%  | 2,25 T-NOTE 270815  | 債券 | 国債                 | 0.1% |

| その他資産の状況     | 比率   |
|--------------|------|
| 株債指数先物取引（買建） | 1.6% |
| 債券先物取引（買建）   | 0.0% |

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

## ■年間収益率の推移



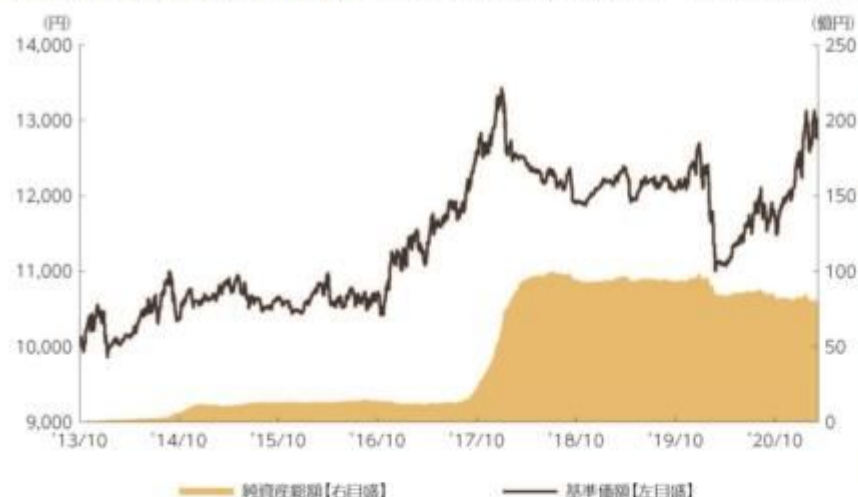
- 収益率は基準価額で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2021年は年初から3月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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



## 新興国投資型

## ■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2021年3月31日



## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 13,019円 |
| 純資産総額 | 79.8億円  |

●純資産総額は表示桁末満切捨て

## ■分配の推移

|          |    |
|----------|----|
| 2021年 3月 | 0円 |
| 2020年 3月 | 0円 |
| 2019年 3月 | 0円 |
| 2018年 3月 | 0円 |
| 2017年 3月 | 0円 |
| 2016年 3月 | 0円 |
| 設定来累計    | 0円 |

●分配金は1万口当たり、税引前

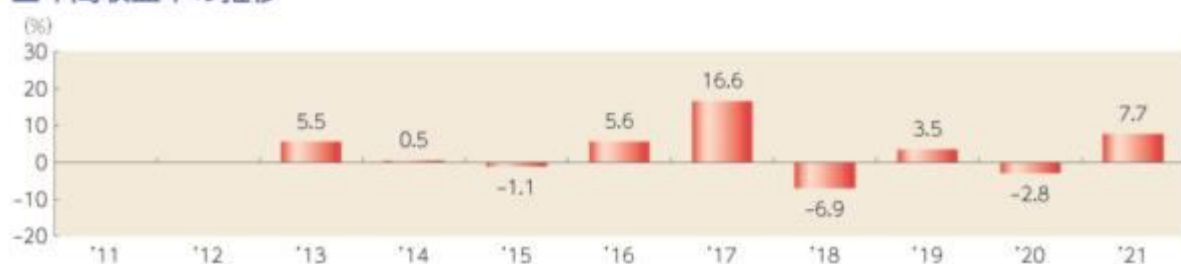
## ■主要な資産の状況

| 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              | 比率   |
|--------------------|--------|------------|-------|-------------------------------|----|--------------------|------|
| 国内株式               | 27.8%  | 1 円        | 44.1% | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC  | 株式 | 半導体・半導体製造装置        | 1.7% |
| 国内債券               | 3.6%   | 2 アメリカドル   | 24.9% | TENCENT HOLDINGS LTD          | 株式 | メディア・娯楽            | 1.5% |
| 外国株式               | 53.9%  | 3 香港ドル     | 6.2%  | ALIBABA GROUP HOLDINGS SP ADR | 株式 | 小売                 | 1.5% |
| 外国債券               | 7.2%   | 4 ニュー台湾ドル  | 3.8%  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD    | 株式 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1.2% |
|                    |        | 5 韓国ウォン    | 3.7%  | APPLE INC                     | 株式 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1.1% |
|                    |        | 6 ユーロ      | 3.0%  | 6 TURKEY 270325               | 債券 | 国債                 | 0.1% |
|                    |        | 7 インドルピー   | 2.7%  | 7.375 TURKEY 250205           | 債券 | 国債                 | 0.1% |
|                    |        | 8 イギリスポンド  | 1.3%  | 5.625 RUSSIA 420404           | 債券 | 国債                 | 0.1% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 7.5%   | 9 中国元      | 1.2%  | 6.75 MEXICO 340927            | 債券 | 国債                 | 0.1% |
| 合計                 | 100.0% | 10 ブラジルレアル | 1.2%  | FRN ARGENTINA 300709          | 債券 | 国債                 | 0.1% |

| その他資産の状況     | 比率   |
|--------------|------|
| 株価指数先物取引（買建） | 2.5% |
| 債券先物取引（買建）   | 0.0% |

●各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)  
●投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示  
●コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。  
●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



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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

### ①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みできません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

### ②申込単位

販売会社が定める単位

### ③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

### ④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### ⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

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/>

### ⑥申込手数料

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

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、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

### ⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）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の販売会社により異なる場合があります。

### ⑧申込受付時間

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

### ⑨取得申込みの受付の中止および取消し

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資



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

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### ①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

### ②解約単位

販売会社が定める単位

### ③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

### ④信託財産留保額

ありません。

### ⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### ⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ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/>

### ⑦支払開始日

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

### ⑧解約請求受付時間

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

### ⑨解約請求受付の中止および取消し

「三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）／（株式重視型）」

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

「三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）」

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

その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### ①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

##### ・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

##### ・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

##### ・公社債等

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

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

##### ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

##### ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

##### ・外貨建資産

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

##### ・外国為替予約取引

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

##### ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

## ②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

## ③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

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/>

## （２）【保管】

該当事項はありません。

## （３）【信託期間】

2023年3月24日まで（2013年10月25日設定）

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

## （４）【計算期間】

毎年3月26日から翌年3月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

## （５）【その他】

### ①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

### ②信託約款の変更等

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

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

### ③ファンドの償還等に関する開示方法

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

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

### ④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

### ⑤関係法人との契約の更改

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

### ⑥運用報告書

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

### ⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

### ⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

### ⑨信託事務の再信託

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

### ⑩公告

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

す。

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### （１）収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

###### ①分配金受取コース（一般コース）

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

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

###### ②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

##### （２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に应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2年3月26日から令和3年3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】

## 【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第7期<br>[ 令和 2年 3月25日現在 ] | 第8期<br>[ 令和 3年 3月25日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 6,994,454,188            | 748,219,860              |
| 親投資信託受益証券       | 21,725,603,351           | 25,132,876,726           |
| 未収入金            | -                        | 242,000,000              |
| 流動資産合計          | 28,720,057,539           | 26,123,096,586           |
| 資産合計            | 28,720,057,539           | 26,123,096,586           |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 51,299,910               | 75,424,509               |
| 未払受託者報酬         | 8,091,685                | 7,322,039                |
| 未払委託者報酬         | 202,292,090              | 183,050,848              |
| 未払利息            | 3,556                    | 129                      |
| その他未払費用         | 582,544                  | 527,126                  |
| 流動負債合計          | 262,269,785              | 266,324,651              |
| 負債合計            | 262,269,785              | 266,324,651              |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 25,834,610,099           | 22,786,747,268           |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,623,177,655            | 3,070,024,667            |
| （分配準備積立金）       | 638,448,025              | 854,402,039              |
| 元本等合計           | 28,457,787,754           | 25,856,771,935           |
| 純資産合計           | 28,457,787,754           | 25,856,771,935           |
| 負債純資産合計         | 28,720,057,539           | 26,123,096,586           |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日 | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3月25日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | 15,272                                | 31,108                                |
| 有価証券売買等損益                                 | △87,937,293                           | 1,192,175,533                         |
| 営業収益合計                                    | △87,922,021                           | 1,192,206,641                         |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 支払利息                                      | 1,842,864                             | 974,120                               |
| 受託者報酬                                     | 16,315,715                            | 15,128,033                            |
| 委託者報酬                                     | 407,892,721                           | 378,200,467                           |
| その他費用                                     | 1,184,043                             | 1,089,092                             |
| 営業費用合計                                    | 427,235,343                           | 395,391,712                           |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | △515,157,364                          | 796,814,929                           |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | △515,157,364                          | 796,814,929                           |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | △515,157,364                          | 796,814,929                           |
| 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（△） | 6,502,618                             | 43,277,327                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 3,291,573,179                         | 2,623,177,655                         |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 247,090,621                           | 56,232,457                            |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 247,090,621                           | 56,232,457                            |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 393,826,163                           | 362,923,047                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 393,826,163                           | 362,923,047                           |
| 分配金                                       | -                                     | -                                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 2,623,177,655                         | 3,070,024,667                         |



（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7期<br>[令和 2年 3月25日現在] | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額  | 27,086,162,283円        | 25,834,610,099円        |
| 期中追加設定元本額 | 1,987,264,985円         | 525,345,517円           |
| 期中一部解約元本額 | 3,238,817,169円         | 3,573,208,348円         |
| 2. 受益権の総数 | 25,834,610,099口        | 22,786,747,268口        |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                       |                 |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|--|--------------|---|----|---------------------------|---|----|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|-----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|--------------|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|-----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 第7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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>—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>1,984,729,630円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>638,448,025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>2,623,177,655円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>25,834,610,099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>1,015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 | —円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | —円 | 収益調整金額 | C | 1,984,729,630円 | 分配準備積立金額 | D | 638,448,025円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 2,623,177,655円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 25,834,610,099口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 1,015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>191,511,988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>111,491,944円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>2,215,622,628円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>551,398,107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>3,070,024,667円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>22,786,747,268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>1,347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 | 191,511,988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 | 111,491,944円 | 収益調整金額 | C | 2,215,622,628円 | 分配準備積立金額 | D | 551,398,107円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 3,070,024,667円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 22,786,747,268口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 1,347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                                     | —円              |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | B                                     | —円              |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | C                                     | 1,984,729,630円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | D                                     | 638,448,025円    |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | E=A+B+C+D                             | 2,623,177,655円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | F                                     | 25,834,610,099口 |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | G=E/F*10,000                          | 1,015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                                     | 191,511,988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                                     | 111,491,944円    |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | C                                     | 2,215,622,628円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | D                                     | 551,398,107円    |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | E=A+B+C+D                             | 3,070,024,667円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | F                                     | 22,786,747,268口 |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | G=E/F*10,000                          | 1,347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7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日                                                                                                                                                                    | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第7期<br>[令和 2年 3月25日現在]                                                                                                                                                                                              | 第8期<br>[令和 3年 3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           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |

| 区分                        | 第7期<br>[令和 2年 3月25日現在]                                                                                                | 第8期<br>[令和 3年 3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7期<br>[令和 2年 3月25日現在]   | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 399,669,410              | 640,761,193              |
| 合計        | 399,669,410              | 640,761,193              |

## （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7期<br>[令和 2年 3月25日現在] | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1015円                | 1.1347円                |
| (1万口当たり純資産額) | (11,015円)              | (11,347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<br>証券 | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド | 4,742,837,220  | 6,491,521,303  |    |
|               | 国内債券インデックスマザーファンド     | 9,701,405,852  | 9,484,094,360  |    |
|               | T O P I Xマザーファンド      | 2,076,019,643  | 4,580,944,944  |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド     | 1,232,246,249  | 4,576,316,119  |    |
| 合計            |                       | 17,752,508,964 | 25,132,876,726 |    |

**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。

## 【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第7期<br>[ 令和 2年 3月25日現在 ] | 第8期<br>[ 令和 3年 3月25日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 7,107,586,033            | 871,436,797              |
| 親投資信託受益証券       | 21,953,713,000           | 26,257,241,049           |
| 流動資産合計          | 29,061,299,033           | 27,128,677,846           |
| 資産合計            | 29,061,299,033           | 27,128,677,846           |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 94,113,759               | 78,539,091               |
| 未払受託者報酬         | 8,300,887                | 7,480,800                |
| 未払委託者報酬         | 207,522,311              | 187,019,970              |
| 未払利息            | 3,614                    | 151                      |
| その他未払費用         | 597,608                  | 538,554                  |
| 流動負債合計          | 310,538,179              | 273,578,566              |
| 負債合計            | 310,538,179              | 273,578,566              |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 23,938,102,845           | 20,879,295,495           |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 4,812,658,009            | 5,975,803,785            |
| （分配準備積立金）       | 1,217,743,325            | 1,742,612,538            |
| 元本等合計           | 28,750,760,854           | 26,855,099,280           |
| 純資産合計           | 28,750,760,854           | 26,855,099,280           |
| 負債純資産合計         | 29,061,299,033           | 27,128,677,846           |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日 | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3月25日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | 13,039                                | 25,621                                |
| 有価証券売買等損益                                 | △836,706,483                          | 2,281,448,581                         |
| 営業収益合計                                    | △836,693,444                          | 2,281,474,202                         |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 支払利息                                      | 1,389,890                             | 864,366                               |
| 受託者報酬                                     | 16,782,563                            | 15,378,871                            |
| 委託者報酬                                     | 419,564,131                           | 384,471,694                           |
| その他費用                                     | 1,212,141                             | 1,107,151                             |
| 営業費用合計                                    | 438,948,725                           | 401,822,082                           |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | △1,275,642,169                        | 1,879,652,120                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | △1,275,642,169                        | 1,879,652,120                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | △1,275,642,169                        | 1,879,652,120                         |
| 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（△） | △21,748,835                           | 106,080,466                           |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 6,355,285,764                         | 4,812,658,009                         |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 594,008,328                           | 89,953,513                            |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 594,008,328                           | 89,953,513                            |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 882,742,749                           | 700,379,391                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 882,742,749                           | 700,379,391                           |
| 分配金                                       | -                                     | -                                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 4,812,658,009                         | 5,975,803,785                         |

（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7期<br>[令和 2年 3月25日現在] | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| １．期首元本額   | 25,081,973,518円        | 23,938,102,845円        |
| 期中追加設定元本額 | 2,340,829,162円         | 424,139,994円           |
| 期中一部解約元本額 | 3,484,699,835円         | 3,482,947,344円         |
| ２．受益権の総数  | 23,938,102,845口        | 20,879,295,495口        |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                       |                 |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|--|--------------|---|----|---------------------------|---|----|--------|---|----------------|----------|---|----------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|-----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|--------------|--------|---|----------------|----------|---|----------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|-----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 第7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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>—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>3,594,914,684円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,217,743,325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>4,812,658,009円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>23,938,102,845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>2,010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 | —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 | 3,594,914,684円 | 分配準備積立金額 | D | 1,217,743,325円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 4,812,658,009円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 23,938,102,845口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 2,010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>257,240,773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>442,488,013円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>4,233,191,247円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,042,883,752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>5,975,803,785円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>20,879,295,495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>2,862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 | 257,240,773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 | 442,488,013円 | 収益調整金額 | C | 4,233,191,247円 | 分配準備積立金額 | D | 1,042,883,752円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 5,975,803,785円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 20,879,295,495口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 2,862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                                     | —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                                     | 3,594,914,684円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                     | 1,217,743,325円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                             | 4,812,658,009円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                     | 23,938,102,845口 |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | G=E/F*10,000                          | 2,010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                                     | 257,240,773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                                     | 442,488,013円    |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | C                                     | 4,233,191,247円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | D                                     | 1,042,883,752円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | E=A+B+C+D                             | 5,975,803,785円  |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | F                                     | 20,879,295,495口 |  |              |   |    |                           |   |    |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |  |  |              |   |              |                           |   |              |        |   |                |          |   |                |               |           |                |              |   |                 |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | G=E/F*10,000                          | 2,862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7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日                                                                                                                                                                    | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第7期<br>[令和 2年 3月25日現在]                                                                                                                                                                                              | 第8期<br>[令和 3年 3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           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |



| 区分                        | 第7期<br>[令和 2年 3月25日現在]                                                                                                | 第8期<br>[令和 3年 3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7期<br>[令和 2年 3月25日現在]   | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | 248,189,219              | 1,455,944,647            |
| 合計        | 248,189,219              | 1,455,944,647            |

## （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7期<br>[令和 2年 3月25日現在] | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.2010円                | 1.2862円                |
| (1万口当たり純資産額) | (12,010円)              | (12,862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<br>証券 | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド | 4,775,290,234  | 6,535,939,743  |    |
|               | ＴＯＰＩＸマザーファンド          | 4,824,953,681  | 10,646,742,792 |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド     | 2,443,469,900  | 9,074,558,514  |    |
| 合 計           |                       | 12,043,713,815 | 26,257,241,049 |    |

## 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。

## 【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第7期<br>[ 令和 2年 3月25日現在 ] | 第8期<br>[ 令和 3年 3月25日現在 ] |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部            |                          |                          |
| 流動資産            |                          |                          |
| コール・ローン         | 1,610,061,428            | 187,778,657              |
| 親投資信託受益証券       | 5,635,251,282            | 7,527,182,176            |
| 未収入金            | 1,251,604,607            | 235,000,000              |
| 流動資産合計          | 8,496,917,317            | 7,949,960,833            |
| 資産合計            | 8,496,917,317            | 7,949,960,833            |
| 負債の部            |                          |                          |
| 流動負債            |                          |                          |
| 未払解約金           | 13,176,623               | 49,302,277               |
| 未払受託者報酬         | 2,552,756                | 2,239,869                |
| 未払委託者報酬         | 63,818,921               | 55,996,660               |
| 未払利息            | 818                      | 32                       |
| その他未払費用         | 183,738                  | 161,212                  |
| 流動負債合計          | 79,732,856               | 107,700,050              |
| 負債合計            | 79,732,856               | 107,700,050              |
| 純資産の部           |                          |                          |
| 元本等             |                          |                          |
| 元本              | 7,583,620,416            | 6,142,201,858            |
| 剰余金             |                          |                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 833,564,045              | 1,700,058,925            |
| （分配準備積立金）       | 212,699,900              | 279,822,982              |
| 元本等合計           | 8,417,184,461            | 7,842,260,783            |
| 純資産合計           | 8,417,184,461            | 7,842,260,783            |
| 負債純資産合計         | 8,496,917,317            | 7,949,960,833            |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日 | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3月25日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | 804                                   | 5,703                                 |
| 有価証券売買等損益                                 | △700,997,789                          | 1,291,857,522                         |
| 営業収益合計                                    | △700,996,985                          | 1,291,863,225                         |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 支払利息                                      | 110,186                               | 113,952                               |
| 受託者報酬                                     | 5,120,654                             | 4,603,645                             |
| 委託者報酬                                     | 128,016,261                           | 115,090,938                           |
| その他費用                                     | 369,002                               | 331,339                               |
| 営業費用合計                                    | 133,616,103                           | 120,139,874                           |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | △834,613,088                          | 1,171,723,351                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | △834,613,088                          | 1,171,723,351                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | △834,613,088                          | 1,171,723,351                         |
| 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（△） | △6,629,875                            | 154,844,650                           |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 1,698,266,750                         | 833,564,045                           |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 140,167,019                           | 19,545,531                            |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 140,167,019                           | 19,545,531                            |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 176,886,511                           | 169,929,352                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 176,886,511                           | 169,929,352                           |
| 分配金                                       | -                                     | -                                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 833,564,045                           | 1,700,058,925                         |

（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7期<br>[令和 2年 3月25日現在] | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在] |
|-----------|------------------------|------------------------|
| １．期首元本額   | 7,773,283,007円         | 7,583,620,416円         |
| 期中追加設定元本額 | 619,203,622円           | 97,832,324円            |
| 期中一部解約元本額 | 808,866,213円           | 1,539,250,882円         |
| ２．受益権の総数  | 7,583,620,416口         | 6,142,201,858口         |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                       |                |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------------|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|----|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|--------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|--------------|---------------------------|---|----|--------|---|----------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|---------------|--------------|--------|------------|---|----|---------|--------------|----|
| 第7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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>59,714,611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>625,465,580円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>152,985,289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>838,165,480円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>7,583,620,416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>1,105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 | 59,714,611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 | 625,465,580円 | 分配準備積立金額 | D | 152,985,289円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 838,165,480円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 7,583,620,416口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 1,105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>109,948,862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>1,420,235,943円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>169,874,120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>1,700,058,925円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>6,142,201,858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>2,767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 | 109,948,862円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | －円 | 収益調整金額 | C | 1,420,235,943円 | 分配準備積立金額 | D | 169,874,120円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,700,058,925円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 6,142,201,858口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 2,767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                                     | 59,714,611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                                     | 625,465,580円   |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | D                                     | 152,985,289円   |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | E=A+B+C+D                             | 838,165,480円   |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | F                                     | 7,583,620,416口 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | G=E/F*10,000                          | 1,105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                                     | 109,948,862円   |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | B                                     | －円             |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | C                                     | 1,420,235,943円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | D                                     | 169,874,120円   |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | E=A+B+C+D                             | 1,700,058,925円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | F                                     | 6,142,201,858口 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |  |  |              |   |              |                           |   |    |        |   |                |          |   |              |               |           |                |              |   |                |               |              |        |            |   |    |         |              |    |
| 1万口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | G=E/F*10,000                          | 2,767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7期<br>自 平成31年 3月26日<br>至 令和 2年 3月25日                                                                                                                                                                    | 第8期<br>自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> | 同左                                    |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | 第7期<br>[令和 2年 3月25日現在]                                                                                                                                                                                              | 第8期<br>[令和 3年 3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           | <p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p> |

| 区分                        | 第7期<br>[令和 2年 3月25日現在]                                                                                                | 第8期<br>[令和 3年 3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7期<br>[令和 2年 3月25日現在]   | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在]   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) | 当計算期間の損益に含まれた評価差額<br>(円) |
| 親投資信託受益証券 | △24,973,985              | 582,752,115              |
| 合計        | △24,973,985              | 582,752,115              |

## （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7期<br>[令和 2年 3月25日現在] | 第8期<br>[令和 3年 3月25日現在] |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.1099円                | 1.2768円                |
| (1万口当たり純資産額) | (11,099円)              | (12,768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<br>証券 | 新興国株式インデックスマザーファンド     | 720,392,600   | 2,243,518,674 |    |
|               | ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド  | 149,479,261   | 204,592,264   |    |
|               | ヘッジ付新興国債券インデックスマザーファンド | 171,469,563   | 197,670,112   |    |
|               | 国内債券インデックスマザーファンド      | 170,343,058   | 166,527,373   |    |
|               | ＴＯＰＩＸマザーファンド           | 1,141,935,003 | 2,519,793,777 |    |
|               | 外国株式インデックスマザーファンド      | 591,060,363   | 2,195,079,976 |    |
| 合 計           |                        | 2,944,679,848 | 7,527,182,176 |    |

## 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 3年 3月25日現在]

|          |                 |
|----------|-----------------|
| 資産の部     |                 |
| 流動資産     |                 |
| コール・ローン  | 17,257,983,426  |
| 株式       | 500,358,470,370 |
| 派生商品評価勘定 | 56,944,700      |
| 未収入金     | 2,408,002,415   |
| 未収配当金    | 558,180,261     |
| 未収利息     | 366,598         |
| 前払金      | 25,775,000      |



| [令和 3年 3月25日現在] |                 |
|-----------------|-----------------|
| その他未収収益         | 24,091,145      |
| 差入委託証拠金         | 198,990,000     |
| 流動資産合計          | 520,888,803,915 |
| 資産合計            | 520,888,803,915 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 19,446,250      |
| 未払解約金           | 1,818,039,307   |
| 未払利息            | 2,992           |
| 受入担保金           | 12,825,767,492  |
| 流動負債合計          | 14,663,256,041  |
| 負債合計            | 14,663,256,041  |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 229,410,107,801 |
| 剰余金             |                 |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 276,815,440,073 |
| 元本等合計           | 506,225,547,874 |
| 純資産合計           | 506,225,547,874 |
| 負債純資産合計         | 520,888,803,915 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

|                                  | [令和 3年 3月25日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首                            | 令和 2年 3月26日      |
| 期首元本額                            | 155,521,677,140円 |
| 期中追加設定元本額                        | 188,893,233,170円 |
| 期中一部解約元本額                        | 115,004,802,509円 |
| 元本の内訳※                           |                  |
| ファンド・マネジャー（国内株式）                 | 37,479,685,504円  |
| eMAXIS TOPIXインデックス               | 8,604,372,501円   |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 1,950,892,563円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 119,070,036円     |
| コアバランス                           | 328,759円         |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 198,781,187円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 289,864,085円     |

|                                  | [令和 3年 3月25日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 228,899,254円    |
| eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）          | 13,602,153,926円 |
| 国内株式セレクション（ラップ向け）                | 1,756,267,634円  |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 4,712,164,579円  |
| つみたて日本株式（TOPIX）                  | 4,001,522,886円  |
| つみたて8資産均等バランス                    | 2,196,282,960円  |
| つみたて4資産均等バランス                    | 620,286,251円    |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 1,902,217円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 2,063,296円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 2,741,261円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 147,879,838円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 132,175,100円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 74,896,119円     |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）        | 487,546,968円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 94,951,924円     |
| 国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）           | 6,707,939,160円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 4,425,148円      |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）        | 2,076,019,643円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）        | 4,824,953,681円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）       | 1,141,935,003円  |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）   | 995,976,201円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）        | 696,104,061円    |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）           | 23,690,387円     |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）         | 133,804,967円    |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）              | 387,478,596円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）        | 103,891,974円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）        | 113,695,796円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）       | 400,890,493円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）          | 311,162,788円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）         | 613,457,453円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）    | 28,505,904円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）    | 6,907,397,556円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）  | 166,778,167円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）  | 2,045,876,506円  |
| MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）   | 38,769,457,450円 |

|                                                     | [令和 3年 3月25日現在] |
|-----------------------------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）                     | 326,535,655円    |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）                       | 4,248,023円      |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）                     | 1,328,569円      |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）                       | 344,072,004円    |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）                       | 662,944,418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）  | 1,907,726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） | 5,080,252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）             | 4,358,307,314円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）            | 1,692,112,324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）               | 710,013,837円    |
| 世界8資産 バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                         | 71,670,570円     |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）                   | 3,685,929,047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）             | 173,203,551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）                    | 2,443,434,776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）                 | 478,523,266円    |
| MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）          | 5,452,360,866円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）           | 82,140,596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）             | 147,744,978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）             | 143,520,115円    |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）             | 49,029,745円     |
| MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定）             | 140,640,270円    |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）             | 47,117,066円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）             | 46,858,781円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）             | 43,721,286円     |

|                                                   | [令和 3年 3月25日現在]  |
|---------------------------------------------------|------------------|
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）           | 40,946,418円      |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド                                  | 5,628,571,550円   |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                        | 3,527,376円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA                      | 13,488,833円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA                        | 7,856,548円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA                        | 10,745,662円      |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1                               | 954,753,112円     |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA                                | 182,073,523円     |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）                        | 19,816,080円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）                        | 114,233,682円     |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）                        | 12,659,852円      |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）                        | 63,252,030円      |
| 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド                              | 1,580,925,814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）               | 474,591,231円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）             | 1,832,126,512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）               | 1,668,589,423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）               | 1,410,459,958円   |
| 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド                            | 51,112,148,726円  |
| 合計                                                | 229,410,107,801円 |
| 2. 貸付有価証券<br>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。<br>株式 | 12,064,169,110円  |
| 3. 受益権の総数                                         | 229,410,107,801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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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。<br>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。<br>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。<br>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 3年 3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<br>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。<br>(2) デリバティブ取引<br>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。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>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 3年 3月25日現在]    |
|----|--------------------|
|    | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 株式 | 92,547,860,723     |
| 合計 | 92,547,860,723     |

(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 3年 3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<br>買建 | 4,255,305,000 | —     | 4,292,925,000 | 37,620,000 |
| 合計   |                | 4,255,305,000 | —     | 4,292,925,000 | 37,620,000 |

（注）時価の算定方法

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（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 3年 3月25日現在〕 |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.2066円         |
| (1万口当たり純資産額) | (22,066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     | 8,200   | 3,240.00 | 26,568,000  |    |
| 1332 | 日本水産   | 235,200 | 556.00   | 130,771,200 |    |
| 1333 | マルハニチロ | 39,600  | 2,701.00 | 106,959,600 |    |
| 1375 | 雪国まいたけ | 15,600  | 1,998.00 | 31,168,800  |    |

|      |                  |         |           |             |                            |
|------|------------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| 1376 | カネコ種苗            | 7,700   | 1,642.00  | 12,643,400  |                            |
| 1377 | サカタのタネ           | 30,200  | 4,075.00  | 123,065,000 | 貸付有価証券<br>7,500株（7,500株）   |
| 1379 | ホクト              | 21,300  | 2,160.00  | 46,008,000  |                            |
| 1384 | ホクリヨウ            | 3,900   | 725.00    | 2,827,500   |                            |
| 1514 | 住石ホールディングス       | 44,300  | 126.00    | 5,581,800   |                            |
| 1515 | 日鉄鉱業             | 5,800   | 7,070.00  | 41,006,000  | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 1518 | 三井松島ホールディングス     | 10,600  | 1,061.00  | 11,246,600  |                            |
| 1605 | 国際石油開発帝石         | 931,600 | 770.00    | 717,332,000 |                            |
| 1662 | 石油資源開発           | 33,100  | 2,140.00  | 70,834,000  |                            |
| 1663 | K&Oエナジーグループ      | 12,300  | 1,478.00  | 18,179,400  |                            |
| 1413 | ヒノキヤグループ         | 6,300   | 2,486.00  | 15,661,800  |                            |
| 1414 | ショーボンドホールディングス   | 36,200  | 4,820.00  | 174,484,000 | 貸付有価証券<br>10,600株（10,600株） |
| 1417 | ミライト・ホールディングス    | 87,800  | 1,849.00  | 162,342,200 |                            |
| 1419 | タマホーム            | 15,400  | 2,104.00  | 32,401,600  |                            |
| 1420 | サンヨーホームズ         | 2,900   | 821.00    | 2,380,900   | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| 1429 | 日本アクア            | 10,100  | 622.00    | 6,282,200   | 貸付有価証券<br>800株（800株）       |
| 1430 | ファーストコーポレーション    | 7,700   | 749.00    | 5,767,300   |                            |
| 1433 | ベステラ             | 4,800   | 1,643.00  | 7,886,400   | 貸付有価証券<br>1,300株（300株）     |
| 1435 | TATERU           | 47,500  | 189.00    | 8,977,500   | 貸付有価証券<br>12,200株          |
| 1446 | キャンディル           | 4,300   | 546.00    | 2,347,800   |                            |
| 1448 | スペースバリューホールディングス | 30,900  | 704.00    | 21,753,600  | 貸付有価証券<br>7,800株（7,800株）   |
| 1712 | ダイセキ環境ソリューション    | 4,900   | 838.00    | 4,106,200   |                            |
| 1716 | 第一カッター興業         | 6,300   | 1,424.00  | 8,971,200   |                            |
| 1719 | 安藤・間             | 162,400 | 883.00    | 143,399,200 |                            |
| 1720 | 東急建設             | 74,200  | 618.00    | 45,855,600  |                            |
| 1721 | コムシスホールディングス     | 89,800  | 3,360.00  | 301,728,000 |                            |
| 1726 | ビーアールホールディングス    | 33,900  | 593.00    | 20,102,700  | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）   |
| 1762 | 高松コンストラクショングループ  | 15,800  | 2,268.00  | 35,834,400  |                            |
| 1766 | 東建コーポレーション       | 7,800   | 10,700.00 | 83,460,000  | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株）   |
| 1768 | ソネック             | 2,600   | 871.00    | 2,264,600   |                            |
| 1780 | ヤマウラ             | 11,000  | 986.00    | 10,846,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| 1801 | 大成建設             | 182,100 | 4,385.00  | 798,508,500 |                            |
| 1802 | 大林組              | 585,000 | 1,040.00  | 608,400,000 |                            |
| 1803 | 清水建設             | 548,000 | 926.00    | 507,448,000 |                            |
| 1805 | 飛島建設             | 16,800  | 1,250.00  | 21,000,000  |                            |

|      |               |         |           |             |                            |
|------|---------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| 1808 | 長谷工コーポレーション   | 191,600 | 1,589.00  | 304,452,400 | 貸付有価証券<br>17,100株（17,100株） |
| 1810 | 松井建設          | 23,000  | 756.00    | 17,388,000  |                            |
| 1811 | 銭高組           | 2,600   | 5,160.00  | 13,416,000  |                            |
| 1812 | 鹿島建設          | 428,700 | 1,615.00  | 692,350,500 | 貸付有価証券<br>26,900株（26,900株） |
| 1813 | 不動テトラ         | 14,300  | 1,944.00  | 27,799,200  |                            |
| 1814 | 大末建設          | 7,400   | 979.00    | 7,244,600   |                            |
| 1815 | 鉄建建設          | 11,800  | 2,106.00  | 24,850,800  |                            |
| 1820 | 西松建設          | 41,900  | 2,902.00  | 121,593,800 | 貸付有価証券<br>3,400株（3,400株）   |
| 1821 | 三井住友建設        | 141,300 | 525.00    | 74,182,500  |                            |
| 1822 | 大豊建設          | 12,800  | 4,000.00  | 51,200,000  | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 1824 | 前田建設工業        | 146,500 | 993.00    | 145,474,500 |                            |
| 1826 | 佐田建設          | 13,500  | 452.00    | 6,102,000   |                            |
| 1827 | ナカノフドー建設      | 14,000  | 407.00    | 5,698,000   |                            |
| 1833 | 奥村組           | 32,200  | 3,060.00  | 98,532,000  |                            |
| 1835 | 東鉄工業          | 25,100  | 2,694.00  | 67,619,400  | 貸付有価証券<br>6,200株（6,200株）   |
| 1847 | イチケン          | 4,200   | 2,196.00  | 9,223,200   |                            |
| 1848 | 富士ピー・エス       | 7,500   | 601.00    | 4,507,500   | 貸付有価証券<br>2,600株（600株）     |
| 1852 | 浅沼組           | 7,000   | 5,000.00  | 35,000,000  |                            |
| 1860 | 戸田建設          | 242,900 | 841.00    | 204,278,900 | 貸付有価証券<br>18,200株（18,200株） |
| 1861 | 熊谷組           | 27,100  | 3,135.00  | 84,958,500  |                            |
| 1866 | 北野建設          | 3,600   | 2,615.00  | 9,414,000   | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 1867 | 植木組           | 2,600   | 3,140.00  | 8,164,000   |                            |
| 1870 | 矢作建設工業        | 25,800  | 872.00    | 22,497,600  |                            |
| 1871 | ピーエス三菱        | 19,300  | 706.00    | 13,625,800  |                            |
| 1873 | 日本ハウスホールディングス | 39,900  | 344.00    | 13,725,600  | 貸付有価証券<br>9,500株           |
| 1878 | 大東建託          | 63,900  | 12,200.00 | 779,580,000 | 貸付有価証券<br>17,500株（17,500株） |
| 1879 | 新日本建設         | 24,900  | 919.00    | 22,883,100  |                            |
| 1881 | N I P P O     | 48,400  | 2,995.00  | 144,958,000 |                            |
| 1882 | 東亜道路工業        | 3,600   | 4,295.00  | 15,462,000  |                            |
| 1883 | 前田道路          | 36,100  | 2,236.00  | 80,719,600  |                            |
| 1884 | 日本道路          | 5,700   | 8,450.00  | 48,165,000  |                            |
| 1885 | 東亜建設工業        | 15,600  | 2,516.00  | 39,249,600  | 貸付有価証券<br>4,300株           |
| 1887 | 日本国土開発        | 56,900  | 621.00    | 35,334,900  |                            |
| 1888 | 若築建設          | 10,500  | 1,453.00  | 15,256,500  |                            |
| 1890 | 東洋建設          | 65,600  | 610.00    | 40,016,000  |                            |



|      |            |         |          |               |                            |
|------|------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 1893 | 五洋建設       | 248,500 | 894.00   | 222,159,000   | 貸付有価証券<br>58,200株（58,200株） |
| 1898 | 世紀東急工業     | 28,100  | 986.00   | 27,706,600    |                            |
| 1899 | 福田組        | 6,800   | 5,440.00 | 36,992,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 1911 | 住友林業       | 137,600 | 2,444.00 | 336,294,400   | 貸付有価証券<br>11,100株（11,100株） |
| 1914 | 日本基礎技術     | 17,900  | 525.00   | 9,397,500     |                            |
| 1921 | 巴コーポレーション  | 26,000  | 416.00   | 10,816,000    | 貸付有価証券<br>5,600株（5,600株）   |
| 1925 | 大和ハウス工業    | 540,200 | 3,398.00 | 1,835,599,600 |                            |
| 1926 | ライト工業      | 33,500  | 1,904.00 | 63,784,000    |                            |
| 1928 | 積水ハウス      | 634,500 | 2,342.50 | 1,486,316,250 |                            |
| 1929 | 日特建設       | 15,300  | 847.00   | 12,959,100    |                            |
| 1930 | 北陸電気工事     | 10,100  | 1,250.00 | 12,625,000    |                            |
| 1934 | ユアテック      | 33,500  | 846.00   | 28,341,000    |                            |
| 1938 | 日本リーテック    | 12,200  | 1,957.00 | 23,875,400    |                            |
| 1939 | 四電工        | 3,200   | 3,155.00 | 10,096,000    |                            |
| 1941 | 中電工        | 26,900  | 2,481.00 | 66,738,900    |                            |
| 1942 | 関電工        | 95,100  | 972.00   | 92,437,200    |                            |
| 1944 | きんでん       | 126,300 | 1,914.00 | 241,738,200   |                            |
| 1945 | 東京エネシス     | 19,400  | 958.00   | 18,585,200    |                            |
| 1946 | トーエネック     | 5,900   | 4,110.00 | 24,249,000    |                            |
| 1949 | 住友電設       | 16,500  | 2,479.00 | 40,903,500    |                            |
| 1950 | 日本電設工業     | 32,100  | 1,995.00 | 64,039,500    | 貸付有価証券<br>8,000株（8,000株）   |
| 1951 | 協和エクシオ     | 88,700  | 2,951.00 | 261,753,700   |                            |
| 1952 | 新日本空調      | 15,500  | 2,470.00 | 38,285,000    | 貸付有価証券<br>3,800株（3,800株）   |
| 1959 | 九電工        | 41,000  | 4,140.00 | 169,740,000   | 貸付有価証券<br>3,100株（3,100株）   |
| 1961 | 三機工業       | 41,500  | 1,489.00 | 61,793,500    | 貸付有価証券<br>3,200株（3,200株）   |
| 1963 | 日揮ホールディングス | 195,200 | 1,367.00 | 266,838,400   |                            |
| 1964 | 中外炉工業      | 6,300   | 2,150.00 | 13,545,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 1967 | ヤマト        | 18,700  | 714.00   | 13,351,800    |                            |
| 1968 | 太平電業       | 13,000  | 2,741.00 | 35,633,000    |                            |
| 1969 | 高砂熱学工業     | 52,900  | 1,759.00 | 93,051,100    | 貸付有価証券<br>3,800株（3,800株）   |
| 1972 | 三晃金属工業     | 2,300   | 3,100.00 | 7,130,000     |                            |
| 1975 | 朝日工業社      | 4,300   | 3,080.00 | 13,244,000    |                            |
| 1976 | 明星工業       | 37,800  | 829.00   | 31,336,200    |                            |
| 1979 | 大気社        | 28,400  | 3,085.00 | 87,614,000    | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）   |
| 1980 | ダイダン       | 13,000  | 3,080.00 | 40,040,000    | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |

|      |              |         |          |             |                            |
|------|--------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 1982 | 日比谷総合設備      | 18,800  | 1,993.00 | 37,468,400  |                            |
| 3267 | フィル・カンパニー    | 3,300   | 2,296.00 | 7,576,800   |                            |
| 5912 | ＯＳＪＢホールディングス | 85,100  | 300.00   | 25,530,000  |                            |
| 6330 | 東洋エンジニアリング   | 24,600  | 669.00   | 16,457,400  | 貸付有価証券<br>5,800株           |
| 6379 | レイズネクスト      | 31,400  | 1,232.00 | 38,684,800  |                            |
| 2001 | ニッポン         | 54,800  | 1,700.00 | 93,160,000  | 貸付有価証券<br>13,600株（13,600株） |
| 2002 | 日清製粉グループ本社   | 211,500 | 1,883.00 | 398,254,500 |                            |
| 2003 | 日東富士製粉       | 1,400   | 7,930.00 | 11,102,000  |                            |
| 2004 | 昭和産業         | 15,800  | 3,235.00 | 51,113,000  |                            |
| 2009 | 鳥越製粉         | 16,600  | 868.00   | 14,408,800  | 貸付有価証券<br>4,000株           |
| 2053 | 中部飼料         | 22,900  | 1,495.00 | 34,235,500  |                            |
| 2060 | フィード・ワン      | 25,200  | 937.00   | 23,612,400  | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株）   |
| 2107 | 東洋精糖         | 3,200   | 1,230.00 | 3,936,000   |                            |
| 2108 | 日本甜菜製糖       | 9,800   | 1,737.00 | 17,022,600  |                            |
| 2109 | 三井製糖         | 14,800  | 2,076.00 | 30,724,800  |                            |
| 2112 | 塩水港精糖        | 22,300  | 265.00   | 5,909,500   |                            |
| 2117 | 日新製糖         | 8,900   | 1,938.00 | 17,248,200  |                            |
| 2201 | 森永製菓         | 43,900  | 4,080.00 | 179,112,000 |                            |
| 2204 | 中村屋          | 4,500   | 4,100.00 | 18,450,000  |                            |
| 2206 | 江崎グリコ        | 51,600  | 4,580.00 | 236,328,000 | 貸付有価証券<br>4,200株（4,200株）   |
| 2207 | 名糖産業         | 8,200   | 1,617.00 | 13,259,400  |                            |
| 2209 | 井村屋グループ      | 10,600  | 2,675.00 | 28,355,000  | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| 2211 | 不二家          | 11,900  | 2,303.00 | 27,405,700  |                            |
| 2212 | 山崎製パン        | 140,300 | 1,863.00 | 261,378,900 | 貸付有価証券<br>35,300株（35,300株） |
| 2215 | 第一屋製パン       | 3,600   | 988.00   | 3,556,800   |                            |
| 2217 | モロゾフ         | 3,000   | 6,000.00 | 18,000,000  |                            |
| 2220 | 亀田製菓         | 10,700  | 4,895.00 | 52,376,500  |                            |
| 2222 | 寿スピリッツ       | 18,000  | 7,020.00 | 126,360,000 | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 2229 | カルビー         | 85,300  | 2,993.00 | 255,302,900 | 貸付有価証券<br>6,400株（6,400株）   |
| 2264 | 森永乳業         | 34,600  | 5,880.00 | 203,448,000 |                            |
| 2266 | 六甲バター        | 12,400  | 1,728.00 | 21,427,200  | 貸付有価証券<br>900株（900株）       |
| 2267 | ヤクルト本社       | 128,800 | 5,810.00 | 748,328,000 |                            |
| 2269 | 明治ホールディングス   | 123,800 | 7,190.00 | 890,122,000 |                            |
| 2270 | 雪印メグミルク      | 45,100  | 2,329.00 | 105,037,900 | 貸付有価証券<br>3,400株（3,400株）   |
| 2281 | プリマハム        | 26,300  | 3,535.00 | 92,970,500  |                            |

|      |                          |         |          |               |                            |
|------|--------------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 2282 | 日本ハム                     | 71,600  | 4,910.00 | 351,556,000   |                            |
| 2286 | 林兼産業                     | 6,200   | 677.00   | 4,197,400     |                            |
| 2288 | 丸大食品                     | 18,400  | 1,787.00 | 32,880,800    |                            |
| 2292 | S Foods                  | 16,800  | 3,815.00 | 64,092,000    |                            |
| 2294 | 柿安本店                     | 6,500   | 2,682.00 | 17,433,000    | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| 2296 | 伊藤ハム米久ホールディングス           | 120,600 | 766.00   | 92,379,600    | 貸付有価証券<br>9,000株（9,000株）   |
| 2501 | サッポロホールディングス             | 63,900  | 2,301.00 | 147,033,900   |                            |
| 2502 | アサヒグループホールディングス          | 409,000 | 4,626.00 | 1,892,034,000 |                            |
| 2503 | キリンホールディングス              | 794,000 | 2,154.00 | 1,710,276,000 |                            |
| 2531 | 宝ホールディングス                | 138,800 | 1,464.00 | 203,203,200   |                            |
| 2533 | オエノンホールディングス             | 53,200  | 428.00   | 22,769,600    |                            |
| 2540 | 養命酒製造                    | 5,700   | 1,983.00 | 11,303,100    |                            |
| 2579 | コカ・コーラ ボトラーズジャパン<br>ホールデ | 143,400 | 2,008.00 | 287,947,200   | 貸付有価証券<br>9,900株（9,900株）   |
| 2587 | サントリー食品インターナショナル         | 125,300 | 4,190.00 | 525,007,000   |                            |
| 2590 | ダイドーグループホールディングス         | 10,600  | 5,420.00 | 57,452,000    |                            |
| 2593 | 伊藤園                      | 56,800  | 6,910.00 | 392,488,000   | 貸付有価証券<br>4,300株（4,300株）   |
| 2594 | キーコーヒー                   | 18,400  | 2,226.00 | 40,958,400    |                            |
| 2597 | ユニカフェ                    | 5,600   | 1,021.00 | 5,717,600     |                            |
| 2599 | ジャパンフーズ                  | 2,700   | 1,293.00 | 3,491,100     |                            |
| 2602 | 日清オイリオグループ               | 24,100  | 3,390.00 | 81,699,000    |                            |
| 2607 | 不二製油グループ本社               | 45,600  | 3,100.00 | 141,360,000   | 貸付有価証券<br>11,500株（11,500株） |
| 2612 | かどや製油                    | 2,000   | 4,445.00 | 8,890,000     |                            |
| 2613 | J-オイルミルズ                 | 8,700   | 4,175.00 | 36,322,500    |                            |
| 2801 | キッコーマン                   | 134,800 | 6,580.00 | 886,984,000   | 貸付有価証券<br>34,100株（34,100株） |
| 2802 | 味の素                      | 445,300 | 2,335.00 | 1,039,775,500 |                            |
| 2804 | ブルドックソース                 | 8,500   | 2,960.00 | 25,160,000    |                            |
| 2809 | キューピー                    | 104,300 | 2,559.00 | 266,903,700   |                            |
| 2810 | ハウス食品グループ本社              | 70,000  | 3,755.00 | 262,850,000   |                            |
| 2811 | カゴメ                      | 76,500  | 3,515.00 | 268,897,500   | 貸付有価証券<br>17,800株（17,800株） |
| 2812 | 焼津水産化学工業                 | 9,100   | 1,026.00 | 9,336,600     |                            |
| 2815 | アリアケジャパン                 | 17,100  | 6,670.00 | 114,057,000   |                            |
| 2818 | ピエトロ                     | 2,400   | 1,944.00 | 4,665,600     |                            |
| 2819 | エバラ食品工業                  | 4,100   | 2,789.00 | 11,434,900    |                            |
| 2820 | やまみ                      | 2,000   | 2,121.00 | 4,242,000     |                            |
| 2871 | ニチレイ                     | 89,200  | 2,884.00 | 257,252,800   | 貸付有価証券<br>5,000株（5,000株）   |
| 2875 | 東洋水産                     | 96,300  | 4,860.00 | 468,018,000   |                            |
| 2882 | イートアンドホールディングス           | 6,500   | 1,943.00 | 12,629,500    |                            |

|      |                   |           |          |               |                            |
|------|-------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 2883 | 大冷                | 2,100     | 1,970.00 | 4,137,000     |                            |
| 2884 | ヨシムラ・フード・ホールディングス | 10,500    | 946.00   | 9,933,000     | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 2897 | 日清食品ホールディングス      | 73,500    | 8,560.00 | 629,160,000   |                            |
| 2899 | 永谷園ホールディングス       | 9,100     | 2,460.00 | 22,386,000    |                            |
| 2904 | 一正蒲鉾              | 7,300     | 1,224.00 | 8,935,200     |                            |
| 2908 | フジッコ              | 20,300    | 2,012.00 | 40,843,600    | 貸付有価証券<br>5,100株（5,100株）   |
| 2910 | ロック・フィールド         | 20,200    | 1,710.00 | 34,542,000    | 貸付有価証券<br>3,900株（3,900株）   |
| 2914 | 日本たばこ産業           | 1,003,900 | 2,113.00 | 2,121,240,700 | 貸付有価証券<br>81,000株（81,000株） |
| 2915 | ケンコーマヨネーズ         | 11,500    | 1,962.00 | 22,563,000    |                            |
| 2918 | わらべや日洋ホールディングス    | 12,200    | 1,725.00 | 21,045,000    |                            |
| 2922 | なとり               | 10,400    | 2,049.00 | 21,309,600    |                            |
| 2924 | イフジ産業             | 2,900     | 960.00   | 2,784,000     |                            |
| 2925 | ピクルスコーポレーション      | 4,500     | 3,350.00 | 15,075,000    |                            |
| 2929 | ファーマフーズ           | 12,800    | 3,240.00 | 41,472,000    |                            |
| 2930 | 北の達人コーポレーション      | 65,400    | 655.00   | 42,837,000    | 貸付有価証券<br>4,900株（4,900株）   |
| 2931 | ユーグレナ             | 80,900    | 1,045.00 | 84,540,500    | 貸付有価証券<br>19,000株          |
| 4404 | ミヨシ油脂             | 6,600     | 1,249.00 | 8,243,400     |                            |
| 4526 | 理研ビタミン            | 17,700    | 1,425.00 | 25,222,500    |                            |
| 3001 | 片倉工業              | 24,500    | 1,376.00 | 33,712,000    |                            |
| 3002 | グンゼ               | 13,400    | 4,225.00 | 56,615,000    | 貸付有価証券<br>3,300株（3,300株）   |
| 3101 | 東洋紡               | 72,200    | 1,505.00 | 108,661,000   |                            |
| 3103 | ユニチカ              | 53,500    | 419.00   | 22,416,500    |                            |
| 3104 | 富士紡ホールディングス       | 8,800     | 4,035.00 | 35,508,000    |                            |
| 3106 | 倉敷紡績              | 16,800    | 2,005.00 | 33,684,000    |                            |
| 3109 | シキボウ              | 10,300    | 1,046.00 | 10,773,800    | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 3201 | 日本毛織              | 60,100    | 1,018.00 | 61,181,800    |                            |
| 3202 | ダイトウボウ            | 29,500    | 110.00   | 3,245,000     | 貸付有価証券<br>2,200株（2,200株）   |
| 3204 | トーア紡コーポレーション      | 7,200     | 491.00   | 3,535,200     |                            |
| 3205 | ダイドーリミテッド         | 24,000    | 201.00   | 4,824,000     |                            |
| 3302 | 帝国繊維              | 20,600    | 2,129.00 | 43,857,400    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）   |
| 3401 | 帝人                | 172,000   | 1,938.00 | 333,336,000   |                            |
| 3402 | 東レ                | 1,322,900 | 721.50   | 954,472,350   |                            |
| 3408 | サカイオーベックス         | 4,800     | 2,986.00 | 14,332,800    |                            |
| 3501 | 住江織物              | 4,000     | 2,231.00 | 8,924,000     |                            |
| 3512 | 日本フェルト            | 10,300    | 473.00   | 4,871,900     |                            |
| 3513 | イチカワ              | 2,400     | 1,426.00 | 3,422,400     |                            |

|      |                |           |          |               |                            |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 3524 | 日東製網           | 2,000     | 1,710.00 | 3,420,000     |                            |
| 3529 | アツギ            | 14,000    | 577.00   | 8,078,000     |                            |
| 3551 | ダイニック          | 6,900     | 866.00   | 5,975,400     |                            |
| 3569 | セーレン           | 44,900    | 2,001.00 | 89,844,900    | 貸付有価証券<br>3,400株           |
| 3571 | ソトー            | 7,300     | 823.00   | 6,007,900     |                            |
| 3577 | 東海染工           | 2,300     | 1,125.00 | 2,587,500     |                            |
| 3580 | 小松マテーレ         | 30,000    | 1,026.00 | 30,780,000    | 貸付有価証券<br>2,200株（2,200株）   |
| 3591 | ワコールホールディングス   | 45,600    | 2,410.00 | 109,896,000   |                            |
| 3593 | ホギメディカル        | 24,600    | 3,435.00 | 84,501,000    | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株）   |
| 3607 | クラウドシアホールディングス | 4,500     | 298.00   | 1,341,000     |                            |
| 3608 | T S I ホールディングス | 55,500    | 320.00   | 17,760,000    |                            |
| 3611 | マツオカコーポレーション   | 5,800     | 1,943.00 | 11,269,400    | 貸付有価証券<br>1,600株（400株）     |
| 3612 | ワールド           | 23,900    | 1,540.00 | 36,806,000    |                            |
| 8011 | 三陽商会           | 9,500     | 843.00   | 8,008,500     |                            |
| 8013 | ナイガイ           | 6,700     | 360.00   | 2,412,000     |                            |
| 8016 | オンワードホールディングス  | 109,800   | 310.00   | 34,038,000    | 貸付有価証券<br>27,600株（27,600株） |
| 8029 | ルックホールディングス    | 6,200     | 1,285.00 | 7,967,000     |                            |
| 8107 | キムラタン          | 102,100   | 25.00    | 2,552,500     | 貸付有価証券<br>27,700株（5,200株）  |
| 8111 | ゴールドウイン        | 30,200    | 7,110.00 | 214,722,000   |                            |
| 8114 | デサント           | 31,200    | 1,935.00 | 60,372,000    | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）   |
| 8118 | キング            | 9,700     | 602.00   | 5,839,400     |                            |
| 8127 | ヤマトインターナショナル   | 16,000    | 349.00   | 5,584,000     |                            |
| 3708 | 特種東海製紙         | 11,200    | 5,170.00 | 57,904,000    |                            |
| 3861 | 王子ホールディングス     | 822,500   | 741.00   | 609,472,500   |                            |
| 3863 | 日本製紙           | 80,800    | 1,393.00 | 112,554,400   |                            |
| 3864 | 三菱製紙           | 25,900    | 389.00   | 10,075,100    |                            |
| 3865 | 北越コーポレーション     | 130,700   | 547.00   | 71,492,900    | 貸付有価証券<br>9,100株（9,100株）   |
| 3877 | 中越パルプ工業        | 7,000     | 1,288.00 | 9,016,000     |                            |
| 3878 | 巴川製紙所          | 6,000     | 812.00   | 4,872,000     |                            |
| 3880 | 大王製紙           | 88,100    | 1,887.00 | 166,244,700   |                            |
| 3896 | 阿波製紙           | 4,700     | 461.00   | 2,166,700     |                            |
| 3941 | レンゴー           | 188,400   | 978.00   | 184,255,200   |                            |
| 3946 | トーモク           | 11,200    | 1,951.00 | 21,851,200    |                            |
| 3950 | ザ・パックス         | 13,800    | 3,140.00 | 43,332,000    | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 3405 | クラレ            | 287,700   | 1,338.00 | 384,942,600   |                            |
| 3407 | 旭化成            | 1,211,000 | 1,305.00 | 1,580,355,000 | 貸付有価証券<br>91,600株（91,600株） |

|      |              |           |           |               |                          |
|------|--------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| 3553 | 共和レザー        | 9,900     | 779.00    | 7,712,100     |                          |
| 4004 | 昭和電工         | 138,700   | 3,215.00  | 445,920,500   |                          |
| 4005 | 住友化学         | 1,438,200 | 578.00    | 831,279,600   |                          |
| 4008 | 住友精化         | 8,900     | 4,160.00  | 37,024,000    |                          |
| 4021 | 日産化学         | 100,800   | 5,950.00  | 599,760,000   | 貸付有価証券<br>7,700株（7,700株） |
| 4022 | ラサ工業         | 6,000     | 2,125.00  | 12,750,000    |                          |
| 4023 | クレハ          | 15,700    | 7,950.00  | 124,815,000   |                          |
| 4025 | 多木化学         | 7,100     | 6,080.00  | 43,168,000    | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| 4027 | テイカ          | 13,400    | 1,520.00  | 20,368,000    |                          |
| 4028 | 石原産業         | 32,700    | 908.00    | 29,691,600    |                          |
| 4031 | 片倉コープアグリ     | 4,700     | 1,382.00  | 6,495,400     |                          |
| 4041 | 日本曹達         | 25,500    | 3,605.00  | 91,927,500    | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株） |
| 4042 | 東ソー          | 282,400   | 2,194.00  | 619,585,600   |                          |
| 4043 | トクヤマ         | 54,300    | 2,838.00  | 154,103,400   |                          |
| 4044 | セントラル硝子      | 34,800    | 2,329.00  | 81,049,200    | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株） |
| 4045 | 東亜合成         | 111,500   | 1,309.00  | 145,953,500   |                          |
| 4046 | 大阪ソーダ        | 18,600    | 2,669.00  | 49,643,400    |                          |
| 4047 | 関東電化工業       | 43,300    | 924.00    | 40,009,200    |                          |
| 4061 | デンカ          | 66,700    | 4,505.00  | 300,483,500   | 貸付有価証券<br>5,000株（5,000株） |
| 4063 | 信越化学工業       | 337,800   | 18,345.00 | 6,196,941,000 |                          |
| 4064 | 日本カーバイド工業    | 6,500     | 1,357.00  | 8,820,500     |                          |
| 4078 | 堺化学工業        | 12,800    | 2,183.00  | 27,942,400    |                          |
| 4082 | 第一稀元素化学工業    | 18,400    | 1,244.00  | 22,889,600    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株） |
| 4088 | エア・ウォーター     | 186,300   | 2,017.00  | 375,767,100   |                          |
| 4091 | 日本酸素ホールディングス | 150,500   | 2,139.00  | 321,919,500   |                          |
| 4092 | 日本化学工業       | 5,200     | 2,943.00  | 15,303,600    |                          |
| 4093 | 東邦アセチレン      | 2,700     | 1,377.00  | 3,717,900     |                          |
| 4095 | 日本パーカライジング   | 92,200    | 1,209.00  | 111,469,800   |                          |
| 4097 | 高圧ガス工業       | 29,000    | 759.00    | 22,011,000    |                          |
| 4098 | チタン工業        | 2,300     | 2,031.00  | 4,671,300     | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 4099 | 四国化成工業       | 24,300    | 1,293.00  | 31,419,900    |                          |
| 4100 | 戸田工業         | 3,900     | 2,062.00  | 8,041,800     |                          |
| 4109 | ステラ ケミファ     | 9,900     | 3,205.00  | 31,729,500    | 貸付有価証券<br>700株（700株）     |
| 4112 | 保土谷化学工業      | 5,400     | 4,670.00  | 25,218,000    |                          |
| 4114 | 日本触媒         | 33,100    | 6,580.00  | 217,798,000   |                          |
| 4116 | 大日精化工業       | 15,100    | 2,563.00  | 38,701,300    |                          |
| 4118 | カネカ          | 47,300    | 4,770.00  | 225,621,000   |                          |

|      |                |           |          |               |                            |
|------|----------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 4182 | 三菱瓦斯化学         | 183,000   | 2,794.00 | 511,302,000   |                            |
| 4183 | 三井化学           | 157,700   | 3,660.00 | 577,182,000   |                            |
| 4185 | J S R          | 183,400   | 3,485.00 | 639,149,000   |                            |
| 4186 | 東京応化工業         | 31,300    | 6,860.00 | 214,718,000   |                            |
| 4187 | 大阪有機化学工業       | 16,900    | 3,495.00 | 59,065,500    | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）   |
| 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 1,221,400 | 865.60   | 1,057,243,840 |                            |
| 4189 | KHネオケム         | 30,100    | 2,847.00 | 85,694,700    | 貸付有価証券<br>8,100株（8,100株）   |
| 4202 | ダイセル           | 245,600   | 876.00   | 215,145,600   | 貸付有価証券<br>18,800株（18,800株） |
| 4203 | 住友ベークライト       | 28,700    | 4,645.00 | 133,311,500   |                            |
| 4204 | 積水化学工業         | 386,400   | 2,179.00 | 841,965,600   | 貸付有価証券<br>29,400株（29,400株） |
| 4205 | 日本ゼオン          | 164,800   | 1,790.00 | 294,992,000   |                            |
| 4206 | アイカ工業          | 50,900    | 4,115.00 | 209,453,500   |                            |
| 4208 | 宇部興産           | 92,300    | 2,471.00 | 228,073,300   | 貸付有価証券<br>6,900株（6,900株）   |
| 4212 | 積水樹脂           | 30,100    | 2,142.00 | 64,474,200    |                            |
| 4215 | タキロンシーアイ       | 39,500    | 709.00   | 28,005,500    |                            |
| 4216 | 旭有機材           | 10,300    | 1,550.00 | 15,965,000    |                            |
| 4218 | ニチバン           | 9,600     | 2,038.00 | 19,564,800    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 4220 | リケンテクノス        | 44,600    | 541.00   | 24,128,600    |                            |
| 4221 | 大倉工業           | 8,600     | 2,077.00 | 17,862,200    |                            |
| 4228 | 積水化成品工業        | 24,500    | 633.00   | 15,508,500    |                            |
| 4229 | 群栄化学工業         | 4,200     | 2,628.00 | 11,037,600    |                            |
| 4231 | タイガースポリマー      | 9,600     | 487.00   | 4,675,200     |                            |
| 4238 | ミライアル          | 5,900     | 1,269.00 | 7,487,100     |                            |
| 4245 | ダイキアクシス        | 6,700     | 939.00   | 6,291,300     | 貸付有価証券<br>800株             |
| 4246 | ダイキョーニシカワ      | 38,500    | 802.00   | 30,877,000    |                            |
| 4248 | 竹本容器           | 6,500     | 885.00   | 5,752,500     |                            |
| 4249 | 森六ホールディングス     | 9,800     | 2,280.00 | 22,344,000    | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 4251 | 恵和             | 2,700     | 2,004.00 | 5,410,800     |                            |
| 4272 | 日本化薬           | 113,100   | 1,114.00 | 125,993,400   |                            |
| 4275 | カーリットホールディングス  | 18,100    | 735.00   | 13,303,500    |                            |
| 4362 | 日本精化           | 13,200    | 1,487.00 | 19,628,400    |                            |
| 4368 | 扶桑化学工業         | 14,400    | 3,920.00 | 56,448,000    |                            |
| 4369 | トリケミカル研究所      | 16,900    | 3,380.00 | 57,122,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 4401 | A D E K A      | 84,100    | 2,139.00 | 179,889,900   |                            |
| 4403 | 日油             | 68,800    | 5,790.00 | 398,352,000   |                            |
| 4406 | 新日本理化          | 30,200    | 285.00   | 8,607,000     | 貸付有価証券<br>12,200株（5,000株）  |

|      |                  |         |           |               |                            |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 4410 | ハリマ化成グループ        | 13,600  | 1,005.00  | 13,668,000    |                            |
| 4452 | 花王               | 446,700 | 7,132.00  | 3,185,864,400 |                            |
| 4461 | 第一工業製薬           | 6,200   | 3,680.00  | 22,816,000    |                            |
| 4462 | 石原ケミカル           | 4,600   | 2,264.00  | 10,414,400    |                            |
| 4463 | 日華化学             | 6,200   | 927.00    | 5,747,400     | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| 4465 | ニイタカ             | 3,800   | 2,873.00  | 10,917,400    | 貸付有価証券<br>900株（200株）       |
| 4471 | 三洋化成工業           | 10,900  | 5,690.00  | 62,021,000    |                            |
| 4531 | 有機合成薬品工業         | 14,000  | 310.00    | 4,340,000     | 貸付有価証券<br>4,300株（1,000株）   |
| 4611 | 大日本塗料            | 20,600  | 978.00    | 20,146,800    |                            |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス   | 150,700 | 8,330.00  | 1,255,331,000 | 貸付有価証券<br>37,900株（37,900株） |
| 4613 | 関西ペイント           | 205,300 | 2,891.00  | 593,522,300   |                            |
| 4615 | 神東塗料             | 14,400  | 216.00    | 3,110,400     | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株）   |
| 4617 | 中国塗料             | 44,000  | 992.00    | 43,648,000    |                            |
| 4619 | 日本特殊塗料           | 13,700  | 1,092.00  | 14,960,400    |                            |
| 4620 | 藤倉化成             | 24,600  | 560.00    | 13,776,000    |                            |
| 4626 | 太陽ホールディングス       | 13,400  | 6,060.00  | 81,204,000    |                            |
| 4631 | D I C            | 77,200  | 2,895.00  | 223,494,000   | 貸付有価証券<br>5,800株（5,800株）   |
| 4633 | サカタインクス          | 39,900  | 1,105.00  | 44,089,500    |                            |
| 4634 | 東洋インキＳＣホールディングス  | 38,600  | 2,069.00  | 79,863,400    |                            |
| 4636 | T & K T O K A    | 14,100  | 912.00    | 12,859,200    |                            |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス   | 327,900 | 6,605.00  | 2,165,779,500 |                            |
| 4911 | 資生堂              | 370,700 | 7,247.00  | 2,686,462,900 | 貸付有価証券<br>27,800株（27,800株） |
| 4912 | ライオン             | 242,500 | 2,231.00  | 541,017,500   | 貸付有価証券<br>18,200株（18,200株） |
| 4914 | 高砂香料工業           | 11,700  | 2,689.00  | 31,461,300    |                            |
| 4917 | マンダム             | 39,100  | 2,077.00  | 81,210,700    |                            |
| 4919 | ミルボン             | 24,900  | 6,180.00  | 153,882,000   |                            |
| 4921 | ファンケル            | 67,900  | 3,730.00  | 253,267,000   |                            |
| 4922 | コーセー             | 35,100  | 15,970.00 | 560,547,000   | 貸付有価証券<br>2,600株（2,600株）   |
| 4923 | コタ               | 10,700  | 1,850.00  | 19,795,000    |                            |
| 4926 | シーボン             | 2,400   | 2,059.00  | 4,941,600     |                            |
| 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス | 79,600  | 2,637.00  | 209,905,200   |                            |
| 4928 | ノエビアホールディングス     | 15,800  | 5,110.00  | 80,738,000    |                            |
| 4929 | アジュバンコスメジャパン     | 4,200   | 1,065.00  | 4,473,000     |                            |
| 4931 | 新日本製薬            | 3,800   | 2,277.00  | 8,652,600     |                            |
| 4951 | エスケー             | 12,000  | 2,017.00  | 24,204,000    |                            |
| 4955 | アグロ カネショウ        | 7,000   | 1,594.00  | 11,158,000    |                            |



|      |                 |         |           |               |                            |
|------|-----------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 4956 | コニシ             | 30,600  | 1,867.00  | 57,130,200    | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）   |
| 4958 | 長谷川香料           | 32,200  | 2,105.00  | 67,781,000    |                            |
| 4963 | 星光PMC           | 10,700  | 809.00    | 8,656,300     |                            |
| 4967 | 小林製薬            | 52,300  | 10,490.00 | 548,627,000   | 貸付有価証券<br>13,100株（13,100株） |
| 4968 | 荒川化学工業          | 15,500  | 1,385.00  | 21,467,500    |                            |
| 4971 | メック             | 12,800  | 2,321.00  | 29,708,800    | 貸付有価証券<br>4,500株（1,500株）   |
| 4973 | 日本高純度化学         | 5,100   | 2,829.00  | 14,427,900    |                            |
| 4974 | タカラバイオ          | 48,800  | 2,950.00  | 143,960,000   | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株）   |
| 4975 | J C U           | 21,000  | 3,920.00  | 82,320,000    |                            |
| 4977 | 新田ゼラチン          | 11,700  | 710.00    | 8,307,000     |                            |
| 4979 | O A Tアグリオ       | 3,500   | 1,524.00  | 5,334,000     |                            |
| 4980 | デクセリアルズ         | 52,100  | 1,843.00  | 96,020,300    |                            |
| 4985 | アース製薬           | 14,100  | 6,590.00  | 92,919,000    |                            |
| 4992 | 北興化学工業          | 17,400  | 1,120.00  | 19,488,000    | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 4994 | 大成ラミック          | 5,700   | 2,954.00  | 16,837,800    |                            |
| 4996 | クミアイ化学工業        | 77,100  | 1,022.00  | 78,796,200    |                            |
| 4997 | 日本農薬            | 33,200  | 549.00    | 18,226,800    |                            |
| 5142 | アキレス            | 12,900  | 1,541.00  | 19,878,900    |                            |
| 5208 | 有沢製作所           | 25,900  | 1,065.00  | 27,583,500    | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 6988 | 日東電工            | 119,500 | 9,440.00  | 1,128,080,000 |                            |
| 7874 | レック             | 22,100  | 1,334.00  | 29,481,400    | 貸付有価証券<br>5,000株（5,000株）   |
| 7888 | 三光合成            | 19,600  | 451.00    | 8,839,600     |                            |
| 7908 | きもと             | 28,600  | 214.00    | 6,120,400     | 貸付有価証券<br>2,400株（2,400株）   |
| 7917 | 藤森工業            | 16,700  | 4,475.00  | 74,732,500    |                            |
| 7925 | 前澤化成工業          | 11,800  | 975.00    | 11,505,000    |                            |
| 7931 | 未来工業            | 6,700   | 1,714.00  | 11,483,800    |                            |
| 7940 | ウェーブロックホールディングス | 6,400   | 757.00    | 4,844,800     | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 7942 | J S P           | 10,900  | 1,956.00  | 21,320,400    |                            |
| 7947 | エフピコ            | 34,300  | 4,410.00  | 151,263,000   | 貸付有価証券<br>3,000株（3,000株）   |
| 7958 | 天馬              | 14,000  | 2,293.00  | 32,102,000    |                            |
| 7970 | 信越ポリマー          | 28,700  | 1,006.00  | 28,872,200    |                            |
| 7971 | 東リ              | 46,400  | 258.00    | 11,971,200    |                            |
| 7988 | ニフコ             | 68,500  | 3,915.00  | 268,177,500   | 貸付有価証券<br>5,100株（5,100株）   |
| 7995 | バルカー            | 15,200  | 2,174.00  | 33,044,800    |                            |
| 8113 | ユニ・チャーム         | 395,500 | 4,609.00  | 1,822,859,500 |                            |

|      |                 |           |          |               |                            |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 9385 | ショーエイコーポレーション   | 4,100     | 1,102.00 | 4,518,200     |                            |
| 4151 | 協和キリン           | 187,700   | 3,170.00 | 595,009,000   |                            |
| 4502 | 武田薬品工業          | 1,552,100 | 4,169.00 | 6,470,704,900 |                            |
| 4503 | アステラス製薬         | 1,617,400 | 1,688.50 | 2,730,979,900 |                            |
| 4506 | 大日本住友製薬         | 138,300   | 1,952.00 | 269,961,600   | 貸付有価証券<br>10,400株（10,400株） |
| 4507 | 塩野義製薬           | 234,600   | 5,901.00 | 1,384,374,600 |                            |
| 4512 | わかもと製薬          | 22,200    | 479.00   | 10,633,800    | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）   |
| 4514 | あすか製薬           | 21,200    | 1,444.00 | 30,612,800    |                            |
| 4516 | 日本新薬            | 52,900    | 7,910.00 | 418,439,000   |                            |
| 4517 | ビオフェルミン製薬       | 3,200     | 2,814.00 | 9,004,800     |                            |
| 4519 | 中外製薬            | 583,500   | 4,367.00 | 2,548,144,500 | 貸付有価証券<br>43,800株（43,800株） |
| 4521 | 科研製薬            | 31,900    | 4,470.00 | 142,593,000   |                            |
| 4523 | エーザイ            | 206,100   | 7,313.00 | 1,507,209,300 |                            |
| 4527 | ロート製薬           | 88,900    | 3,005.00 | 267,144,500   |                            |
| 4528 | 小野薬品工業          | 428,400   | 2,889.50 | 1,237,861,800 |                            |
| 4530 | 久光製薬            | 54,300    | 7,150.00 | 388,245,000   | 貸付有価証券<br>11,000株（11,000株） |
| 4534 | 持田製薬            | 25,900    | 4,395.00 | 113,830,500   | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| 4536 | 参天製薬            | 324,600   | 1,525.00 | 495,015,000   |                            |
| 4538 | 扶桑薬品工業          | 6,000     | 2,595.00 | 15,570,000    |                            |
| 4539 | 日本ケミファ          | 2,200     | 2,535.00 | 5,577,000     |                            |
| 4540 | ツムラ             | 62,200    | 3,865.00 | 240,403,000   | 貸付有価証券<br>4,300株（4,300株）   |
| 4541 | 日医工             | 52,800    | 1,030.00 | 54,384,000    | 貸付有価証券<br>3,900株（3,900株）   |
| 4547 | キッセイ薬品工業        | 33,000    | 2,559.00 | 84,447,000    |                            |
| 4548 | 生化学工業           | 32,900    | 1,080.00 | 35,532,000    |                            |
| 4549 | 栄研化学            | 32,800    | 2,139.00 | 70,159,200    | 貸付有価証券<br>2,500株（2,500株）   |
| 4550 | 日水製薬            | 6,900     | 1,005.00 | 6,934,500     |                            |
| 4551 | 鳥居薬品            | 11,700    | 3,055.00 | 35,743,500    |                            |
| 4552 | J C Rファーマ       | 52,600    | 3,380.00 | 177,788,000   |                            |
| 4553 | 東和薬品            | 26,900    | 2,412.00 | 64,882,800    | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株）   |
| 4554 | 富士製薬工業          | 12,700    | 1,302.00 | 16,535,400    |                            |
| 4555 | 沢井製薬            | 40,900    | 5,260.00 | 215,134,000   |                            |
| 4559 | ゼリア新薬工業         | 33,800    | 2,178.00 | 73,616,400    | 貸付有価証券<br>6,900株（6,900株）   |
| 4568 | 第一三共            | 1,601,500 | 3,163.00 | 5,065,544,500 |                            |
| 4569 | キョーリン製薬ホールディングス | 41,200    | 1,991.00 | 82,029,200    | 貸付有価証券<br>3,100株（3,100株）   |
| 4574 | 大幸薬品            | 22,900    | 1,272.00 | 29,128,800    | 貸付有価証券<br>5,100株           |

|      |                  |           |          |               |                            |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 4577 | ダイト              | 11,900    | 3,590.00 | 42,721,000    |                            |
| 4578 | 大塚ホールディングス       | 387,700   | 4,643.00 | 1,800,091,100 | 貸付有価証券<br>20,000株（20,000株） |
| 4581 | 大正製薬ホールディングス     | 44,400    | 7,350.00 | 326,340,000   |                            |
| 4587 | ペプチドリーム          | 96,200    | 4,965.00 | 477,633,000   | 貸付有価証券<br>23,700株（23,700株） |
| 3315 | 日本コークス工業         | 157,600   | 115.00   | 18,124,000    |                            |
| 5011 | ニチレキ             | 22,000    | 1,635.00 | 35,970,000    |                            |
| 5013 | ユシロ化学工業          | 10,500    | 1,192.00 | 12,516,000    |                            |
| 5015 | ビーピー・カストロール      | 6,700     | 1,332.00 | 8,924,400     |                            |
| 5017 | 富士石油             | 45,300    | 236.00   | 10,690,800    |                            |
| 5018 | MORESCO          | 6,700     | 1,127.00 | 7,550,900     |                            |
| 5019 | 出光興産             | 207,000   | 2,924.00 | 605,268,000   |                            |
| 5020 | ENEOSホールディングス    | 2,806,300 | 506.30   | 1,420,829,690 |                            |
| 5021 | コスモエネルギーホールディングス | 58,900    | 2,652.00 | 156,202,800   |                            |
| 5101 | 横浜ゴム             | 108,000   | 1,922.00 | 207,576,000   |                            |
| 5105 | TOYO TIRE        | 98,200    | 1,963.00 | 192,766,600   |                            |
| 5108 | ブリヂストン           | 496,000   | 4,383.00 | 2,173,968,000 |                            |
| 5110 | 住友ゴム工業           | 167,600   | 1,274.00 | 213,522,400   |                            |
| 5121 | 藤倉コンポジット         | 16,300    | 492.00   | 8,019,600     |                            |
| 5122 | オカモト             | 11,400    | 4,340.00 | 49,476,000    |                            |
| 5185 | フコク              | 8,200     | 809.00   | 6,633,800     |                            |
| 5186 | ニッタ              | 19,300    | 2,690.00 | 51,917,000    |                            |
| 5191 | 住友理工             | 36,200    | 708.00   | 25,629,600    |                            |
| 5192 | 三ツ星ベルト           | 22,700    | 1,850.00 | 41,995,000    |                            |
| 5195 | バンドー化学           | 32,800    | 785.00   | 25,748,000    | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）   |
| 3110 | 日東紡績             | 27,800    | 3,990.00 | 110,922,000   | 貸付有価証券<br>8,700株（2,100株）   |
| 5201 | A G C            | 171,200   | 4,470.00 | 765,264,000   |                            |
| 5202 | 日本板硝子            | 94,700    | 556.00   | 52,653,200    |                            |
| 5204 | 石塚硝子             | 3,200     | 1,972.00 | 6,310,400     |                            |
| 5210 | 日本山村硝子           | 7,700     | 1,056.00 | 8,131,200     |                            |
| 5214 | 日本電気硝子           | 69,200    | 2,527.00 | 174,868,400   |                            |
| 5218 | オハラ              | 7,400     | 1,632.00 | 12,076,800    | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 5232 | 住友大阪セメント         | 33,600    | 3,700.00 | 124,320,000   | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）   |
| 5233 | 太平洋セメント          | 110,500   | 2,972.00 | 328,406,000   |                            |
| 5262 | 日本ヒューム           | 17,000    | 784.00   | 13,328,000    |                            |
| 5269 | 日本コンクリート工業       | 40,200    | 420.00   | 16,884,000    | 貸付有価証券<br>3,000株（3,000株）   |
| 5273 | 三谷セキサン           | 8,700     | 4,105.00 | 35,713,500    |                            |
| 5288 | アジアパイルホールディングス   | 28,700    | 551.00   | 15,813,700    |                            |
| 5301 | 東海カーボン           | 182,400   | 1,772.00 | 323,212,800   |                            |

|      |                    |         |           |               |                          |
|------|--------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 5302 | 日本カーボン             | 10,300  | 4,535.00  | 46,710,500    |                          |
| 5310 | 東洋炭素               | 10,900  | 2,110.00  | 22,999,000    |                          |
| 5331 | ノリタケカンパニーリミテド      | 10,300  | 3,605.00  | 37,131,500    |                          |
| 5332 | TOTO               | 133,300 | 6,730.00  | 897,109,000   |                          |
| 5333 | 日本碍子               | 205,300 | 2,028.00  | 416,348,400   |                          |
| 5334 | 日本特殊陶業             | 141,900 | 1,959.00  | 277,982,100   |                          |
| 5337 | ダントーホールディングス       | 13,900  | 361.00    | 5,017,900     | 貸付有価証券<br>3,300株         |
| 5344 | MARUWA             | 6,400   | 11,020.00 | 70,528,000    | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株） |
| 5351 | 品川リフラクトリーズ         | 4,400   | 2,958.00  | 13,015,200    |                          |
| 5352 | 黒崎播磨               | 3,200   | 4,955.00  | 15,856,000    |                          |
| 5357 | ヨータイ               | 13,300  | 1,035.00  | 13,765,500    | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| 5358 | イソライト工業            | 8,200   | 676.00    | 5,543,200     |                          |
| 5363 | 東京窯業               | 23,700  | 344.00    | 8,152,800     | 貸付有価証券<br>5,500株（5,500株） |
| 5367 | ニッカトー              | 8,400   | 766.00    | 6,434,400     | 貸付有価証券<br>900株（900株）     |
| 5384 | フジミインコーポレーテッド      | 15,000  | 4,015.00  | 60,225,000    |                          |
| 5388 | クニミネ工業             | 5,900   | 1,305.00  | 7,699,500     |                          |
| 5391 | エーアンドエーマテリアル       | 3,600   | 1,137.00  | 4,093,200     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| 5393 | ニチアス               | 47,100  | 2,807.00  | 132,209,700   | 貸付有価証券<br>3,800株（3,800株） |
| 7943 | ニチハ                | 25,900  | 3,255.00  | 84,304,500    |                          |
| 5401 | 日本製鉄               | 880,600 | 1,842.50  | 1,622,505,500 |                          |
| 5406 | 神戸製鋼所              | 337,600 | 692.00    | 233,619,200   |                          |
| 5408 | 中山製鋼所              | 25,600  | 443.00    | 11,340,800    |                          |
| 5410 | 合同製鐵               | 9,900   | 2,216.00  | 21,938,400    |                          |
| 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 533,800 | 1,321.00  | 705,149,800   |                          |
| 5423 | 東京製鐵               | 71,800  | 790.00    | 56,722,000    |                          |
| 5440 | 共英製鋼               | 20,800  | 1,721.00  | 35,796,800    |                          |
| 5444 | 大和工業               | 39,200  | 3,145.00  | 123,284,000   |                          |
| 5445 | 東京鐵鋼               | 7,100   | 2,004.00  | 14,228,400    |                          |
| 5449 | 大阪製鐵               | 9,800   | 1,434.00  | 14,053,200    |                          |
| 5451 | 淀川製鋼所              | 24,900  | 2,514.00  | 62,598,600    | 貸付有価証券<br>1,900株（1,900株） |
| 5463 | 丸一鋼管               | 59,900  | 2,620.00  | 156,938,000   |                          |
| 5464 | モリ工業               | 5,500   | 2,710.00  | 14,905,000    | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株） |
| 5471 | 大同特殊鋼              | 30,200  | 4,960.00  | 149,792,000   | 貸付有価証券<br>7,500株（7,500株） |
| 5476 | 日本高周波鋼業            | 6,800   | 434.00    | 2,951,200     |                          |
| 5480 | 日本冶金工業             | 14,400  | 2,074.00  | 29,865,600    |                          |

|      |                |         |          |               |                            |
|------|----------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 5481 | 山陽特殊製鋼         | 22,100  | 1,648.00 | 36,420,800    |                            |
| 5482 | 愛知製鋼           | 10,400  | 3,735.00 | 38,844,000    |                            |
| 5486 | 日立金属           | 173,900 | 1,826.00 | 317,541,400   |                            |
| 5491 | 日本金属           | 4,700   | 1,122.00 | 5,273,400     | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| 5541 | 大太平洋金属         | 12,500  | 2,130.00 | 26,625,000    |                            |
| 5563 | 新日本電工          | 119,000 | 305.00   | 36,295,000    |                            |
| 5602 | 栗本鐵工所          | 8,300   | 1,826.00 | 15,155,800    |                            |
| 5603 | 虹技             | 2,500   | 1,230.00 | 3,075,000     |                            |
| 5612 | 日本鑄鉄管          | 2,100   | 1,440.00 | 3,024,000     | 貸付有価証券<br>900株（400株）       |
| 5632 | 三菱製鋼           | 13,600  | 852.00   | 11,587,200    | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 5658 | 日亜銅業           | 27,000  | 313.00   | 8,451,000     | 貸付有価証券<br>6,700株（6,700株）   |
| 5659 | 日本精線           | 2,600   | 3,690.00 | 9,594,000     |                            |
| 5698 | エンビプロ・ホールディングス | 7,800   | 909.00   | 7,090,200     |                            |
| 6319 | シンニッタン         | 22,300  | 307.00   | 6,846,100     |                            |
| 7305 | 新家工業           | 4,600   | 1,771.00 | 8,146,600     | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 5702 | 大紀アルミニウム工業所    | 27,800  | 1,075.00 | 29,885,000    |                            |
| 5703 | 日本軽金属ホールディングス  | 50,300  | 2,295.00 | 115,438,500   |                            |
| 5706 | 三井金属鉱業         | 49,800  | 3,820.00 | 190,236,000   | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株）   |
| 5707 | 東邦亜鉛           | 10,200  | 2,355.00 | 24,021,000    | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 5711 | 三菱マテリアル        | 121,800 | 2,531.00 | 308,275,800   |                            |
| 5713 | 住友金属鉱山         | 235,800 | 4,691.00 | 1,106,137,800 | 貸付有価証券<br>17,700株（17,700株） |
| 5714 | DOWAホールディングス   | 46,700  | 4,730.00 | 220,891,000   | 貸付有価証券<br>3,500株（3,500株）   |
| 5715 | 古河機械金属         | 30,500  | 1,408.00 | 42,944,000    |                            |
| 5721 | エス・サイエンス       | 81,600  | 43.00    | 3,508,800     |                            |
| 5726 | 大阪チタニウムテクノロジーズ | 19,200  | 940.00   | 18,048,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 5727 | 東邦チタニウム        | 33,000  | 978.00   | 32,274,000    | 貸付有価証券<br>8,300株（8,300株）   |
| 5741 | U A C J        | 28,000  | 2,624.00 | 73,472,000    |                            |
| 5757 | C Kサンエツ        | 3,900   | 4,025.00 | 15,697,500    | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| 5801 | 古河電気工業         | 57,300  | 2,969.00 | 170,123,700   | 貸付有価証券<br>14,400株（14,400株） |
| 5802 | 住友電気工業         | 643,800 | 1,700.00 | 1,094,460,000 |                            |
| 5803 | フジクラ           | 222,800 | 534.00   | 118,975,200   | 貸付有価証券<br>16,700株（16,700株） |
| 5805 | 昭和電線ホールディングス   | 17,900  | 1,644.00 | 29,427,600    | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株）   |
| 5807 | 東京特殊電線         | 2,400   | 2,760.00 | 6,624,000     |                            |

|      |                  |         |           |             |                            |
|------|------------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| 5809 | タツタ電線            | 32,500  | 639.00    | 20,767,500  |                            |
| 5819 | カナレ電気            | 3,100   | 1,799.00  | 5,576,900   |                            |
| 5821 | 平河ヒューテック         | 10,200  | 1,297.00  | 13,229,400  | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| 5851 | リョービ             | 22,700  | 1,669.00  | 37,886,300  | 貸付有価証券<br>5,700株（5,700株）   |
| 5852 | アーレスティ           | 22,700  | 483.00    | 10,964,100  |                            |
| 5857 | アサヒホールディングス      | 34,600  | 4,280.00  | 148,088,000 | 貸付有価証券<br>8,100株（8,100株）   |
| 3421 | 稲葉製作所            | 10,400  | 1,524.00  | 15,849,600  | 貸付有価証券<br>2,500株           |
| 3431 | 宮地エンジニアリンググループ   | 6,000   | 2,439.00  | 14,634,000  |                            |
| 3433 | トーカロ             | 47,600  | 1,452.00  | 69,115,200  |                            |
| 3434 | アルファC o          | 6,500   | 1,229.00  | 7,988,500   |                            |
| 3436 | SUMCO            | 236,100 | 2,508.00  | 592,138,800 |                            |
| 3443 | 川田テクノロジーズ        | 3,800   | 4,870.00  | 18,506,000  |                            |
| 3445 | RS Technologies  | 6,000   | 6,100.00  | 36,600,000  | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 3446 | ジェイテックコーポレーション   | 1,500   | 3,305.00  | 4,957,500   |                            |
| 3447 | 信和               | 9,800   | 897.00    | 8,790,600   |                            |
| 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 117,500 | 1,326.00  | 155,805,000 |                            |
| 5902 | ホッカンホールディングス     | 9,400   | 1,637.00  | 15,387,800  |                            |
| 5909 | コロナ              | 10,200  | 1,000.00  | 10,200,000  |                            |
| 5911 | 横河ブリッジホールディングス   | 31,700  | 2,025.00  | 64,192,500  |                            |
| 5915 | 駒井ハルテック          | 3,700   | 2,185.00  | 8,084,500   | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| 5923 | 高田機工             | 1,700   | 2,890.00  | 4,913,000   |                            |
| 5929 | 三和ホールディングス       | 173,900 | 1,494.00  | 259,806,600 | 貸付有価証券<br>13,300株（13,300株） |
| 5930 | 文化シャッター          | 54,400  | 1,108.00  | 60,275,200  |                            |
| 5932 | 三協立山             | 23,800  | 825.00    | 19,635,000  |                            |
| 5933 | アルインコ            | 12,200  | 1,010.00  | 12,322,000  |                            |
| 5936 | 東洋シャッター          | 4,100   | 675.00    | 2,767,500   |                            |
| 5938 | L I X I L        | 254,100 | 3,185.00  | 809,308,500 |                            |
| 5942 | 日本ファイルコン         | 12,800  | 523.00    | 6,694,400   |                            |
| 5943 | ノーリツ             | 38,200  | 1,836.00  | 70,135,200  | 貸付有価証券<br>8,600株（8,600株）   |
| 5946 | 長府製作所            | 18,800  | 2,203.00  | 41,416,400  |                            |
| 5947 | リンナイ             | 35,900  | 12,370.00 | 444,083,000 |                            |
| 5951 | ダイニチ工業           | 8,800   | 877.00    | 7,717,600   | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 5957 | 日東精工             | 23,200  | 589.00    | 13,664,800  |                            |
| 5958 | 三洋工業             | 2,200   | 1,885.00  | 4,147,000   |                            |
| 5959 | 岡部               | 37,400  | 792.00    | 29,620,800  |                            |
| 5970 | ジーテクト            | 22,900  | 1,555.00  | 35,609,500  | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）   |

|      |             |         |           |             |                          |
|------|-------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 5975 | 東プレ         | 34,400  | 1,636.00  | 56,278,400  |                          |
| 5976 | 高周波熱錬       | 35,500  | 636.00    | 22,578,000  |                          |
| 5981 | 東京製鋼        | 13,200  | 1,277.00  | 16,856,400  | 貸付有価証券<br>6,800株         |
| 5985 | サンコール       | 15,800  | 485.00    | 7,663,000   |                          |
| 5986 | モリテック スチール  | 14,400  | 429.00    | 6,177,600   | 貸付有価証券<br>4,500株（1,100株） |
| 5988 | パイオラックス     | 27,300  | 1,700.00  | 46,410,000  |                          |
| 5989 | エイチワン       | 18,100  | 796.00    | 14,407,600  |                          |
| 5991 | 日本発條        | 183,800 | 853.00    | 156,781,400 |                          |
| 5992 | 中央発條        | 2,200   | 4,055.00  | 8,921,000   |                          |
| 5998 | アドバネクス      | 2,600   | 1,535.00  | 3,991,000   | 貸付有価証券<br>600株           |
| 7989 | 立川ブラインド工業   | 8,100   | 1,369.00  | 11,088,900  |                          |
| 8155 | 三益半導体工業     | 14,400  | 2,706.00  | 38,966,400  | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |
| 1909 | 日本ドライケミカル   | 4,600   | 1,654.00  | 7,608,400   |                          |
| 5631 | 日本製鋼所       | 56,000  | 2,567.00  | 143,752,000 |                          |
| 6005 | 三浦工業        | 79,800  | 6,010.00  | 479,598,000 |                          |
| 6013 | タクマ         | 62,500  | 2,389.00  | 149,312,500 | 貸付有価証券<br>4,700株（4,700株） |
| 6101 | ツガミ         | 38,200  | 1,666.00  | 63,641,200  | 貸付有価証券<br>9,600株（9,600株） |
| 6103 | オークマ        | 21,500  | 6,420.00  | 138,030,000 | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株） |
| 6104 | 芝浦機械        | 19,100  | 2,929.00  | 55,943,900  |                          |
| 6113 | アマダ         | 270,400 | 1,281.00  | 346,382,400 |                          |
| 6118 | アイダエンジニアリング | 48,300  | 999.00    | 48,251,700  | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株） |
| 6121 | 滝澤鉄工所       | 5,300   | 1,134.00  | 6,010,200   |                          |
| 6134 | F U J I     | 73,700  | 2,688.00  | 198,105,600 |                          |
| 6135 | 牧野フライス製作所   | 21,600  | 4,535.00  | 97,956,000  | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株） |
| 6136 | オーエスジー      | 91,000  | 2,015.00  | 183,365,000 | 貸付有価証券<br>6,400株（6,400株） |
| 6138 | ダイジェット工業    | 2,100   | 1,351.00  | 2,837,100   |                          |
| 6140 | 旭ダイヤモンド工業   | 48,400  | 541.00    | 26,184,400  | 貸付有価証券<br>3,600株（3,600株） |
| 6141 | DMG森精機      | 116,700 | 1,850.00  | 215,895,000 | 貸付有価証券<br>8,700株（8,700株） |
| 6143 | ソディック       | 40,200  | 1,063.00  | 42,732,600  |                          |
| 6146 | ディスコ        | 25,000  | 34,450.00 | 861,250,000 |                          |
| 6151 | 日東工器        | 8,800   | 2,055.00  | 18,084,000  |                          |
| 6157 | 日進工具        | 7,200   | 3,170.00  | 22,824,000  | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| 6165 | パンチ工業       | 15,400  | 584.00    | 8,993,600   |                          |
| 6167 | 富士ダイス       | 9,300   | 695.00    | 6,463,500   | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |

|      |                |         |           |               |                          |
|------|----------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 6203 | 豊和工業           | 10,200  | 886.00    | 9,037,200     | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| 6205 | ＯＫＫ            | 7,100   | 445.00    | 3,159,500     | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株） |
| 6208 | 石川製作所          | 4,800   | 1,773.00  | 8,510,400     | 貸付有価証券<br>2,200株（1,200株） |
| 6210 | 東洋機械金属         | 13,200  | 486.00    | 6,415,200     |                          |
| 6217 | 津田駒工業          | 3,500   | 912.00    | 3,192,000     |                          |
| 6218 | エンシュウ          | 4,400   | 965.00    | 4,246,000     |                          |
| 6222 | 島精機製作所         | 27,000  | 2,592.00  | 69,984,000    | 貸付有価証券<br>7,100株（7,100株） |
| 6235 | オプトラン          | 23,100  | 2,713.00  | 62,670,300    |                          |
| 6236 | ＮＣホールディングス     | 5,600   | 713.00    | 3,992,800     |                          |
| 6237 | イワキポンプ         | 11,700  | 914.00    | 10,693,800    |                          |
| 6238 | フリュー           | 18,000  | 1,123.00  | 20,214,000    |                          |
| 6240 | ヤマシンフィルタ       | 37,200  | 867.00    | 32,252,400    | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株） |
| 6247 | 日阪製作所          | 22,700  | 852.00    | 19,340,400    |                          |
| 6250 | やまびこ           | 35,800  | 1,240.00  | 44,392,000    |                          |
| 6258 | 平田機工           | 8,700   | 6,790.00  | 59,073,000    | 貸付有価証券<br>700株（700株）     |
| 6262 | ベガサスミシン製造      | 18,700  | 454.00    | 8,489,800     |                          |
| 6264 | マルマエ           | 6,800   | 1,341.00  | 9,118,800     |                          |
| 6266 | タツモ            | 7,800   | 1,920.00  | 14,976,000    |                          |
| 6268 | ナブテスコ          | 108,700 | 4,955.00  | 538,608,500   | 貸付有価証券<br>8,100株（8,100株） |
| 6269 | 三井海洋開発         | 19,600  | 2,259.00  | 44,276,400    |                          |
| 6272 | レオン自動機         | 18,100  | 1,210.00  | 21,901,000    | 貸付有価証券<br>3,400株（3,400株） |
| 6273 | ＳＭＣ            | 54,600  | 64,750.00 | 3,535,350,000 |                          |
| 6277 | ホソカワミクロン       | 6,500   | 6,790.00  | 44,135,000    |                          |
| 6278 | ユニオンツール        | 6,900   | 3,565.00  | 24,598,500    |                          |
| 6282 | オイレス工業         | 25,800  | 1,821.00  | 46,981,800    |                          |
| 6284 | 日精エー・エス・ビー機械   | 5,300   | 5,320.00  | 28,196,000    |                          |
| 6287 | サトーホールディングス    | 24,300  | 2,892.00  | 70,275,600    |                          |
| 6289 | 技研製作所          | 16,300  | 5,050.00  | 82,315,000    |                          |
| 6291 | 日本エアーテック       | 6,000   | 1,208.00  | 7,248,000     | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| 6292 | カワタ            | 5,000   | 886.00    | 4,430,000     |                          |
| 6293 | 日精樹脂工業         | 14,200  | 1,023.00  | 14,526,600    |                          |
| 6294 | オカダアイヨン        | 5,800   | 1,327.00  | 7,696,600     | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| 6298 | ワイエイシイホールディングス | 7,300   | 957.00    | 6,986,100     | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 6301 | 小松製作所          | 845,200 | 3,275.00  | 2,768,030,000 |                          |
| 6302 | 住友重機械工業        | 106,800 | 3,105.00  | 331,614,000   |                          |



|      |              |         |           |               |                            |
|------|--------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 6305 | 日立建機         | 87,200  | 3,345.00  | 291,684,000   |                            |
| 6306 | 日工           | 27,800  | 742.00    | 20,627,600    |                            |
| 6309 | 巴工業          | 7,300   | 2,119.00  | 15,468,700    |                            |
| 6310 | 井関農機         | 18,600  | 1,620.00  | 30,132,000    |                            |
| 6315 | TOWA         | 17,400  | 2,087.00  | 36,313,800    |                            |
| 6316 | 丸山製作所        | 3,800   | 1,739.00  | 6,608,200     |                            |
| 6317 | 北川鉄工所        | 8,400   | 1,580.00  | 13,272,000    |                            |
| 6323 | ローツェ         | 8,200   | 7,400.00  | 60,680,000    | 貸付有価証券<br>1,100株（200株）     |
| 6325 | タカキタ         | 6,500   | 685.00    | 4,452,500     | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| 6326 | クボタ          | 980,000 | 2,436.50  | 2,387,770,000 | 貸付有価証券<br>74,200株（74,200株） |
| 6328 | 荏原実業         | 4,700   | 4,835.00  | 22,724,500    |                            |
| 6331 | 三菱化工機        | 6,000   | 2,816.00  | 16,896,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 6332 | 月島機械         | 34,400  | 1,318.00  | 45,339,200    |                            |
| 6333 | 帝国電機製作所      | 13,000  | 1,390.00  | 18,070,000    |                            |
| 6335 | 東京機械製作所      | 7,600   | 403.00    | 3,062,800     |                            |
| 6339 | 新東工業         | 44,300  | 792.00    | 35,085,600    | 貸付有価証券<br>3,300株（3,300株）   |
| 6340 | 澁谷工業         | 16,300  | 3,580.00  | 58,354,000    |                            |
| 6345 | アイチ コーポレーション | 32,200  | 890.00    | 28,658,000    |                            |
| 6349 | 小森コーポレーション   | 47,300  | 778.00    | 36,799,400    | 貸付有価証券<br>3,500株（3,500株）   |
| 6351 | 鶴見製作所        | 14,300  | 1,761.00  | 25,182,300    |                            |
| 6355 | 住友精密工業       | 2,800   | 2,261.00  | 6,330,800     |                            |
| 6356 | 日本ギア工業       | 7,400   | 335.00    | 2,479,000     |                            |
| 6358 | 酒井重工業        | 3,300   | 2,120.00  | 6,996,000     |                            |
| 6361 | 荏原製作所        | 77,300  | 4,325.00  | 334,322,500   |                            |
| 6362 | 石井鐵工所        | 2,600   | 3,025.00  | 7,865,000     |                            |
| 6363 | 西島製作所        | 18,800  | 903.00    | 16,976,400    |                            |
| 6364 | 北越工業         | 19,200  | 1,121.00  | 21,523,200    |                            |
| 6367 | ダイキン工業       | 237,700 | 21,755.00 | 5,171,163,500 |                            |
| 6368 | オルガノ         | 6,000   | 6,120.00  | 36,720,000    |                            |
| 6369 | トーヨーカネツ      | 7,000   | 2,851.00  | 19,957,000    |                            |
| 6370 | 栗田工業         | 101,000 | 4,700.00  | 474,700,000   | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| 6371 | 椿本チエイン       | 26,600  | 3,195.00  | 84,987,000    |                            |
| 6373 | 大同工業         | 8,900   | 903.00    | 8,036,700     |                            |
| 6378 | 木村化工機        | 15,500  | 640.00    | 9,920,000     | 貸付有価証券<br>3,900株（3,900株）   |
| 6381 | アネスト岩田       | 31,400  | 1,070.00  | 33,598,000    |                            |
| 6383 | ダイフク         | 102,700 | 10,510.00 | 1,079,377,000 |                            |
| 6387 | サムコ          | 4,700   | 3,065.00  | 14,405,500    | 貸付有価証券<br>1,600株（400株）     |

|      |                 |         |          |             |                            |
|------|-----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 6390 | 加藤製作所           | 10,200  | 1,127.00 | 11,495,400  |                            |
| 6393 | 油研工業            | 3,100   | 1,833.00 | 5,682,300   |                            |
| 6395 | タダノ             | 90,000  | 1,196.00 | 107,640,000 | 貸付有価証券<br>22,700株（22,700株） |
| 6406 | フジテック           | 64,200  | 2,346.00 | 150,613,200 |                            |
| 6407 | C K D           | 43,300  | 2,225.00 | 96,342,500  |                            |
| 6409 | キトー             | 15,700  | 1,804.00 | 28,322,800  |                            |
| 6412 | 平和              | 52,000  | 1,906.00 | 99,112,000  |                            |
| 6413 | 理想科学工業          | 14,400  | 1,540.00 | 22,176,000  |                            |
| 6417 | S A N K Y O     | 44,300  | 3,085.00 | 136,665,500 |                            |
| 6418 | 日本金銭機械          | 20,600  | 629.00   | 12,957,400  | 貸付有価証券<br>4,900株           |
| 6419 | マースグループホールディングス | 11,800  | 1,695.00 | 20,001,000  |                            |
| 6420 | フクシマガリレイ        | 12,800  | 4,495.00 | 57,536,000  | 貸付有価証券<br>2,900株（2,900株）   |
| 6428 | オーイズミ           | 7,800   | 420.00   | 3,276,000   |                            |
| 6430 | ダイコク電機          | 8,600   | 1,076.00 | 9,253,600   |                            |
| 6432 | 竹内製作所           | 31,200  | 2,980.00 | 92,976,000  | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）   |
| 6436 | アマノ             | 48,800  | 2,706.00 | 132,052,800 |                            |
| 6440 | J U K I         | 26,000  | 863.00   | 22,438,000  |                            |
| 6444 | サンデンホールディングス    | 26,000  | 398.00   | 10,348,000  |                            |
| 6445 | 蛇の目ミシン工業        | 17,000  | 820.00   | 13,940,000  | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）   |
| 6454 | マックス            | 25,600  | 1,639.00 | 41,958,400  |                            |
| 6457 | グローリー           | 47,900  | 2,446.00 | 117,163,400 |                            |
| 6458 | 新晃工業            | 17,300  | 2,182.00 | 37,748,600  |                            |
| 6459 | 大和冷機工業          | 30,000  | 1,067.00 | 32,010,000  |                            |
| 6460 | セガサミーホールディングス   | 169,600 | 1,752.00 | 297,139,200 |                            |
| 6461 | 日本ピストンリング       | 6,800   | 1,206.00 | 8,200,800   |                            |
| 6462 | リケン             | 8,600   | 2,554.00 | 21,964,400  | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 6463 | T P R           | 25,100  | 1,614.00 | 40,511,400  |                            |
| 6464 | ツバキ・ナカシマ        | 35,700  | 1,565.00 | 55,870,500  | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）   |
| 6465 | ホンザキ            | 58,700  | 9,580.00 | 562,346,000 | 貸付有価証券<br>4,100株（4,100株）   |
| 6470 | 大豊工業            | 15,200  | 1,036.00 | 15,747,200  |                            |
| 6471 | 日本精工            | 383,100 | 1,150.00 | 440,565,000 |                            |
| 6472 | N T N           | 431,700 | 332.00   | 143,324,400 | 貸付有価証券<br>32,200株（32,200株） |
| 6473 | ジェイテクト          | 178,900 | 1,152.00 | 206,092,800 |                            |
| 6474 | 不二越             | 17,300  | 4,840.00 | 83,732,000  | 貸付有価証券<br>4,400株（4,400株）   |
| 6480 | 日本トムソン          | 51,100  | 679.00   | 34,696,900  |                            |

|      |                   |           |           |               |                            |
|------|-------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| 6481 | THK               | 116,300   | 3,790.00  | 440,777,000   | 貸付有価証券<br>8,100株（8,100株）   |
| 6482 | ユーシン精機            | 12,400    | 916.00    | 11,358,400    |                            |
| 6485 | 前澤給装工業            | 6,500     | 2,377.00  | 15,450,500    |                            |
| 6486 | イーグル工業            | 23,100    | 1,241.00  | 28,667,100    |                            |
| 6489 | 前澤工業              | 11,200    | 632.00    | 7,078,400     |                            |
| 6490 | 日本ピラー工業           | 18,900    | 1,739.00  | 32,867,100    |                            |
| 6498 | キッツ               | 57,600    | 663.00    | 38,188,800    |                            |
| 6586 | マキタ               | 243,300   | 4,880.00  | 1,187,304,000 |                            |
| 7004 | 日立造船              | 147,900   | 912.00    | 134,884,800   | 貸付有価証券<br>11,100株（11,100株） |
| 7011 | 三菱重工業             | 293,100   | 3,460.00  | 1,014,126,000 |                            |
| 7013 | I H I             | 125,400   | 2,162.00  | 271,114,800   |                            |
| 7718 | スター精密             | 28,700    | 1,649.00  | 47,326,300    |                            |
| 3105 | 日清紡ホールディングス       | 114,000   | 823.00    | 93,822,000    |                            |
| 4062 | イビデン              | 89,700    | 5,240.00  | 470,028,000   |                            |
| 4902 | ユニカミノルタ           | 378,500   | 612.00    | 231,642,000   | 貸付有価証券<br>30,500株（30,500株） |
| 6448 | ブラザー工業            | 227,800   | 2,506.00  | 570,866,800   |                            |
| 6479 | ミネベアミツミ           | 321,600   | 2,779.00  | 893,726,400   |                            |
| 6501 | 日立製作所             | 896,900   | 5,333.00  | 4,783,167,700 |                            |
| 6502 | 東芝                | 276,900   | 3,815.00  | 1,056,373,500 |                            |
| 6503 | 三菱電機              | 1,865,400 | 1,702.50  | 3,175,843,500 |                            |
| 6504 | 富士電機              | 112,400   | 4,675.00  | 525,470,000   |                            |
| 6505 | 東洋電機製造            | 7,300     | 1,283.00  | 9,365,900     | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株）   |
| 6506 | 安川電機              | 200,800   | 5,360.00  | 1,076,288,000 | 貸付有価証券<br>15,100株（15,100株） |
| 6507 | シンフォニアテクノロジー      | 24,200    | 1,331.00  | 32,210,200    |                            |
| 6508 | 明電舎               | 31,600    | 2,454.00  | 77,546,400    | 貸付有価証券<br>2,600株（2,600株）   |
| 6513 | オリジン              | 5,000     | 1,370.00  | 6,850,000     |                            |
| 6516 | 山洋電気              | 9,000     | 5,950.00  | 53,550,000    |                            |
| 6517 | デンヨー              | 15,900    | 2,048.00  | 32,563,200    | 貸付有価証券<br>900株（900株）       |
| 6588 | 東芝テック             | 20,000    | 4,040.00  | 80,800,000    |                            |
| 6590 | 芝浦メカトロニクス         | 3,300     | 5,620.00  | 18,546,000    |                            |
| 6592 | マブチモーター           | 51,600    | 4,960.00  | 255,936,000   |                            |
| 6594 | 日本電産              | 449,000   | 13,075.00 | 5,870,675,000 |                            |
| 6615 | ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 11,200    | 844.00    | 9,452,800     |                            |
| 6616 | トレックス・セミコンダクター    | 10,000    | 1,620.00  | 16,200,000    |                            |
| 6617 | 東光高岳              | 9,400     | 1,619.00  | 15,218,600    |                            |
| 6619 | ダブル・スコープ          | 36,900    | 726.00    | 26,789,400    | 貸付有価証券<br>7,900株（7,900株）   |
| 6620 | 宮越ホールディングス        | 7,000     | 915.00    | 6,405,000     | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株）   |

|      |                      |         |           |               |                              |
|------|----------------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 6622 | ダイヘン                 | 20,400  | 4,800.00  | 97,920,000    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）     |
| 6630 | ヤーマン                 | 30,400  | 1,523.00  | 46,299,200    |                              |
| 6632 | JVCケンウッド             | 161,500 | 223.00    | 36,014,500    |                              |
| 6638 | ミマキエンジニアリング          | 16,700  | 634.00    | 10,587,800    |                              |
| 6640 | I－PEX                | 8,700   | 2,115.00  | 18,400,500    | 貸付有価証券<br>1,600株             |
| 6641 | 日新電機                 | 43,700  | 1,285.00  | 56,154,500    |                              |
| 6644 | 大崎電気工業               | 37,100  | 624.00    | 23,150,400    |                              |
| 6645 | オムロン                 | 155,300 | 8,900.00  | 1,382,170,000 |                              |
| 6651 | 日東工業                 | 27,400  | 2,072.00  | 56,772,800    | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）     |
| 6652 | I D E C              | 25,000  | 1,780.00  | 44,500,000    | 貸付有価証券<br>6,800株（6,800株）     |
| 6653 | 正興電機製作所              | 4,400   | 1,959.00  | 8,619,600     |                              |
| 6654 | 不二電機工業               | 3,100   | 1,281.00  | 3,971,100     |                              |
| 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション    | 67,100  | 2,952.00  | 198,079,200   | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）     |
| 6675 | サクサホールディングス          | 4,300   | 1,584.00  | 6,811,200     |                              |
| 6676 | メルコホールディングス          | 6,400   | 3,845.00  | 24,608,000    |                              |
| 6678 | テクノメディカ              | 4,200   | 1,740.00  | 7,308,000     |                              |
| 6699 | ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 5,400   | 2,749.00  | 14,844,600    | 貸付有価証券<br>900株（200株）         |
| 6701 | 日本電気                 | 237,000 | 6,460.00  | 1,531,020,000 |                              |
| 6702 | 富士通                  | 167,800 | 16,235.00 | 2,724,233,000 |                              |
| 6703 | 沖電気工業                | 75,800  | 1,183.00  | 89,671,400    |                              |
| 6704 | 岩崎通信機                | 8,200   | 911.00    | 7,470,200     |                              |
| 6706 | 電気興業                 | 9,000   | 2,708.00  | 24,372,000    |                              |
| 6707 | サンケン電気               | 21,800  | 5,330.00  | 116,194,000   |                              |
| 6715 | ナカヨ                  | 3,600   | 1,544.00  | 5,558,400     |                              |
| 6718 | アイホン                 | 10,600  | 1,825.00  | 19,345,000    |                              |
| 6723 | ルネサスエレクトロニクス         | 802,600 | 1,190.00  | 955,094,000   |                              |
| 6724 | セイコーエプソン             | 231,500 | 1,837.00  | 425,265,500   | 貸付有価証券<br>26,500株（26,500株）   |
| 6727 | ワコム                  | 135,000 | 738.00    | 99,630,000    | 貸付有価証券<br>31,400株（31,400株）   |
| 6728 | アルバック                | 34,300  | 4,430.00  | 151,949,000   |                              |
| 6730 | アクセル                 | 7,800   | 867.00    | 6,762,600     | 貸付有価証券<br>3,800株（2,000株）     |
| 6737 | E I Z O              | 15,800  | 4,270.00  | 67,466,000    |                              |
| 6740 | ジャパンディスプレイ           | 637,100 | 49.00     | 31,217,900    | 貸付有価証券<br>136,900株（136,900株） |
| 6741 | 日本信号                 | 43,500  | 1,019.00  | 44,326,500    | 貸付有価証券<br>4,200株（4,200株）     |
| 6742 | 京三製作所                | 40,000  | 424.00    | 16,960,000    | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）     |

|      |                |           |           |                |                            |
|------|----------------|-----------|-----------|----------------|----------------------------|
| 6744 | 能美防災           | 24,700    | 2,244.00  | 55,426,800     |                            |
| 6745 | ホーチキ           | 13,500    | 1,466.00  | 19,791,000     |                            |
| 6748 | 星和電機           | 9,200     | 611.00    | 5,621,200      | 貸付有価証券<br>2,900株（700株）     |
| 6750 | エレコム           | 21,400    | 5,030.00  | 107,642,000    |                            |
| 6752 | パナソニック         | 1,989,500 | 1,403.50  | 2,792,263,250  |                            |
| 6753 | シャープ           | 215,900   | 1,870.00  | 403,733,000    | 貸付有価証券<br>16,100株（16,100株） |
| 6754 | アンリツ           | 112,100   | 2,408.00  | 269,936,800    | 貸付有価証券<br>37,500株（9,000株）  |
| 6755 | 富士通ゼネラル        | 57,000    | 2,916.00  | 166,212,000    | 貸付有価証券<br>12,100株          |
| 6758 | ソニー            | 1,168,600 | 11,215.00 | 13,105,849,000 |                            |
| 6762 | T D K          | 90,100    | 15,320.00 | 1,380,332,000  |                            |
| 6763 | 帝国通信工業         | 8,200     | 1,138.00  | 9,331,600      |                            |
| 6768 | タムラ製作所         | 67,100    | 516.00    | 34,623,600     |                            |
| 6770 | アルプスアルパイン      | 152,400   | 1,511.00  | 230,276,400    |                            |
| 6771 | 池上通信機          | 5,900     | 903.00    | 5,327,700      |                            |
| 6779 | 日本電波工業         | 18,000    | 706.00    | 12,708,000     |                            |
| 6785 | 鈴木             | 8,300     | 1,115.00  | 9,254,500      | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 6788 | 日本トリム          | 4,000     | 4,120.00  | 16,480,000     |                            |
| 6789 | ローランド ディー. ジー. | 11,000    | 1,865.00  | 20,515,000     |                            |
| 6794 | フォスター電機        | 19,600    | 1,363.00  | 26,714,800     |                            |
| 6798 | SMK            | 4,800     | 2,905.00  | 13,944,000     | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 6800 | ヨコオ            | 14,000    | 2,742.00  | 38,388,000     |                            |
| 6803 | ティアック          | 11,700    | 144.00    | 1,684,800      |                            |
| 6804 | ホシデン           | 51,000    | 1,159.00  | 59,109,000     |                            |
| 6806 | ヒロセ電機          | 28,700    | 17,280.00 | 495,936,000    |                            |
| 6807 | 日本航空電子工業       | 42,800    | 1,771.00  | 75,798,800     |                            |
| 6809 | T O A          | 22,000    | 1,005.00  | 22,110,000     |                            |
| 6810 | マクセルホールディングス   | 37,100    | 1,431.00  | 53,090,100     |                            |
| 6814 | 古野電気           | 24,000    | 1,097.00  | 26,328,000     | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株）   |
| 6815 | ユニデンホールディングス   | 4,800     | 2,630.00  | 12,624,000     |                            |
| 6817 | スミダコーポレーション    | 15,900    | 1,078.00  | 17,140,200     |                            |
| 6820 | アイコム           | 7,700     | 2,938.00  | 22,622,600     |                            |
| 6823 | リオン            | 7,800     | 2,998.00  | 23,384,400     |                            |
| 6826 | 本多通信工業         | 14,500    | 528.00    | 7,656,000      |                            |
| 6839 | 船井電機           | 20,900    | 928.00    | 19,395,200     | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 6841 | 横河電機           | 186,700   | 2,061.00  | 384,788,700    |                            |
| 6844 | 新電元工業          | 7,200     | 3,185.00  | 22,932,000     |                            |
| 6845 | アズビル           | 126,100   | 4,780.00  | 602,758,000    | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |

|      |                  |         |           |               |                            |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 6848 | 東亜ディーケーケー        | 9,200   | 825.00    | 7,590,000     |                            |
| 6849 | 日本光電工業           | 77,100  | 3,230.00  | 249,033,000   |                            |
| 6850 | チノー              | 5,900   | 1,428.00  | 8,425,200     |                            |
| 6853 | 共和電業             | 19,500  | 415.00    | 8,092,500     |                            |
| 6855 | 日本電子材料           | 7,200   | 1,816.00  | 13,075,200    | 貸付有価証券<br>2,300株（600株）     |
| 6856 | 堀場製作所            | 37,000  | 7,080.00  | 261,960,000   | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）   |
| 6857 | アドバンテスト          | 138,700 | 8,820.00  | 1,223,334,000 | 貸付有価証券<br>10,400株（10,400株） |
| 6858 | 小野測器             | 7,800   | 556.00    | 4,336,800     |                            |
| 6859 | エスベック            | 16,500  | 1,875.00  | 30,937,500    |                            |
| 6861 | キーエンス            | 183,100 | 51,470.00 | 9,424,157,000 |                            |
| 6866 | 日置電機             | 8,900   | 4,225.00  | 37,602,500    |                            |
| 6869 | シスメックス           | 145,500 | 11,915.00 | 1,733,632,500 |                            |
| 6871 | 日本マイクロニクス        | 32,500  | 1,754.00  | 57,005,000    |                            |
| 6875 | メガチップス           | 18,700  | 3,445.00  | 64,421,500    |                            |
| 6877 | OBARA GROUP      | 10,900  | 3,850.00  | 41,965,000    | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 6901 | 澤藤電機             | 2,000   | 2,287.00  | 4,574,000     | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| 6904 | 原田工業             | 7,600   | 930.00    | 7,068,000     | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 6905 | コーセル             | 22,800  | 1,079.00  | 24,601,200    |                            |
| 6908 | イリソ電子工業          | 15,700  | 5,200.00  | 81,640,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 6914 | オプテックスグループ       | 30,600  | 1,634.00  | 50,000,400    |                            |
| 6915 | 千代田インテグレ         | 7,800   | 1,935.00  | 15,093,000    |                            |
| 6916 | アイ・オー・データ機器      | 6,900   | 1,049.00  | 7,238,100     | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 6920 | レーザーテック          | 81,900  | 13,450.00 | 1,101,555,000 |                            |
| 6923 | スタンレー電気          | 130,600 | 3,375.00  | 440,775,000   | 貸付有価証券<br>9,900株（9,900株）   |
| 6924 | 岩崎電気             | 6,800   | 1,579.00  | 10,737,200    |                            |
| 6925 | ウシオ電機            | 95,600  | 1,468.00  | 140,340,800   |                            |
| 6926 | 岡谷電機産業           | 13,300  | 415.00    | 5,519,500     | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株）   |
| 6927 | ヘリオス テクノ ホールディング | 17,200  | 381.00    | 6,553,200     | 貸付有価証券<br>2,700株（300株）     |
| 6928 | エノモト             | 5,200   | 2,101.00  | 10,925,200    |                            |
| 6929 | 日本セラミック          | 18,900  | 2,688.00  | 50,803,200    |                            |
| 6932 | 遠藤照明             | 9,400   | 680.00    | 6,392,000     |                            |
| 6937 | 古河電池             | 13,300  | 1,639.00  | 21,798,700    | 貸付有価証券<br>4,200株（1,000株）   |
| 6938 | 双信電機             | 9,000   | 453.00    | 4,077,000     | 貸付有価証券<br>4,300株（2,100株）   |
| 6941 | 山一電機             | 12,200  | 1,476.00  | 18,007,200    |                            |

|      |                     |         |           |               |                              |
|------|---------------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 6947 | 図研                  | 12,100  | 2,784.00  | 33,686,400    |                              |
| 6951 | 日本電子                | 34,000  | 4,250.00  | 144,500,000   |                              |
| 6952 | カシオ計算機              | 150,000 | 2,024.00  | 303,600,000   | 貸付有価証券<br>12,400株（12,400株）   |
| 6954 | ファナック               | 163,700 | 26,205.00 | 4,289,758,500 |                              |
| 6958 | 日本シイエムケイ            | 40,200  | 469.00    | 18,853,800    |                              |
| 6961 | エンプラス               | 8,400   | 4,095.00  | 34,398,000    | 貸付有価証券<br>700株（700株）         |
| 6962 | 大真空                 | 6,300   | 2,467.00  | 15,542,100    |                              |
| 6963 | ローム                 | 77,600  | 10,850.00 | 841,960,000   |                              |
| 6965 | 浜松ホトニクス             | 133,800 | 6,460.00  | 864,348,000   | 貸付有価証券<br>4,800株（4,800株）     |
| 6966 | 三井ハイテック             | 18,300  | 4,175.00  | 76,402,500    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）     |
| 6967 | 新光電気工業              | 62,600  | 3,260.00  | 204,076,000   |                              |
| 6971 | 京セラ                 | 284,300 | 7,272.00  | 2,067,429,600 |                              |
| 6976 | 太陽誘電                | 83,000  | 5,380.00  | 446,540,000   |                              |
| 6981 | 村田製作所               | 548,000 | 8,884.00  | 4,868,432,000 |                              |
| 6986 | 双葉電子工業              | 31,900  | 988.00    | 31,517,200    |                              |
| 6989 | 北陸電気工業              | 7,000   | 996.00    | 6,972,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）         |
| 6996 | ニチコン                | 58,700  | 1,120.00  | 65,744,000    | 貸付有価証券<br>4,700株（4,700株）     |
| 6997 | 日本ケミコン              | 18,800  | 1,849.00  | 34,761,200    |                              |
| 6999 | K O A               | 25,800  | 1,591.00  | 41,047,800    |                              |
| 7244 | 市光工業                | 27,900  | 764.00    | 21,315,600    | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）     |
| 7276 | 小糸製作所               | 111,800 | 7,440.00  | 831,792,000   |                              |
| 7280 | ミツバ                 | 34,300  | 655.00    | 22,466,500    | 貸付有価証券<br>8,200株             |
| 7735 | S C R E E Nホールディングス | 32,400  | 9,240.00  | 299,376,000   |                              |
| 7739 | キャノン電子              | 17,100  | 1,741.00  | 29,771,100    |                              |
| 7751 | キャノン                | 927,000 | 2,462.50  | 2,282,737,500 | 貸付有価証券<br>253,000株（253,000株） |
| 7752 | リコー                 | 474,600 | 1,157.00  | 549,112,200   |                              |
| 7965 | 象印マホービン             | 50,500  | 1,925.00  | 97,212,500    | 貸付有価証券<br>3,300株（3,300株）     |
| 7999 | M U T O Hホールディングス   | 2,300   | 1,737.00  | 3,995,100     |                              |
| 8035 | 東京エレクトロン            | 109,300 | 43,590.00 | 4,764,387,000 |                              |
| 3116 | トヨタ紡織               | 54,300  | 1,834.00  | 99,586,200    |                              |
| 3526 | 芦森工業                | 3,500   | 1,068.00  | 3,738,000     |                              |
| 5949 | ユニプレス               | 30,600  | 1,122.00  | 34,333,200    | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）     |
| 6201 | 豊田自動織機              | 151,000 | 9,810.00  | 1,481,310,000 |                              |
| 6455 | モリタホールディングス         | 29,900  | 1,773.00  | 53,012,700    | 貸付有価証券<br>5,900株（5,900株）     |

|      |               |           |          |                |                              |
|------|---------------|-----------|----------|----------------|------------------------------|
| 6584 | 三櫻工業          | 25,800    | 1,241.00 | 32,017,800     | 貸付有価証券<br>5,900株（5,900株）     |
| 6902 | デンソー          | 410,700   | 7,153.00 | 2,937,737,100  |                              |
| 6995 | 東海理化電機製作所     | 49,100    | 1,897.00 | 93,142,700     | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株）     |
| 7003 | 三井Ｅ＆Ｓホールディングス | 72,200    | 561.00   | 40,504,200     | 貸付有価証券<br>5,100株（5,100株）     |
| 7012 | 川崎重工業         | 145,200   | 2,709.00 | 393,346,800    | 貸付有価証券<br>10,900株（10,900株）   |
| 7014 | 名村造船所         | 56,000    | 224.00   | 12,544,000     | 貸付有価証券<br>15,200株（15,200株）   |
| 7022 | サノヤスホールディングス  | 22,800    | 167.00   | 3,807,600      | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）     |
| 7102 | 日本車輛製造        | 6,800     | 2,487.00 | 16,911,600     |                              |
| 7105 | 三菱ロジスネクスト     | 24,700    | 1,287.00 | 31,788,900     |                              |
| 7122 | 近畿車輛          | 3,200     | 1,334.00 | 4,268,800      | 貸付有価証券<br>600株（600株）         |
| 7201 | 日産自動車         | 2,200,100 | 591.40   | 1,301,139,140  | 貸付有価証券<br>49,400株（49,400株）   |
| 7202 | いすゞ自動車        | 540,500   | 1,163.00 | 628,601,500    |                              |
| 7203 | トヨタ自動車        | 1,889,800 | 8,157.00 | 15,415,098,600 |                              |
| 7205 | 日野自動車         | 232,900   | 949.00   | 221,022,100    |                              |
| 7211 | 三菱自動車工業       | 690,500   | 302.00   | 208,531,000    | 貸付有価証券<br>173,800株（173,800株） |
| 7212 | エフテック         | 13,000    | 703.00   | 9,139,000      | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）     |
| 7213 | レシップホールディングス  | 7,400     | 580.00   | 4,292,000      |                              |
| 7214 | GMB           | 3,300     | 959.00   | 3,164,700      |                              |
| 7215 | ファルテック        | 3,300     | 853.00   | 2,814,900      | 貸付有価証券<br>100株               |
| 7220 | 武蔵精密工業        | 41,600    | 1,909.00 | 79,414,400     |                              |
| 7222 | 日産車体          | 27,300    | 821.00   | 22,413,300     |                              |
| 7224 | 新明和工業         | 52,700    | 1,049.00 | 55,282,300     |                              |
| 7226 | 極東開発工業        | 32,200    | 1,678.00 | 54,031,600     | 貸付有価証券<br>8,700株（8,700株）     |
| 7231 | トピー工業         | 15,300    | 1,383.00 | 21,159,900     | 貸付有価証券<br>3,800株（3,800株）     |
| 7236 | ティラド          | 5,800     | 2,169.00 | 12,580,200     |                              |
| 7238 | 曙ブレーキ工業       | 102,400   | 192.00   | 19,660,800     | 貸付有価証券<br>50,000株（25,700株）   |
| 7239 | タチエス          | 28,600    | 1,280.00 | 36,608,000     | 貸付有価証券<br>7,600株（7,600株）     |
| 7240 | N O K         | 90,200    | 1,547.00 | 139,539,400    |                              |
| 7241 | フタバ産業         | 46,700    | 608.00   | 28,393,600     |                              |
| 7242 | K Y B         | 20,900    | 3,040.00 | 63,536,000     |                              |
| 7245 | 大同メタル工業       | 38,500    | 599.00   | 23,061,500     |                              |
| 7246 | プレス工業         | 92,400    | 343.00   | 31,693,200     |                              |



|      |             |           |           |               |                          |
|------|-------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| 7247 | ミクニ         | 23,700    | 317.00    | 7,512,900     |                          |
| 7250 | 太平洋工業       | 39,100    | 1,292.00  | 50,517,200    | 貸付有価証券<br>7,000株（7,000株） |
| 7256 | 河西工業        | 25,200    | 456.00    | 11,491,200    | 貸付有価証券<br>1,900株（1,900株） |
| 7259 | アイシン精機      | 136,500   | 4,075.00  | 556,237,500   |                          |
| 7261 | マツダ         | 585,500   | 868.00    | 508,214,000   |                          |
| 7266 | 今仙電機製作所     | 16,300    | 778.00    | 12,681,400    | 貸付有価証券<br>5,400株（1,300株） |
| 7267 | 本田技研工業      | 1,468,800 | 3,276.00  | 4,811,788,800 |                          |
| 7269 | スズキ         | 369,800   | 4,760.00  | 1,760,248,000 |                          |
| 7270 | S U B A R U | 534,600   | 2,137.50  | 1,142,707,500 |                          |
| 7271 | 安永          | 9,000     | 1,312.00  | 11,808,000    | 貸付有価証券<br>2,800株（700株）   |
| 7272 | ヤマハ発動機      | 263,600   | 2,641.00  | 696,167,600   |                          |
| 7277 | T B K       | 22,200    | 442.00    | 9,812,400     |                          |
| 7278 | エクセディ       | 25,300    | 1,725.00  | 43,642,500    |                          |
| 7282 | 豊田合成        | 60,200    | 2,919.00  | 175,723,800   |                          |
| 7283 | 愛三工業        | 29,200    | 655.00    | 19,126,000    |                          |
| 7284 | 盟和産業        | 2,800     | 920.00    | 2,576,000     |                          |
| 7291 | 日本プラスト      | 15,700    | 615.00    | 9,655,500     | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 7294 | ヨロズ         | 16,000    | 1,356.00  | 21,696,000    | 貸付有価証券<br>4,400株（4,400株） |
| 7296 | エフ・シー・シー    | 30,500    | 1,931.00  | 58,895,500    |                          |
| 7309 | シマノ         | 69,800    | 25,380.00 | 1,771,524,000 |                          |
| 7313 | テイ・エス テック   | 43,300    | 3,335.00  | 144,405,500   |                          |
| 7408 | ジャムコ        | 10,900    | 1,008.00  | 10,987,200    | 貸付有価証券<br>700株（700株）     |
| 4543 | テルモ         | 571,900   | 3,871.00  | 2,213,824,900 |                          |
| 5187 | クリエートメディック  | 6,200     | 1,004.00  | 6,224,800     |                          |
| 6376 | 日機装         | 60,200    | 1,147.00  | 69,049,400    |                          |
| 7600 | 日本エム・ディ・エム  | 10,700    | 2,250.00  | 24,075,000    |                          |
| 7701 | 島津製作所       | 240,100   | 3,980.00  | 955,598,000   |                          |
| 7702 | J M S       | 15,800    | 915.00    | 14,457,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |
| 7709 | クボテック       | 4,800     | 370.00    | 1,776,000     | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |
| 7715 | 長野計器        | 13,500    | 961.00    | 12,973,500    |                          |
| 7717 | ブイ・テクノロジー   | 8,700     | 5,420.00  | 47,154,000    |                          |
| 7721 | 東京計器        | 11,900    | 968.00    | 11,519,200    | 貸付有価証券<br>900株（900株）     |
| 7723 | 愛知時計電機      | 2,500     | 4,375.00  | 10,937,500    |                          |
| 7725 | インターアクション   | 9,300     | 2,330.00  | 21,669,000    |                          |
| 7727 | オーバル        | 16,700    | 301.00    | 5,026,700     | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |

|      |                   |           |           |               |                            |
|------|-------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| 7729 | 東京精密              | 31,400    | 5,140.00  | 161,396,000   |                            |
| 7730 | マニー               | 74,300    | 2,645.00  | 196,523,500   | 貸付有価証券<br>5,600株（5,600株）   |
| 7731 | ニコン               | 284,900   | 1,087.00  | 309,686,300   | 貸付有価証券<br>22,700株（22,700株） |
| 7732 | トプコン              | 94,000    | 1,340.00  | 125,960,000   | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 7733 | オリンパス             | 1,032,200 | 2,271.50  | 2,344,642,300 |                            |
| 7734 | 理研計器              | 16,400    | 2,851.00  | 46,756,400    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 7740 | タムロン              | 15,000    | 2,156.00  | 32,340,000    |                            |
| 7741 | HOYA              | 370,100   | 12,735.00 | 4,713,223,500 |                            |
| 7743 | シード               | 7,900     | 714.00    | 5,640,600     |                            |
| 7744 | ノーリツ銅機            | 16,800    | 2,698.00  | 45,326,400    |                            |
| 7745 | エー・アンド・ディ         | 15,700    | 1,198.00  | 18,808,600    | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）   |
| 7747 | 朝日インテック           | 196,300   | 3,100.00  | 608,530,000   | 貸付有価証券<br>11,900株（11,900株） |
| 7762 | シチズン時計            | 236,700   | 398.00    | 94,206,600    | 貸付有価証券<br>16,300株（16,300株） |
| 7769 | リズム               | 5,800     | 880.00    | 5,104,000     | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 7775 | 大研医器              | 14,800    | 613.00    | 9,072,400     |                            |
| 7780 | メニコン              | 28,700    | 6,210.00  | 178,227,000   |                            |
| 7782 | シンシア              | 2,000     | 846.00    | 1,692,000     |                            |
| 7979 | 松風                | 8,600     | 1,958.00  | 16,838,800    |                            |
| 8050 | セイコーホールディングス      | 26,400    | 1,946.00  | 51,374,400    | 貸付有価証券<br>6,600株（6,600株）   |
| 8086 | ニプロ               | 139,000   | 1,355.00  | 188,345,000   | 貸付有価証券<br>32,500株（32,500株） |
| 7811 | 中本パックス            | 4,700     | 1,670.00  | 7,849,000     |                            |
| 7816 | スノーピーク            | 11,000    | 3,280.00  | 36,080,000    | 貸付有価証券<br>2,100株           |
| 7817 | パラマウントベッドホールディングス | 17,900    | 4,760.00  | 85,204,000    |                            |
| 7818 | トランザクション          | 10,200    | 1,231.00  | 12,556,200    |                            |
| 7819 | 粧美堂               | 5,400     | 406.00    | 2,192,400     |                            |
| 7820 | ニホンフラッシュ          | 16,000    | 1,371.00  | 21,936,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 7821 | 前田工繊              | 20,600    | 3,285.00  | 67,671,000    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）   |
| 7822 | 永大産業              | 24,400    | 307.00    | 7,490,800     |                            |
| 7823 | アートネイチャー          | 17,900    | 716.00    | 12,816,400    |                            |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス   | 154,300   | 7,823.00  | 1,207,088,900 |                            |
| 7833 | アイフィスジャパン         | 4,700     | 765.00    | 3,595,500     |                            |
| 7838 | 共立印刷              | 31,200    | 142.00    | 4,430,400     |                            |
| 7839 | SHOEI             | 16,300    | 4,630.00  | 75,469,000    |                            |
| 7840 | フランスベッドホールディングス   | 24,000    | 1,034.00  | 24,816,000    |                            |

|      |                  |         |           |               |                            |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 7846 | パイロットコーポレーション    | 33,000  | 3,580.00  | 118,140,000   |                            |
| 7856 | 萩原工業             | 10,400  | 1,436.00  | 14,934,400    |                            |
| 7862 | トッパン・フォームズ       | 33,300  | 1,185.00  | 39,460,500    |                            |
| 7864 | フジシールインターナショナル   | 38,300  | 2,527.00  | 96,784,100    |                            |
| 7867 | タカラトミー           | 83,700  | 1,050.00  | 87,885,000    |                            |
| 7868 | 廣済堂              | 13,000  | 1,010.00  | 13,130,000    |                            |
| 7872 | エステールホールディングス    | 5,000   | 704.00    | 3,520,000     |                            |
| 7885 | タカノ              | 6,400   | 621.00    | 3,974,400     |                            |
| 7893 | プロネクサス           | 16,000  | 1,297.00  | 20,752,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 7897 | ホクシン             | 11,500  | 120.00    | 1,380,000     | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| 7898 | ウッドワン            | 6,300   | 1,201.00  | 7,566,300     |                            |
| 7905 | 大建工業             | 12,500  | 2,331.00  | 29,137,500    |                            |
| 7911 | 凸版印刷             | 283,600 | 1,936.00  | 549,049,600   |                            |
| 7912 | 大日本印刷            | 225,300 | 2,416.00  | 544,324,800   |                            |
| 7914 | 共同印刷             | 5,700   | 3,165.00  | 18,040,500    |                            |
| 7915 | N I S S H A      | 38,300  | 1,384.00  | 53,007,200    | 貸付有価証券<br>9,600株（9,600株）   |
| 7916 | 光村印刷             | 1,600   | 1,802.00  | 2,883,200     |                            |
| 7921 | TAKARA & COMPANY | 9,100   | 1,826.00  | 16,616,600    |                            |
| 7936 | アシックス            | 165,000 | 1,859.00  | 306,735,000   | 貸付有価証券<br>38,800株（38,800株） |
| 7937 | ツツミ              | 4,700   | 2,180.00  | 10,246,000    |                            |
| 7944 | ローランド            | 10,800  | 4,200.00  | 45,360,000    |                            |
| 7949 | 小松ウオール工業         | 5,700   | 2,066.00  | 11,776,200    |                            |
| 7951 | ヤマハ              | 110,900 | 6,120.00  | 678,708,000   |                            |
| 7952 | 河合楽器製作所          | 5,200   | 3,595.00  | 18,694,000    |                            |
| 7955 | クリナップ            | 17,300  | 550.00    | 9,515,000     |                            |
| 7956 | ビジョン             | 119,800 | 4,160.00  | 498,368,000   | 貸付有価証券<br>8,400株（8,400株）   |
| 7959 | オリバー             | 3,900   | 2,774.00  | 10,818,600    | 貸付有価証券<br>900株             |
| 7961 | 兼松サステック          | 1,200   | 1,820.00  | 2,184,000     |                            |
| 7962 | キングジム            | 15,500  | 931.00    | 14,430,500    |                            |
| 7966 | リンテック            | 39,900  | 2,537.00  | 101,226,300   |                            |
| 7972 | イトーキ             | 37,000  | 420.00    | 15,540,000    |                            |
| 7974 | 任天堂              | 106,800 | 62,310.00 | 6,654,708,000 |                            |
| 7976 | 三菱鉛筆             | 30,700  | 1,656.00  | 50,839,200    | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）   |
| 7981 | タカラスタANDARD      | 38,500  | 1,710.00  | 65,835,000    | 貸付有価証券<br>9,700株（9,700株）   |
| 7984 | コクヨ              | 89,500  | 1,725.00  | 154,387,500   |                            |
| 7987 | ナカバヤシ            | 18,300  | 640.00    | 11,712,000    |                            |
| 7990 | グローブライド          | 9,000   | 4,220.00  | 37,980,000    |                            |

|      |              |           |          |               |                              |
|------|--------------|-----------|----------|---------------|------------------------------|
| 7994 | オカムラ         | 64,100    | 1,292.00 | 82,817,200    | 貸付有価証券<br>4,900株（4,900株）     |
| 8022 | 美津濃          | 18,500    | 2,276.00 | 42,106,000    |                              |
| 9501 | 東京電力ホールディングス | 1,582,300 | 376.00   | 594,944,800   | 貸付有価証券<br>375,100株（375,100株） |
| 9502 | 中部電力         | 570,700   | 1,456.50 | 831,224,550   |                              |
| 9503 | 関西電力         | 706,800   | 1,255.00 | 887,034,000   |                              |
| 9504 | 中国電力         | 269,100   | 1,401.00 | 377,009,100   |                              |
| 9505 | 北陸電力         | 170,500   | 763.00   | 130,091,500   |                              |
| 9506 | 東北電力         | 436,900   | 1,099.00 | 480,153,100   |                              |
| 9507 | 四国電力         | 155,000   | 894.00   | 138,570,000   | 貸付有価証券<br>12,600株（12,600株）   |
| 9508 | 九州電力         | 412,000   | 1,125.00 | 463,500,000   |                              |
| 9509 | 北海道電力        | 174,600   | 530.00   | 92,538,000    |                              |
| 9511 | 沖縄電力         | 36,300    | 1,602.00 | 58,152,600    |                              |
| 9513 | 電源開発         | 148,400   | 1,983.00 | 294,277,200   |                              |
| 9514 | エフオン         | 11,300    | 1,059.00 | 11,966,700    |                              |
| 9517 | イーレックス       | 27,400    | 1,886.00 | 51,676,400    |                              |
| 9519 | レノバ          | 31,600    | 3,195.00 | 100,962,000   | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）     |
| 9531 | 東京瓦斯         | 358,700   | 2,511.00 | 900,695,700   |                              |
| 9532 | 大阪瓦斯         | 337,900   | 2,203.00 | 744,393,700   |                              |
| 9533 | 東邦瓦斯         | 91,700    | 6,680.00 | 612,556,000   | 貸付有価証券<br>6,900株（6,900株）     |
| 9534 | 北海道瓦斯        | 10,000    | 1,703.00 | 17,030,000    |                              |
| 9535 | 広島ガス         | 38,500    | 407.00   | 15,669,500    |                              |
| 9536 | 西部瓦斯         | 21,000    | 3,110.00 | 65,310,000    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）     |
| 9543 | 静岡ガス         | 53,000    | 989.00   | 52,417,000    |                              |
| 9551 | メタウォーター      | 21,000    | 2,247.00 | 47,187,000    |                              |
| 2384 | SBSホールディングス  | 13,800    | 2,775.00 | 38,295,000    |                              |
| 9001 | 東武鉄道         | 194,400   | 3,040.00 | 590,976,000   |                              |
| 9003 | 相鉄ホールディングス   | 63,900    | 2,545.00 | 162,625,500   | 貸付有価証券<br>4,500株（4,500株）     |
| 9005 | 東急           | 470,500   | 1,462.00 | 687,871,000   |                              |
| 9006 | 京浜急行電鉄       | 239,600   | 1,716.00 | 411,153,600   |                              |
| 9007 | 小田急電鉄        | 298,800   | 3,025.00 | 903,870,000   | 貸付有価証券<br>20,900株（20,900株）   |
| 9008 | 京王電鉄         | 104,200   | 7,370.00 | 767,954,000   | 貸付有価証券<br>3,600株（3,600株）     |
| 9009 | 京成電鉄         | 139,800   | 3,565.00 | 498,387,000   |                              |
| 9010 | 富士急行         | 25,400    | 6,030.00 | 153,162,000   | 貸付有価証券<br>6,400株（6,400株）     |
| 9014 | 新京成電鉄        | 4,800     | 2,279.00 | 10,939,200    |                              |
| 9020 | 東日本旅客鉄道      | 328,300   | 7,946.00 | 2,608,671,800 |                              |

|      |                  |         |           |               |                            |
|------|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 9021 | 西日本旅客鉄道          | 166,200 | 6,283.00  | 1,044,234,600 |                            |
| 9022 | 東海旅客鉄道           | 155,100 | 16,995.00 | 2,635,924,500 |                            |
| 9024 | 西武ホールディングス       | 224,800 | 1,220.00  | 274,256,000   | 貸付有価証券<br>18,700株（18,700株） |
| 9025 | 鴻池運輸             | 29,700  | 1,236.00  | 36,709,200    |                            |
| 9031 | 西日本鉄道            | 51,700  | 3,085.00  | 159,494,500   | 貸付有価証券<br>11,700株（11,700株） |
| 9037 | ハマキョウレックス        | 14,300  | 3,425.00  | 48,977,500    |                            |
| 9039 | サカイ引越センター        | 8,600   | 5,180.00  | 44,548,000    |                            |
| 9041 | 近鉄グループホールディングス   | 176,700 | 4,390.00  | 775,713,000   | 貸付有価証券<br>44,500株（44,500株） |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス     | 235,600 | 3,620.00  | 852,872,000   |                            |
| 9044 | 南海電気鉄道           | 83,700  | 2,626.00  | 219,796,200   | 貸付有価証券<br>6,300株（6,300株）   |
| 9045 | 京阪ホールディングス       | 78,700  | 4,675.00  | 367,922,500   |                            |
| 9046 | 神戸電鉄             | 4,200   | 3,745.00  | 15,729,000    |                            |
| 9048 | 名古屋鉄道            | 145,300 | 2,681.00  | 389,549,300   |                            |
| 9052 | 山陽電気鉄道           | 12,600  | 2,009.00  | 25,313,400    |                            |
| 9055 | アルプス物流           | 12,300  | 975.00    | 11,992,500    |                            |
| 9062 | 日本通運             | 61,200  | 8,350.00  | 511,020,000   |                            |
| 9064 | ヤマトホールディングス      | 247,600 | 3,030.00  | 750,228,000   |                            |
| 9065 | 山九               | 45,300  | 5,090.00  | 230,577,000   |                            |
| 9067 | 丸運               | 10,100  | 288.00    | 2,908,800     |                            |
| 9068 | 丸全昭和運輸           | 14,300  | 3,455.00  | 49,406,500    |                            |
| 9069 | センコーグループホールディングス | 97,400  | 1,088.00  | 105,971,200   |                            |
| 9070 | トナミホールディングス      | 4,200   | 5,750.00  | 24,150,000    |                            |
| 9072 | ニッコンホールディングス     | 59,300  | 2,313.00  | 137,160,900   |                            |
| 9074 | 日本石油輸送           | 1,900   | 2,729.00  | 5,185,100     |                            |
| 9075 | 福山通運             | 22,600  | 4,675.00  | 105,655,000   | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）   |
| 9076 | セイノーホールディングス     | 132,300 | 1,559.00  | 206,255,700   |                            |
| 9078 | エスライン            | 4,800   | 951.00    | 4,564,800     |                            |
| 9081 | 神奈川中央交通          | 4,400   | 3,840.00  | 16,896,000    |                            |
| 9086 | 日立物流             | 38,800  | 3,710.00  | 143,948,000   |                            |
| 9090 | 丸和運輸機関           | 37,300  | 1,914.00  | 71,392,200    | 貸付有価証券<br>11,600株（2,800株）  |
| 9099 | C＆Fロジホールディングス    | 17,900  | 1,791.00  | 32,058,900    | 貸付有価証券<br>5,500株（1,300株）   |
| 9142 | 九州旅客鉄道           | 136,700 | 2,697.00  | 368,679,900   | 貸付有価証券<br>11,800株（11,800株） |
| 9143 | S Gホールディングス      | 333,800 | 2,554.00  | 852,525,200   |                            |
| 9101 | 日本郵船             | 147,700 | 3,815.00  | 563,475,500   |                            |
| 9104 | 商船三井             | 104,800 | 3,975.00  | 416,580,000   |                            |
| 9107 | 川崎汽船             | 54,400  | 2,507.00  | 136,380,800   | 貸付有価証券<br>13,100株（13,100株） |
| 9110 | N Sユナイテッド海運      | 8,300   | 1,983.00  | 16,458,900    |                            |

|      |                |         |          |               |                             |
|------|----------------|---------|----------|---------------|-----------------------------|
| 9115 | 明治海運           | 18,800  | 521.00   | 9,794,800     |                             |
| 9119 | 飯野海運           | 82,000  | 557.00   | 45,674,000    |                             |
| 9130 | 共栄タンカー         | 3,100   | 1,140.00 | 3,534,000     |                             |
| 9308 | 乾汽船            | 9,100   | 1,123.00 | 10,219,300    |                             |
| 9201 | 日本航空           | 430,400 | 2,420.00 | 1,041,568,000 | 貸付有価証券<br>101,000株（24,200株） |
| 9202 | A N Aホールディングス  | 476,800 | 2,506.50 | 1,195,099,200 | 貸付有価証券<br>158,000株（81,400株） |
| 9232 | パスコ            | 3,400   | 1,515.00 | 5,151,000     | 貸付有価証券<br>800株              |
| 9058 | トランコム          | 5,400   | 9,040.00 | 48,816,000    |                             |
| 9066 | 日新             | 14,100  | 1,543.00 | 21,756,300    |                             |
| 9301 | 三菱倉庫           | 61,100  | 3,430.00 | 209,573,000   | 貸付有価証券<br>14,100株（14,100株）  |
| 9302 | 三井倉庫ホールディングス   | 18,700  | 2,229.00 | 41,682,300    |                             |
| 9303 | 住友倉庫           | 63,500  | 1,541.00 | 97,853,500    |                             |
| 9304 | 澁澤倉庫           | 9,700   | 2,311.00 | 22,416,700    |                             |
| 9306 | 東陽倉庫           | 29,600  | 369.00   | 10,922,400    |                             |
| 9310 | 日本トランスシティ      | 38,900  | 582.00   | 22,639,800    |                             |
| 9312 | ケイヒン           | 3,400   | 1,450.00 | 4,930,000     |                             |
| 9319 | 中央倉庫           | 10,800  | 1,203.00 | 12,992,400    |                             |
| 9322 | 川西倉庫           | 3,200   | 1,297.00 | 4,150,400     |                             |
| 9324 | 安田倉庫           | 14,500  | 1,002.00 | 14,529,000    | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株）    |
| 9325 | ファイズホールディングス   | 3,100   | 914.00   | 2,833,400     | 貸付有価証券<br>900株              |
| 9351 | 東洋埠頭           | 5,400   | 1,566.00 | 8,456,400     |                             |
| 9358 | 宇徳             | 12,600  | 537.00   | 6,766,200     |                             |
| 9364 | 上組             | 98,600  | 2,181.00 | 215,046,600   |                             |
| 9366 | サンリツ           | 4,500   | 748.00   | 3,366,000     |                             |
| 9368 | キムラユニティー       | 4,700   | 1,229.00 | 5,776,300     |                             |
| 9369 | キューソー流通システム    | 4,400   | 1,672.00 | 7,356,800     |                             |
| 9375 | 近鉄エクスプレス       | 33,400  | 2,701.00 | 90,213,400    |                             |
| 9380 | 東海運            | 10,100  | 367.00   | 3,706,700     |                             |
| 9381 | エーアイテイー        | 11,100  | 1,001.00 | 11,111,100    | 貸付有価証券<br>3,000株            |
| 9384 | 内外トランスライン      | 6,200   | 1,469.00 | 9,107,800     |                             |
| 9386 | 日本コンセプト        | 5,600   | 1,822.00 | 10,203,200    |                             |
| 1973 | N E C ネットズエスアイ | 60,500  | 2,009.00 | 121,544,500   |                             |
| 2307 | クロスキャット        | 4,800   | 1,146.00 | 5,500,800     | 貸付有価証券<br>1,500株（400株）      |
| 2317 | システナ           | 65,300  | 2,191.00 | 143,072,300   | 貸付有価証券<br>4,900株（4,900株）    |
| 2326 | デジタルアーツ        | 10,600  | 9,490.00 | 100,594,000   |                             |

|      |                      |         |          |               |                          |
|------|----------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 2327 | 日鉄ソリューションズ           | 27,400  | 3,575.00 | 97,955,000    |                          |
| 2335 | キューブシステム             | 9,700   | 1,167.00 | 11,319,900    | 貸付有価証券<br>3,000株（700株）   |
| 2352 | エイジア                 | 2,800   | 1,742.00 | 4,877,600     | 貸付有価証券<br>500株（300株）     |
| 2359 | コア                   | 7,700   | 1,529.00 | 11,773,300    | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 3031 | ラクーンホールディングス         | 13,000  | 2,174.00 | 28,262,000    | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| 3040 | ソリトンシステムズ            | 9,100   | 1,626.00 | 14,796,600    |                          |
| 3371 | ソフトクリエイトホールディングス     | 7,200   | 2,765.00 | 19,908,000    | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 3626 | T I S                | 183,000 | 2,564.00 | 469,212,000   |                          |
| 3627 | J N Sホールディングス        | 8,900   | 592.00   | 5,268,800     |                          |
| 3630 | 電算システム               | 6,900   | 3,135.00 | 21,631,500    |                          |
| 3632 | グリー                  | 112,200 | 571.00   | 64,066,200    | 貸付有価証券<br>9,500株（9,500株） |
| 3633 | GMOペパボ               | 1,200   | 7,740.00 | 9,288,000     |                          |
| 3635 | コーエーテクモホールディングス      | 37,400  | 6,580.00 | 246,092,000   |                          |
| 3636 | 三菱総合研究所              | 7,800   | 4,230.00 | 32,994,000    |                          |
| 3639 | ボルテージ                | 4,900   | 560.00   | 2,744,000     |                          |
| 3640 | 電算                   | 2,000   | 2,705.00 | 5,410,000     |                          |
| 3648 | A G S                | 9,300   | 865.00   | 8,044,500     |                          |
| 3649 | ファインデックス             | 15,400  | 1,083.00 | 16,678,200    | 貸付有価証券<br>3,700株         |
| 3655 | ブレインパッド              | 4,700   | 5,550.00 | 26,085,000    |                          |
| 3656 | K L a b              | 33,400  | 795.00   | 26,553,000    |                          |
| 3657 | ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ | 24,300  | 1,404.00 | 34,117,200    |                          |
| 3658 | イーブックイニシアティブジャパン     | 3,000   | 2,597.00 | 7,791,000     | 貸付有価証券<br>600株           |
| 3659 | ネクソン                 | 462,400 | 3,520.00 | 1,627,648,000 |                          |
| 3660 | アイスタイル               | 55,800  | 485.00   | 27,063,000    | 貸付有価証券<br>11,100株        |
| 3661 | エムアップホールディングス        | 4,800   | 2,857.00 | 13,713,600    |                          |
| 3662 | エイチーム                | 12,600  | 1,766.00 | 22,251,600    |                          |
| 3665 | エニグモ                 | 17,300  | 1,431.00 | 24,756,300    |                          |
| 3666 | テクノスジャパン             | 14,200  | 692.00   | 9,826,400     |                          |
| 3667 | e n i s h            | 9,500   | 528.00   | 5,016,000     |                          |
| 3668 | コロプラ                 | 60,100  | 853.00   | 51,265,300    | 貸付有価証券<br>7,600株（3,300株） |
| 3672 | オルトプラス               | 11,100  | 486.00   | 5,394,600     | 貸付有価証券<br>3,200株（3,200株） |
| 3673 | ブロードリーフ              | 90,700  | 554.00   | 50,247,800    | 貸付有価証券<br>6,800株（6,800株） |
| 3675 | クロス・マーケティンググループ      | 8,100   | 449.00   | 3,636,900     | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |

|      |                      |        |           |             |                            |
|------|----------------------|--------|-----------|-------------|----------------------------|
| 3676 | デジタルハーツホールディングス      | 8,300  | 1,502.00  | 12,466,600  | 貸付有価証券<br>2,300株           |
| 3677 | システム情報               | 13,700 | 1,031.00  | 14,124,700  | 貸付有価証券<br>2,900株           |
| 3678 | メディアドゥ               | 7,100  | 6,140.00  | 43,594,000  | 貸付有価証券<br>1,800株（400株）     |
| 3679 | じげん                  | 45,300 | 429.00    | 19,433,700  |                            |
| 3681 | ブイキューブ               | 10,000 | 2,452.00  | 24,520,000  | 貸付有価証券<br>2,700株           |
| 3682 | エンカレッジ・テクノロジー        | 3,200  | 669.00    | 2,140,800   | 貸付有価証券<br>700株             |
| 3683 | サイバーリンクス             | 6,000  | 1,638.00  | 9,828,000   | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 3686 | ディー・エル・イー            | 14,700 | 318.00    | 4,674,600   | 貸付有価証券<br>4,000株（1,000株）   |
| 3687 | フィックスターズ             | 19,500 | 1,042.00  | 20,319,000  | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| 3688 | CART A HOLDINGS      | 7,400  | 1,546.00  | 11,440,400  |                            |
| 3694 | オプティム                | 12,800 | 2,837.00  | 36,313,600  | 貸付有価証券<br>2,400株（2,400株）   |
| 3696 | セレス                  | 6,000  | 4,385.00  | 26,310,000  | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 3697 | SH I F T             | 8,200  | 12,810.00 | 105,042,000 |                            |
| 3738 | ティーガイア               | 19,500 | 2,003.00  | 39,058,500  |                            |
| 3741 | セック                  | 2,700  | 2,810.00  | 7,587,000   | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| 3751 | 日本アジアグループ            | 17,700 | 1,019.00  | 18,036,300  |                            |
| 3762 | テクマトリックス             | 28,400 | 1,938.00  | 55,039,200  |                            |
| 3763 | プロシップ                | 5,300  | 1,407.00  | 7,457,100   |                            |
| 3765 | ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 44,100 | 2,182.00  | 96,226,200  | 貸付有価証券<br>11,000株（11,000株） |
| 3769 | GMOペイメントゲートウェイ       | 39,100 | 14,280.00 | 558,348,000 | 貸付有価証券<br>5,100株（5,100株）   |
| 3770 | ザッパラス                | 7,100  | 431.00    | 3,060,100   | 貸付有価証券<br>3,900株（1,700株）   |
| 3771 | システムリサーチ             | 5,300  | 2,103.00  | 11,145,900  | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 3774 | インターネットイニシアティブ       | 48,700 | 2,543.00  | 123,844,100 |                            |
| 3778 | さくらインターネット           | 19,600 | 790.00    | 15,484,000  |                            |
| 3784 | ヴィンクス                | 5,100  | 1,113.00  | 5,676,300   | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 3788 | GMOグローバルサイン・ホールディングス | 4,100  | 6,700.00  | 27,470,000  | 貸付有価証券<br>800株             |
| 3817 | S R Aホールディングス        | 9,700  | 2,714.00  | 26,325,800  |                            |
| 3826 | システムインテグレータ          | 5,100  | 638.00    | 3,253,800   | 貸付有価証券<br>2,800株（1,500株）   |
| 3834 | 朝日ネット                | 14,800 | 818.00    | 12,106,400  |                            |
| 3835 | e B A S E            | 21,900 | 950.00    | 20,805,000  | 貸付有価証券<br>6,800株（1,600株）   |



|      |                       |        |          |            |                          |
|------|-----------------------|--------|----------|------------|--------------------------|
| 3836 | アバント                  | 19,600 | 1,530.00 | 29,988,000 |                          |
| 3837 | アドソル日進                | 6,500  | 2,820.00 | 18,330,000 | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| 3839 | ODKソリューションズ           | 2,800  | 745.00   | 2,086,000  |                          |
| 3843 | フリービット                | 10,800 | 942.00   | 10,173,600 | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| 3844 | コムチュア                 | 16,800 | 2,715.00 | 45,612,000 | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株） |
| 3852 | サイバーコム                | 3,300  | 1,590.00 | 5,247,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 3853 | アステリア                 | 13,200 | 799.00   | 10,546,800 | 貸付有価証券<br>800株（800株）     |
| 3854 | アイル                   | 10,200 | 1,668.00 | 17,013,600 | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| 3901 | マークライنز               | 7,600  | 2,445.00 | 18,582,000 |                          |
| 3902 | メディカル・データ・ビジョン        | 20,900 | 2,070.00 | 43,263,000 | 貸付有価証券<br>5,500株（1,000株） |
| 3903 | g u m i               | 25,300 | 908.00   | 22,972,400 | 貸付有価証券<br>5,900株（5,900株） |
| 3909 | ショーケース                | 3,900  | 923.00   | 3,599,700  | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| 3912 | モバイルファクトリー            | 4,100  | 1,534.00 | 6,289,400  | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 3915 | テラスカイ                 | 5,900  | 3,285.00 | 19,381,500 |                          |
| 3916 | デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 8,100  | 2,013.00 | 16,305,300 |                          |
| 3918 | P C I ホールディングス        | 6,900  | 1,389.00 | 9,584,100  | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 3919 | パイブドHD                | 3,800  | 1,804.00 | 6,855,200  |                          |
| 3920 | アイビーシー                | 3,000  | 1,010.00 | 3,030,000  | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 3921 | ネオジャパン                | 3,500  | 1,608.00 | 5,628,000  | 貸付有価証券<br>800株           |
| 3922 | P R T I M E S         | 3,900  | 3,185.00 | 12,421,500 |                          |
| 3923 | ラクス                   | 42,900 | 2,066.00 | 88,631,400 |                          |
| 3924 | ランドコンピュータ             | 2,800  | 1,189.00 | 3,329,200  |                          |
| 3925 | ダブルスタンダード             | 2,400  | 4,140.00 | 9,936,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 3926 | オーブンドア                | 10,900 | 1,806.00 | 19,685,400 | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| 3928 | マイネット                 | 6,000  | 811.00   | 4,866,000  | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 3932 | アカツキ                  | 7,300  | 4,380.00 | 31,974,000 | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 3934 | ベネフィットジャパン            | 1,400  | 1,821.00 | 2,549,400  | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| 3937 | U b i c o mホールディングス   | 4,800  | 2,978.00 | 14,294,400 | 貸付有価証券<br>1,300株（300株）   |
| 3939 | カナミックネットワーク           | 16,700 | 741.00   | 12,374,700 | 貸付有価証券<br>800株（800株）     |

|      |                   |         |          |               |                          |
|------|-------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 3940 | ノムラシステムコーポレーション   | 8,000   | 319.00   | 2,552,000     |                          |
| 3962 | チェンジ              | 25,600  | 3,185.00 | 81,536,000    | 貸付有価証券<br>6,600株（1,200株） |
| 3963 | シンクロ・フード          | 10,900  | 386.00   | 4,207,400     |                          |
| 3964 | オークネット            | 9,700   | 1,366.00 | 13,250,200    | 貸付有価証券<br>900株（900株）     |
| 3965 | キャピタル・アセット・プランニング | 2,200   | 1,176.00 | 2,587,200     |                          |
| 3968 | セグエグループ           | 4,700   | 1,226.00 | 5,762,200     |                          |
| 3969 | エイトレッド            | 3,500   | 2,242.00 | 7,847,000     | 貸付有価証券<br>500株           |
| 3975 | AOI TYO Holdings  | 18,500  | 613.00   | 11,340,500    |                          |
| 3978 | マクロミル             | 37,400  | 908.00   | 33,959,200    |                          |
| 3981 | ビーグリー             | 3,600   | 1,454.00 | 5,234,400     | 貸付有価証券<br>1,100株（300株）   |
| 3983 | オロ                | 5,800   | 3,660.00 | 21,228,000    | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 3984 | ユーザーローカル          | 2,700   | 4,360.00 | 11,772,000    |                          |
| 3985 | テモナ               | 4,000   | 826.00   | 3,304,000     |                          |
| 3992 | ニーズウェル            | 3,500   | 675.00   | 2,362,500     |                          |
| 3996 | サインポスト            | 4,200   | 1,164.00 | 4,888,800     | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 4284 | ソルクシーズ            | 7,000   | 936.00   | 6,552,000     | 貸付有価証券<br>1,500株（600株）   |
| 4295 | フェイス              | 5,600   | 806.00   | 4,513,600     | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 4298 | プロトコーポレーション       | 16,400  | 1,144.00 | 18,761,600    |                          |
| 4299 | ハイマックス            | 5,200   | 1,279.00 | 6,650,800     |                          |
| 4307 | 野村総合研究所           | 334,000 | 3,435.00 | 1,147,290,000 | 貸付有価証券<br>4,000株（4,000株） |
| 4312 | サイバネットシステム        | 13,000  | 852.00   | 11,076,000    |                          |
| 4320 | CEホールディングス        | 9,600   | 555.00   | 5,328,000     |                          |
| 4323 | 日本システム技術          | 3,300   | 1,518.00 | 5,009,400     | 貸付有価証券<br>800株（200株）     |
| 4326 | インテージホールディングス     | 22,800  | 1,320.00 | 30,096,000    |                          |
| 4333 | 東邦システムサイエンス       | 4,800   | 974.00   | 4,675,200     |                          |
| 4344 | ソースネクスト           | 86,800  | 360.00   | 31,248,000    | 貸付有価証券<br>20,400株        |
| 4348 | インフォコム            | 16,700  | 2,827.00 | 47,210,900    |                          |
| 4382 | HEROZ             | 5,200   | 2,951.00 | 15,345,200    | 貸付有価証券<br>600株           |
| 4384 | ラクスル              | 14,800  | 4,745.00 | 70,226,000    |                          |
| 4390 | I P S             | 3,200   | 2,782.00 | 8,902,400     |                          |
| 4392 | F I G             | 19,800  | 267.00   | 5,286,600     |                          |
| 4396 | システムサポート          | 5,400   | 1,600.00 | 8,640,000     | 貸付有価証券<br>800株           |
| 4420 | イーソル              | 9,900   | 1,268.00 | 12,553,200    | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| 4423 | アルテリア・ネットワークス     | 20,300  | 1,686.00 | 34,225,800    |                          |

|      |                       |           |           |               |                          |
|------|-----------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| 4427 | E d u L a b           | 1,700     | 8,320.00  | 14,144,000    |                          |
| 4430 | 東海ソフト                 | 2,100     | 1,202.00  | 2,524,200     |                          |
| 4433 | ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング | 3,100     | 2,016.00  | 6,249,600     | 貸付有価証券<br>300株           |
| 4434 | サーバーワークス              | 1,300     | 4,330.00  | 5,629,000     |                          |
| 4439 | 東名                    | 900       | 1,210.00  | 1,089,000     |                          |
| 4440 | ヴィッツ                  | 700       | 2,159.00  | 1,511,300     |                          |
| 4441 | トビラシシステムズ             | 1,800     | 1,434.00  | 2,581,200     |                          |
| 4443 | S a n s a n           | 12,200    | 9,960.00  | 121,512,000   |                          |
| 4446 | L i n k－U             | 1,200     | 1,238.00  | 1,485,600     |                          |
| 4449 | ギフティ                  | 8,200     | 3,470.00  | 28,454,000    |                          |
| 4481 | ベース                   | 1,600     | 5,770.00  | 9,232,000     |                          |
| 4662 | フォーカスシステムズ            | 12,300    | 1,002.00  | 12,324,600    |                          |
| 4674 | クレスコ                  | 12,500    | 1,696.00  | 21,200,000    |                          |
| 4676 | フジ・メディア・ホールディングス      | 189,900   | 1,440.00  | 273,456,000   |                          |
| 4684 | オービック                 | 57,700    | 19,590.00 | 1,130,343,000 |                          |
| 4686 | ジャストシステム              | 26,000    | 6,040.00  | 157,040,000   |                          |
| 4687 | T D Cソフト              | 16,000    | 1,031.00  | 16,496,000    | 貸付有価証券<br>4,000株（4,000株） |
| 4689 | Zホールディングス             | 2,514,800 | 546.60    | 1,374,589,680 |                          |
| 4704 | トレンドマイクロ              | 97,800    | 5,450.00  | 533,010,000   |                          |
| 4709 | I Dホールディングス           | 7,000     | 1,315.00  | 9,205,000     | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 4716 | 日本オラクル                | 37,100    | 10,820.00 | 401,422,000   | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株） |
| 4719 | アルファシステムズ             | 4,900     | 3,610.00  | 17,689,000    |                          |
| 4722 | フューチャー                | 22,100    | 2,091.00  | 46,211,100    |                          |
| 4725 | C A C H o l d i n g s | 11,900    | 1,439.00  | 17,124,100    |                          |
| 4726 | S Bテクノロジー             | 6,600     | 3,250.00  | 21,450,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 4728 | トーセ                   | 4,900     | 823.00    | 4,032,700     | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |
| 4733 | オービックビジネスコンサルタント      | 18,700    | 6,100.00  | 114,070,000   | 貸付有価証券<br>4,700株（4,700株） |
| 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ        | 83,400    | 3,560.00  | 296,904,000   |                          |
| 4743 | アイティフォー               | 23,900    | 853.00    | 20,386,700    |                          |
| 4746 | 東計電算                  | 2,700     | 4,445.00  | 12,001,500    | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 4762 | エクスネット                | 2,900     | 1,210.00  | 3,509,000     |                          |
| 4768 | 大塚商会                  | 99,000    | 4,975.00  | 492,525,000   | 貸付有価証券<br>7,400株（7,400株） |
| 4776 | サイボウズ                 | 21,400    | 2,267.00  | 48,513,800    |                          |
| 4812 | 電通国際情報サービス            | 22,700    | 3,965.00  | 90,005,500    |                          |
| 4813 | A C C E S S           | 17,200    | 807.00    | 13,880,400    | 貸付有価証券<br>5,800株（1,700株） |

|      |                        |           |          |               |                            |
|------|------------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 4819 | デジタルガレージ               | 30,200    | 4,395.00 | 132,729,000   | 貸付有価証券<br>2,500株（2,500株）   |
| 4820 | EMシステムズ                | 30,200    | 854.00   | 25,790,800    |                            |
| 4825 | ウェザーニューズ               | 5,500     | 5,470.00 | 30,085,000    |                            |
| 4826 | C I J                  | 12,500    | 892.00   | 11,150,000    |                            |
| 4828 | ビジネスエンジニアリング           | 1,800     | 3,525.00 | 6,345,000     |                            |
| 4829 | 日本エンタープライズ             | 18,600    | 268.00   | 4,984,800     |                            |
| 4839 | WOWOW                  | 8,800     | 2,916.00 | 25,660,800    |                            |
| 4845 | スカラ                    | 16,300    | 734.00   | 11,964,200    | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 4847 | インテリジェント ウェイブ          | 10,700    | 689.00   | 7,372,300     | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 6879 | IMAGICA GROUP          | 15,500    | 529.00   | 8,199,500     | 貸付有価証券<br>500株             |
| 7518 | ネットワンシステムズ             | 74,700    | 3,515.00 | 262,570,500   |                            |
| 7527 | システムソフト                | 39,400    | 166.00   | 6,540,400     |                            |
| 7595 | アルゴグラフィックス             | 14,200    | 3,315.00 | 47,073,000    |                            |
| 7844 | マーベラス                  | 28,800    | 903.00   | 26,006,400    |                            |
| 7860 | エイバックス                 | 31,500    | 1,538.00 | 48,447,000    |                            |
| 8056 | 日本ユニシス                 | 63,500    | 3,430.00 | 217,805,000   |                            |
| 8096 | 兼松エレクトロニクス             | 10,000    | 3,840.00 | 38,400,000    |                            |
| 8157 | 都築電気                   | 6,700     | 1,634.00 | 10,947,800    | 貸付有価証券<br>1,900株（500株）     |
| 9401 | TBSホールディングス            | 121,400   | 2,270.00 | 275,578,000   | 貸付有価証券<br>27,900株（27,900株） |
| 9404 | 日本テレビホールディングス          | 152,800   | 1,553.00 | 237,298,400   |                            |
| 9405 | 朝日放送グループホールディングス       | 18,200    | 759.00   | 13,813,800    |                            |
| 9409 | テレビ朝日ホールディングス          | 56,600    | 2,188.00 | 123,840,800   | 貸付有価証券<br>15,700株（3,800株）  |
| 9412 | スカパーJ S A Tホールディングス    | 120,500   | 509.00   | 61,334,500    |                            |
| 9413 | テレビ東京ホールディングス          | 13,300    | 2,472.00 | 32,877,600    | 貸付有価証券<br>3,800株（3,800株）   |
| 9414 | 日本BS放送                 | 6,200     | 1,093.00 | 6,776,600     |                            |
| 9416 | ビジョン                   | 22,700    | 1,233.00 | 27,989,100    |                            |
| 9417 | スマートバリュー               | 4,800     | 931.00   | 4,468,800     | 貸付有価証券<br>1,700株（400株）     |
| 9418 | USEN-NEXT HOLDING<br>S | 7,000     | 2,047.00 | 14,329,000    |                            |
| 9419 | ワイヤレスゲート               | 7,500     | 435.00   | 3,262,500     | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 9422 | コネクシオ                  | 10,400    | 1,431.00 | 14,882,400    |                            |
| 9424 | 日本通信                   | 161,700   | 247.00   | 39,939,900    |                            |
| 9428 | クロップス                  | 3,300     | 912.00   | 3,009,600     | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| 9432 | 日本電信電話                 | 2,141,100 | 2,971.00 | 6,361,208,100 |                            |
| 9433 | KDDI                   | 1,468,000 | 3,544.00 | 5,202,592,000 |                            |
| 9434 | ソフトバンク                 | 1,663,600 | 1,482.50 | 2,466,287,000 |                            |

|      |                          |         |           |             |                          |
|------|--------------------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 9435 | 光通信                      | 21,600  | 22,330.00 | 482,328,000 |                          |
| 9438 | エムティーアイ                  | 17,700  | 820.00    | 14,514,000  |                          |
| 9449 | GMOインターネット               | 65,600  | 3,220.00  | 211,232,000 |                          |
| 9450 | ファイバーゲート                 | 5,900   | 1,811.00  | 10,684,900  | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 9466 | アイドママーケティングコミュニケー<br>ション | 4,700   | 490.00    | 2,303,000   |                          |
| 9468 | KADOKAWA                 | 49,300  | 4,195.00  | 206,813,500 |                          |
| 9470 | 学研ホールディングス               | 25,400  | 1,432.00  | 36,372,800  | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株） |
| 9474 | ゼンリン                     | 33,200  | 1,377.00  | 45,716,400  |                          |
| 9475 | 昭文社ホールディングス              | 7,400   | 502.00    | 3,714,800   | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 9479 | インプレスホールディングス            | 15,200  | 244.00    | 3,708,800   | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| 9600 | アイネット                    | 9,400   | 1,537.00  | 14,447,800  | 貸付有価証券<br>700株（700株）     |
| 9601 | 松竹                       | 12,100  | 13,170.00 | 159,357,000 | 貸付有価証券<br>2,900株（2,900株） |
| 9602 | 東宝                       | 108,000 | 4,345.00  | 469,260,000 |                          |
| 9605 | 東映                       | 6,000   | 23,180.00 | 139,080,000 | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株） |
| 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ             | 487,400 | 1,724.00  | 840,277,600 |                          |
| 9629 | ピー・シー・エー                 | 2,700   | 4,270.00  | 11,529,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 9658 | ビジネスブレイン太田昭和             | 6,300   | 1,826.00  | 11,503,800  | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| 9682 | D T S                    | 38,000  | 2,590.00  | 98,420,000  | 貸付有価証券<br>3,100株（3,100株） |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディ<br>ングス | 78,100  | 6,350.00  | 495,935,000 | 貸付有価証券<br>5,900株（5,900株） |
| 9692 | シーイーシー                   | 19,600  | 1,559.00  | 30,556,400  |                          |
| 9697 | カプコン                     | 78,400  | 7,200.00  | 564,480,000 | 貸付有価証券<br>6,400株（6,400株） |
| 9702 | アイ・エス・ビー                 | 8,400   | 1,240.00  | 10,416,000  |                          |
| 9717 | ジャステック                   | 11,700  | 1,265.00  | 14,800,500  |                          |
| 9719 | S C S K                  | 42,200  | 6,550.00  | 276,410,000 |                          |
| 9739 | 日本システムウエア                | 6,000   | 2,124.00  | 12,744,000  |                          |
| 9742 | アイネス                     | 18,000  | 1,367.00  | 24,606,000  |                          |
| 9746 | T K C                    | 15,500  | 6,940.00  | 107,570,000 |                          |
| 9749 | 富士ソフト                    | 19,500  | 5,680.00  | 110,760,000 | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株） |
| 9759 | N S D                    | 58,800  | 1,925.00  | 113,190,000 |                          |
| 9766 | コナミホールディングス              | 66,500  | 6,500.00  | 432,250,000 |                          |
| 9790 | 福井コンピュータホールディングス         | 8,400   | 4,195.00  | 35,238,000  |                          |
| 9889 | J B C Cホールディングス          | 12,400  | 1,485.00  | 18,414,000  |                          |
| 9928 | ミロク情報サービス                | 18,100  | 2,132.00  | 38,589,200  | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |

|      |                     |           |          |                |                          |
|------|---------------------|-----------|----------|----------------|--------------------------|
| 9984 | ソフトバンクグループ          | 1,452,400 | 9,075.00 | 13,180,530,000 |                          |
| 1352 | ハウスイ                | 1,500     | 1,006.00 | 1,509,000      |                          |
| 2676 | 高千穂交易               | 7,100     | 1,256.00 | 8,917,600      |                          |
| 2689 | オルパヘルスケアホールディングス    | 3,000     | 1,631.00 | 4,893,000      |                          |
| 2692 | 伊藤忠食品               | 4,500     | 5,750.00 | 25,875,000     |                          |
| 2715 | エレマテック              | 14,700    | 1,064.00 | 15,640,800     |                          |
| 2729 | J A L U X           | 5,200     | 1,690.00 | 8,788,000      | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 2733 | あらた                 | 14,600    | 4,925.00 | 71,905,000     | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| 2737 | トーメンデバイス            | 2,400     | 4,300.00 | 10,320,000     |                          |
| 2760 | 東京エレクトロン デバイス       | 6,000     | 3,780.00 | 22,680,000     |                          |
| 2767 | フィールズ               | 16,100    | 590.00   | 9,499,000      | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 2768 | 双日                  | 1,014,800 | 321.00   | 325,750,800    |                          |
| 2784 | アルフレッサ ホールディングス     | 190,600   | 2,216.00 | 422,369,600    |                          |
| 2874 | 横浜冷凍                | 48,100    | 941.00   | 45,262,100     |                          |
| 3004 | 神栄                  | 2,500     | 1,335.00 | 3,337,500      | 貸付有価証券<br>1,200株（600株）   |
| 3023 | ラサ商事                | 9,700     | 963.00   | 9,341,100      |                          |
| 3036 | アルコニックス             | 19,500    | 1,677.00 | 32,701,500     |                          |
| 3038 | 神戸物産                | 126,800   | 2,940.00 | 372,792,000    | 貸付有価証券<br>9,600株（9,600株） |
| 3054 | ハイパー                | 2,800     | 639.00   | 1,789,200      |                          |
| 3076 | あい ホールディングス         | 26,200    | 2,175.00 | 56,985,000     |                          |
| 3079 | ディーブイエックス           | 5,900     | 1,172.00 | 6,914,800      | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 3107 | ダイワボウホールディングス       | 16,700    | 9,020.00 | 150,634,000    | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株） |
| 3132 | マクニカ・富士エレホールディングス   | 43,800    | 2,168.00 | 94,958,400     |                          |
| 3139 | ラクト・ジャパン            | 8,000     | 2,821.00 | 22,568,000     | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 3150 | グリムス                | 4,100     | 1,855.00 | 7,605,500      |                          |
| 3151 | バイタルケーエスケー・ホールディングス | 31,900    | 796.00   | 25,392,400     |                          |
| 3153 | 八洲電機                | 14,200    | 1,020.00 | 14,484,000     |                          |
| 3154 | メディアスホールディングス       | 10,400    | 919.00   | 9,557,600      | 貸付有価証券<br>2,500株         |
| 3156 | レスターホールディングス        | 19,200    | 2,079.00 | 39,916,800     |                          |
| 3157 | ジュテックホールディングス       | 4,200     | 1,114.00 | 4,678,800      |                          |
| 3160 | 大光                  | 7,000     | 692.00   | 4,844,000      |                          |
| 3166 | O C H I ホールディングス    | 5,300     | 1,419.00 | 7,520,700      |                          |
| 3167 | T O K A I ホールディングス  | 89,000    | 979.00   | 87,131,000     |                          |
| 3168 | 黒谷                  | 5,000     | 808.00   | 4,040,000      | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| 3173 | C o m i n i x       | 3,200     | 826.00   | 2,643,200      |                          |

|      |                  |         |           |             |                          |
|------|------------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 3176 | 三洋貿易             | 18,500  | 1,179.00  | 21,811,500  |                          |
| 3180 | ビューティガレージ        | 3,000   | 3,430.00  | 10,290,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| 3183 | ウイン・パートナーズ       | 13,300  | 1,081.00  | 14,377,300  |                          |
| 3321 | ミタチ産業            | 5,000   | 702.00    | 3,510,000   |                          |
| 3360 | シップヘルスケアホールディングス | 32,400  | 6,340.00  | 205,416,000 | 貸付有価証券<br>2,200株（2,200株） |
| 3388 | 明治電機工業           | 6,300   | 1,515.00  | 9,544,500   |                          |
| 3392 | デリカフーズホールディングス   | 7,100   | 634.00    | 4,501,400   |                          |
| 3393 | スターティアホールディングス   | 3,600   | 1,238.00  | 4,456,800   | 貸付有価証券<br>1,300株（300株）   |
| 3543 | コメダホールディングス      | 40,100  | 2,034.00  | 81,563,400  |                          |
| 3559 | ピーバンドットコム        | 2,400   | 809.00    | 1,941,600   |                          |
| 3565 | アセンテック           | 4,700   | 1,634.00  | 7,679,800   | 貸付有価証券<br>800株（200株）     |
| 5009 | 富士興産             | 5,600   | 1,213.00  | 6,792,800   | 貸付有価証券<br>1,800株（400株）   |
| 6973 | 協栄産業             | 2,000   | 1,412.00  | 2,824,000   | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| 7414 | 小野建              | 16,500  | 1,440.00  | 23,760,000  | 貸付有価証券<br>3,900株         |
| 7417 | 南陽               | 3,700   | 1,704.00  | 6,304,800   |                          |
| 7420 | 佐島電機             | 11,400  | 799.00    | 9,108,600   |                          |
| 7427 | エコートレーディング       | 3,800   | 664.00    | 2,523,200   |                          |
| 7433 | 伯東               | 11,200  | 1,325.00  | 14,840,000  |                          |
| 7438 | コンドーテック          | 14,200  | 1,084.00  | 15,392,800  |                          |
| 7442 | 中山福              | 10,500  | 508.00    | 5,334,000   |                          |
| 7447 | ナガイレーベン          | 24,400  | 2,761.00  | 67,368,400  | 貸付有価証券<br>5,800株（5,800株） |
| 7451 | 三菱食品             | 20,200  | 3,105.00  | 62,721,000  |                          |
| 7456 | 松田産業             | 13,400  | 2,082.00  | 27,898,800  |                          |
| 7458 | 第一興商             | 27,300  | 4,335.00  | 118,345,500 |                          |
| 7459 | メディパルホールディングス    | 184,100 | 2,295.00  | 422,509,500 |                          |
| 7466 | S P K            | 7,900   | 1,322.00  | 10,443,800  |                          |
| 7467 | 萩原電気ホールディングス     | 6,800   | 2,646.00  | 17,992,800  | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 7476 | アズワン             | 13,200  | 13,670.00 | 180,444,000 |                          |
| 7480 | スズデン             | 6,400   | 1,339.00  | 8,569,600   |                          |
| 7481 | 尾家産業             | 5,400   | 1,435.00  | 7,749,000   |                          |
| 7482 | シモジマ             | 11,200  | 1,365.00  | 15,288,000  |                          |
| 7483 | ドウシシャ            | 17,300  | 1,916.00  | 33,146,800  |                          |
| 7487 | 小津産業             | 4,000   | 1,968.00  | 7,872,000   |                          |
| 7504 | 高速               | 9,700   | 1,569.00  | 15,219,300  |                          |
| 7510 | たけびし             | 6,400   | 1,574.00  | 10,073,600  |                          |
| 7525 | リックス             | 4,100   | 1,603.00  | 6,572,300   |                          |
| 7537 | 丸文               | 16,200  | 539.00    | 8,731,800   |                          |

|      |                 |           |          |               |                          |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 7552 | ハピネット           | 15,300    | 1,603.00 | 24,525,900    |                          |
| 7570 | 橋本総業ホールディングス    | 3,700     | 2,692.00 | 9,960,400     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| 7575 | 日本ライフライン        | 59,400    | 1,480.00 | 87,912,000    | 貸付有価証券<br>4,100株（4,100株） |
| 7590 | タカショー           | 11,900    | 770.00   | 9,163,000     | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| 7594 | マルカ             | 5,900     | 2,007.00 | 11,841,300    | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| 7599 | I D O M         | 61,900    | 719.00   | 44,506,100    |                          |
| 7607 | 進和              | 10,900    | 2,181.00 | 23,772,900    |                          |
| 7608 | エスケイジャパン        | 4,400     | 462.00   | 2,032,800     | 貸付有価証券<br>1,300株（300株）   |
| 7609 | ダイトロン           | 7,800     | 1,817.00 | 14,172,600    | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株） |
| 7613 | シークス            | 23,400    | 1,671.00 | 39,101,400    |                          |
| 7619 | 田中商事            | 5,600     | 703.00   | 3,936,800     |                          |
| 7628 | オーハシテクニカ        | 9,400     | 1,663.00 | 15,632,200    |                          |
| 7637 | 白銅              | 6,600     | 1,655.00 | 10,923,000    |                          |
| 7673 | ダイコー通産          | 1,600     | 1,605.00 | 2,568,000     |                          |
| 8001 | 伊藤忠商事           | 1,285,100 | 3,512.00 | 4,513,271,200 |                          |
| 8002 | 丸紅              | 1,811,800 | 923.80   | 1,673,740,840 |                          |
| 8007 | 高島              | 2,900     | 1,848.00 | 5,359,200     |                          |
| 8012 | 長瀬産業            | 103,300   | 1,828.00 | 188,832,400   |                          |
| 8014 | 蝶理              | 11,700    | 1,741.00 | 20,369,700    |                          |
| 8015 | 豊田通商            | 184,600   | 4,700.00 | 867,620,000   |                          |
| 8018 | 三共生興            | 27,800    | 585.00   | 16,263,000    |                          |
| 8020 | 兼松              | 73,400    | 1,510.00 | 110,834,000   |                          |
| 8025 | ツカモトコーポレーション    | 3,100     | 1,541.00 | 4,777,100     |                          |
| 8031 | 三井物産            | 1,491,800 | 2,348.00 | 3,502,746,400 |                          |
| 8032 | 日本紙パルプ商事        | 9,600     | 3,925.00 | 37,680,000    |                          |
| 8037 | カメイ             | 23,900    | 1,359.00 | 32,480,100    |                          |
| 8038 | 東都水産            | 2,100     | 4,470.00 | 9,387,000     |                          |
| 8041 | O U Gホールディングス   | 2,900     | 2,999.00 | 8,697,100     |                          |
| 8043 | スターゼン           | 6,800     | 5,170.00 | 35,156,000    |                          |
| 8051 | 山善              | 71,800    | 1,091.00 | 78,333,800    | 貸付有価証券<br>5,400株（5,400株） |
| 8052 | 椿本興業            | 3,400     | 3,910.00 | 13,294,000    | 貸付有価証券<br>800株（800株）     |
| 8053 | 住友商事            | 1,159,500 | 1,609.50 | 1,866,215,250 |                          |
| 8057 | 内田洋行            | 7,200     | 4,925.00 | 35,460,000    |                          |
| 8058 | 三菱商事            | 1,118,600 | 3,199.00 | 3,578,401,400 |                          |
| 8059 | 第一実業            | 8,300     | 4,465.00 | 37,059,500    |                          |
| 8060 | キャノンマーケティングジャパン | 45,600    | 2,552.00 | 116,371,200   |                          |
| 8061 | 西華産業            | 9,700     | 1,536.00 | 14,899,200    | 貸付有価証券<br>800株（800株）     |



|      |                   |        |          |             |                           |
|------|-------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| 8065 | 佐藤商事              | 15,200 | 1,151.00 | 17,495,200  |                           |
| 8068 | 菱洋エレクトロ           | 14,000 | 2,657.00 | 37,198,000  | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株）  |
| 8070 | 東京産業              | 16,600 | 678.00   | 11,254,800  | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）  |
| 8074 | ユアサ商事             | 18,800 | 3,250.00 | 61,100,000  | 貸付有価証券<br>4,300株（4,300株）  |
| 8075 | 神鋼商事              | 4,100  | 2,342.00 | 9,602,200   |                           |
| 8077 | トルク               | 10,900 | 261.00   | 2,844,900   |                           |
| 8078 | 阪和興業              | 36,800 | 3,215.00 | 118,312,000 |                           |
| 8079 | 正栄食品工業            | 11,900 | 4,560.00 | 54,264,000  | 貸付有価証券<br>2,900株          |
| 8081 | カナデン              | 14,900 | 1,274.00 | 18,982,600  |                           |
| 8084 | 菱電商事              | 13,200 | 1,761.00 | 23,245,200  |                           |
| 8087 | フルサト工業            | 9,300  | 1,444.00 | 13,429,200  |                           |
| 8088 | 岩谷産業              | 44,100 | 6,740.00 | 297,234,000 |                           |
| 8089 | ナイス               | 7,300  | 1,894.00 | 13,826,200  |                           |
| 8090 | 昭光通商              | 5,900  | 799.00   | 4,714,100   |                           |
| 8091 | ニチモウ              | 2,900  | 2,214.00 | 6,420,600   |                           |
| 8093 | 極東貿易              | 5,300  | 1,554.00 | 8,236,200   | 貸付有価証券<br>200株（200株）      |
| 8095 | イワキ               | 24,500 | 626.00   | 15,337,000  |                           |
| 8097 | 三愛石油              | 45,200 | 1,358.00 | 61,381,600  | 貸付有価証券<br>3,400株（3,400株）  |
| 8098 | 稲畑産業              | 44,100 | 1,745.00 | 76,954,500  |                           |
| 8101 | G S I クレオス        | 4,500  | 2,711.00 | 12,199,500  |                           |
| 8103 | 明和産業              | 16,900 | 507.00   | 8,568,300   |                           |
| 8104 | クワザワホールディングス      | 6,500  | 725.00   | 4,712,500   |                           |
| 8108 | ヤマエ久野             | 13,400 | 1,209.00 | 16,200,600  | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| 8125 | ワキタ               | 36,200 | 1,029.00 | 37,249,800  |                           |
| 8129 | 東邦ホールディングス        | 58,900 | 2,066.00 | 121,687,400 |                           |
| 8130 | サンゲツ              | 49,600 | 1,740.00 | 86,304,000  |                           |
| 8131 | ミツウロコグループホールディングス | 27,100 | 1,409.00 | 38,183,900  | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株）  |
| 8132 | シナネンホールディングス      | 6,800  | 3,115.00 | 21,182,000  | 貸付有価証券<br>600株（600株）      |
| 8133 | 伊藤忠エネクス           | 40,600 | 1,143.00 | 46,405,800  |                           |
| 8136 | サンリオ              | 51,600 | 1,745.00 | 90,042,000  | 貸付有価証券<br>16,200株（3,900株） |
| 8137 | サンワテクノス           | 12,100 | 1,116.00 | 13,503,600  |                           |
| 8140 | リョーサン             | 20,300 | 2,369.00 | 48,090,700  |                           |
| 8141 | 新光商事              | 24,800 | 860.00   | 21,328,000  | 貸付有価証券<br>2,200株（2,200株）  |
| 8142 | トーヨー              | 8,300  | 1,890.00 | 15,687,000  | 貸付有価証券<br>600株（600株）      |
| 8150 | 三信電気              | 9,800  | 2,127.00 | 20,844,600  |                           |

|      |                     |         |          |             |                          |
|------|---------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 8151 | 東陽テクニカ              | 19,600  | 1,098.00 | 21,520,800  |                          |
| 8153 | モスフードサービス           | 26,000  | 3,365.00 | 87,490,000  |                          |
| 8154 | 加賀電子                | 16,600  | 2,613.00 | 43,375,800  | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株） |
| 8158 | ソーダニッカ              | 17,500  | 614.00   | 10,745,000  |                          |
| 8159 | 立花エレテック             | 13,600  | 1,634.00 | 22,222,400  |                          |
| 8275 | フォーバル               | 6,400   | 931.00   | 5,958,400   | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 8283 | PALTAC              | 29,400  | 5,850.00 | 171,990,000 |                          |
| 8285 | 三谷産業                | 24,100  | 448.00   | 10,796,800  | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株） |
| 8835 | 太平洋興発               | 7,200   | 786.00   | 5,659,200   |                          |
| 9260 | 西本Wismettacホールディングス | 4,200   | 3,150.00 | 13,230,000  |                          |
| 9265 | ヤマシタヘルスケアホールディングス   | 1,600   | 1,725.00 | 2,760,000   | 貸付有価証券<br>300株           |
| 9273 | コア商事ホールディングス        | 5,200   | 1,433.00 | 7,451,600   |                          |
| 9274 | 国際紙パルプ商事            | 39,100  | 268.00   | 10,478,800  |                          |
| 9305 | ヤマタネ                | 7,900   | 1,522.00 | 12,023,800  |                          |
| 9763 | 丸紅建材リース             | 1,800   | 2,021.00 | 3,637,800   |                          |
| 9810 | 日鉄物産                | 13,100  | 4,150.00 | 54,365,000  |                          |
| 9824 | 泉州電業                | 5,200   | 3,620.00 | 18,824,000  |                          |
| 9830 | トラスコ中山              | 42,100  | 2,943.00 | 123,900,300 |                          |
| 9832 | オートバックスセブン          | 68,200  | 1,541.00 | 105,096,200 |                          |
| 9837 | モリト                 | 13,400  | 640.00   | 8,576,000   |                          |
| 9869 | 加藤産業                | 26,500  | 3,705.00 | 98,182,500  | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株） |
| 9872 | 北恵                  | 4,600   | 912.00   | 4,195,200   |                          |
| 9880 | イノテック               | 10,300  | 1,384.00 | 14,255,200  |                          |
| 9882 | イエローハット             | 34,700  | 1,944.00 | 67,456,800  |                          |
| 9896 | JKホールディングス          | 16,600  | 892.00   | 14,807,200  | 貸付有価証券<br>2,400株（2,400株） |
| 9902 | 日伝                  | 15,200  | 2,275.00 | 34,580,000  |                          |
| 9930 | 北沢産業                | 12,400  | 273.00   | 3,385,200   | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |
| 9932 | 杉本商事                | 9,200   | 2,394.00 | 22,024,800  |                          |
| 9934 | 因幡電機産業              | 49,000  | 2,728.00 | 133,672,000 |                          |
| 9960 | 東テク                 | 6,100   | 2,948.00 | 17,982,800  | 貸付有価証券<br>1,900株（500株）   |
| 9962 | ミスミグループ本社           | 230,400 | 3,265.00 | 752,256,000 |                          |
| 9972 | アルテック               | 13,500  | 307.00   | 4,144,500   |                          |
| 9982 | タキヒヨー               | 6,100   | 1,872.00 | 11,419,200  | 貸付有価証券<br>1,300株（400株）   |
| 9986 | 蔵王産業                | 3,500   | 1,419.00 | 4,966,500   |                          |
| 9987 | スズケン                | 77,800  | 4,445.00 | 345,821,000 |                          |
| 9991 | ジェコス                | 12,700  | 1,006.00 | 12,776,200  |                          |

|      |                 |         |          |             |                            |
|------|-----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 9995 | グローセル           | 19,900  | 487.00   | 9,691,300   | 貸付有価証券<br>900株（900株）       |
| 2651 | ローソン            | 46,500  | 5,470.00 | 254,355,000 |                            |
| 2659 | サンエー            | 13,900  | 4,730.00 | 65,747,000  | 貸付有価証券<br>3,800株（3,800株）   |
| 2664 | カワチ薬品           | 12,800  | 2,864.00 | 36,659,200  |                            |
| 2670 | エービーシー・マート      | 28,700  | 6,290.00 | 180,523,000 |                            |
| 2674 | ハードオフコーポレーション   | 8,100   | 884.00   | 7,160,400   |                            |
| 2678 | アスクル            | 16,000  | 4,095.00 | 65,520,000  |                            |
| 2681 | ゲオホールディングス      | 24,600  | 1,201.00 | 29,544,600  |                            |
| 2685 | アダストリア          | 25,400  | 2,011.00 | 51,079,400  |                            |
| 2686 | ジーフット           | 11,100  | 414.00   | 4,595,400   | 貸付有価証券<br>5,400株（2,700株）   |
| 2687 | シー・ヴィ・エス・バイエリア  | 2,600   | 412.00   | 1,071,200   |                            |
| 2695 | くら寿司            | 10,800  | 7,310.00 | 78,948,000  |                            |
| 2698 | キャンドゥ           | 8,700   | 1,954.00 | 16,999,800  | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 2722 | アイケイ            | 4,000   | 859.00   | 3,436,000   |                            |
| 2726 | パルグループホールディングス  | 16,100  | 1,591.00 | 25,615,100  |                            |
| 2730 | エディオン           | 77,800  | 1,270.00 | 98,806,000  | 貸付有価証券<br>14,700株（14,700株） |
| 2734 | サーラコーポレーション     | 37,300  | 629.00   | 23,461,700  |                            |
| 2735 | ワッツ             | 8,100   | 908.00   | 7,354,800   |                            |
| 2742 | ハローズ            | 7,400   | 2,956.00 | 21,874,400  |                            |
| 2752 | フジオフードグループ本社    | 15,500  | 1,354.00 | 20,987,000  | 貸付有価証券<br>5,000株（1,200株）   |
| 2753 | あみやき亭           | 4,000   | 3,150.00 | 12,600,000  |                            |
| 2764 | ひらまつ            | 33,800  | 157.00   | 5,306,600   |                            |
| 2791 | 大黒天物産           | 4,400   | 6,950.00 | 30,580,000  |                            |
| 2792 | ハニーズホールディングス    | 14,500  | 1,122.00 | 16,269,000  |                            |
| 2796 | ファーマライズホールディングス | 4,500   | 795.00   | 3,577,500   |                            |
| 3028 | アルペン            | 14,100  | 2,425.00 | 34,192,500  |                            |
| 3030 | ハブ              | 5,900   | 749.00   | 4,419,100   |                            |
| 3034 | クオールホールディングス    | 24,800  | 1,620.00 | 40,176,000  |                            |
| 3046 | ジンズホールディングス     | 9,700   | 7,830.00 | 75,951,000  |                            |
| 3048 | ビックカメラ          | 109,000 | 1,247.00 | 135,923,000 | 貸付有価証券<br>8,200株（8,200株）   |
| 3050 | DCMホールディングス     | 113,400 | 1,159.00 | 131,430,600 | 貸付有価証券<br>7,400株（7,400株）   |
| 3053 | ペッパーフードサービス     | 21,900  | 300.00   | 6,570,000   |                            |
| 3064 | Monotaro        | 130,600 | 5,900.00 | 770,540,000 | 貸付有価証券<br>32,900株（32,900株） |
| 3067 | 東京一番フーズ         | 4,700   | 600.00   | 2,820,000   | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 3073 | DDホールディングス      | 8,600   | 603.00   | 5,185,800   | 貸付有価証券<br>2,200株（500株）     |

|      |                      |         |           |             |                            |
|------|----------------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| 3082 | きちりホールディングス          | 4,900   | 620.00    | 3,038,000   |                            |
| 3085 | アークランドサービスホールディングス   | 15,300  | 2,184.00  | 33,415,200  |                            |
| 3086 | J. フロント リテイリング       | 219,400 | 1,082.00  | 237,390,800 |                            |
| 3087 | ドトール・日レスホールディングス     | 29,100  | 1,774.00  | 51,623,400  |                            |
| 3088 | マツモトキヨシホールディングス      | 75,900  | 4,945.00  | 375,325,500 |                            |
| 3091 | ブロンコビリー              | 9,600   | 2,415.00  | 23,184,000  |                            |
| 3092 | Z O Z O              | 108,300 | 3,165.00  | 342,769,500 |                            |
| 3093 | トレジャー・ファクトリー         | 5,400   | 1,020.00  | 5,508,000   |                            |
| 3097 | 物語コーポレーション           | 9,800   | 6,990.00  | 68,502,000  |                            |
| 3098 | ココカラファイン             | 16,400  | 8,550.00  | 140,220,000 |                            |
| 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス        | 321,400 | 798.00    | 256,477,200 | 貸付有価証券<br>24,100株（24,100株） |
| 3134 | Hame e               | 4,700   | 1,613.00  | 7,581,100   |                            |
| 3141 | ウエルシアホールディングス        | 97,100  | 3,785.00  | 367,523,500 | 貸付有価証券<br>8,200株（8,200株）   |
| 3148 | クリエイトSDホールディングス      | 27,100  | 3,680.00  | 99,728,000  | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株）   |
| 3159 | 丸善CH Iホールディングス       | 21,400  | 393.00    | 8,410,200   |                            |
| 3169 | ミサワ                  | 3,700   | 716.00    | 2,649,200   |                            |
| 3172 | ティーライフ               | 2,700   | 1,359.00  | 3,669,300   |                            |
| 3175 | エー・ピーホールディングス        | 3,400   | 495.00    | 1,683,000   |                            |
| 3178 | チムニー                 | 5,600   | 1,368.00  | 7,660,800   | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 3179 | シュッピン                | 12,500  | 1,030.00  | 12,875,000  | 貸付有価証券<br>3,200株（3,200株）   |
| 3182 | オイシックス・ラ・大地          | 18,200  | 2,853.00  | 51,924,600  |                            |
| 3186 | ネクステージ               | 32,000  | 1,865.00  | 59,680,000  |                            |
| 3191 | ジョイフル本田              | 53,800  | 1,452.00  | 78,117,600  |                            |
| 3193 | 鳥貴族ホールディングス          | 5,400   | 1,719.00  | 9,282,600   |                            |
| 3196 | ホットランド               | 13,700  | 1,270.00  | 17,399,000  |                            |
| 3197 | すかいらーくホールディングス       | 205,900 | 1,706.00  | 351,265,400 |                            |
| 3198 | S F Pホールディングス        | 9,000   | 1,444.00  | 12,996,000  |                            |
| 3199 | 綿半ホールディングス           | 13,800  | 1,377.00  | 19,002,600  | 貸付有価証券<br>3,600株（3,600株）   |
| 3221 | ヨシックス                | 3,600   | 2,208.00  | 7,948,800   |                            |
| 3222 | ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 53,400  | 1,163.00  | 62,104,200  | 貸付有価証券<br>9,300株（9,300株）   |
| 3319 | ゴルフダイジェスト・オンライン      | 9,500   | 1,234.00  | 11,723,000  |                            |
| 3328 | BEENOS               | 8,500   | 2,823.00  | 23,995,500  | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| 3333 | あさひ                  | 13,700  | 1,603.00  | 21,961,100  |                            |
| 3341 | 日本調剤                 | 11,100  | 1,831.00  | 20,324,100  |                            |
| 3349 | コスモス薬品               | 18,500  | 17,100.00 | 316,350,000 | 貸付有価証券<br>4,000株（4,000株）   |
| 3361 | トーエル                 | 8,900   | 912.00    | 8,116,800   |                            |

|      |                      |         |           |               |                          |
|------|----------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 3376 | オンリー                 | 3,100   | 480.00    | 1,488,000     |                          |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス      | 718,800 | 4,435.00  | 3,187,878,000 |                          |
| 3387 | クリエイト・レストランツ・ホールディング | 98,700  | 843.00    | 83,204,100    | 貸付有価証券<br>7,400株（7,400株） |
| 3391 | ツルハホールディングス          | 40,100  | 14,310.00 | 573,831,000   |                          |
| 3395 | サンマルクホールディングス        | 14,500  | 1,802.00  | 26,129,000    |                          |
| 3396 | フェリシモ                | 4,100   | 1,352.00  | 5,543,200     |                          |
| 3397 | トリドールホールディングス        | 45,400  | 1,687.00  | 76,589,800    | 貸付有価証券<br>3,400株（3,400株） |
| 3415 | TOKYO BASE           | 16,600  | 732.00    | 12,151,200    |                          |
| 3538 | ウイルプラスホールディングス       | 2,900   | 1,347.00  | 3,906,300     |                          |
| 3539 | JMホールディングス           | 13,900  | 2,310.00  | 32,109,000    |                          |
| 3544 | サツドラホールディングス         | 2,700   | 2,145.00  | 5,791,500     |                          |
| 3546 | アレンザホールディングス         | 10,500  | 1,344.00  | 14,112,000    | 貸付有価証券<br>400株           |
| 3547 | 串カツ田中ホールディングス        | 4,900   | 1,914.00  | 9,378,600     | 貸付有価証券<br>700株           |
| 3548 | バロックジャパンリミテッド        | 12,700  | 799.00    | 10,147,300    |                          |
| 3549 | クスリのアオキホールディングス      | 18,300  | 8,380.00  | 153,354,000   | 貸付有価証券<br>3,600株（3,600株） |
| 3561 | 力の源ホールディングス          | 8,300   | 677.00    | 5,619,100     | 貸付有価証券<br>2,500株（600株）   |
| 3563 | スシログローバルホールディングス     | 100,800 | 4,885.00  | 492,408,000   |                          |
| 4350 | メディカルシステムネットワーク      | 16,000  | 734.00    | 11,744,000    |                          |
| 7416 | はるやまホールディングス         | 8,600   | 723.00    | 6,217,800     |                          |
| 7419 | ノジマ                  | 32,700  | 2,900.00  | 94,830,000    |                          |
| 7421 | カッパ・クリエイト            | 25,800  | 1,559.00  | 40,222,200    |                          |
| 7445 | ライトオン                | 13,700  | 700.00    | 9,590,000     |                          |
| 7448 | ジーンズメイト              | 5,600   | 271.00    | 1,517,600     |                          |
| 7453 | 良品計画                 | 243,900 | 2,675.00  | 652,432,500   |                          |
| 7455 | 三城ホールディングス           | 22,700  | 292.00    | 6,628,400     |                          |
| 7463 | アドヴァン                | 18,700  | 1,051.00  | 19,653,700    |                          |
| 7475 | アルビス                 | 5,900   | 2,470.00  | 14,573,000    |                          |
| 7494 | コナカ                  | 21,600  | 339.00    | 7,322,400     |                          |
| 7506 | ハウス オブ ローゼ           | 2,200   | 1,721.00  | 3,786,200     |                          |
| 7508 | G-7ホールディングス          | 10,800  | 2,629.00  | 28,393,200    |                          |
| 7512 | イオン北海道               | 24,200  | 1,161.00  | 28,096,200    |                          |
| 7513 | コジマ                  | 31,600  | 718.00    | 22,688,800    |                          |
| 7514 | ヒマラヤ                 | 6,400   | 1,022.00  | 6,540,800     | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 7516 | コーナン商事               | 26,100  | 3,280.00  | 85,608,000    | 貸付有価証券<br>1,900株（1,900株） |
| 7520 | エコス                  | 6,700   | 1,975.00  | 13,232,500    |                          |
| 7522 | ワタミ                  | 24,100  | 1,014.00  | 24,437,400    | 貸付有価証券<br>6,800株（1,600株） |
| 7524 | マルシェ                 | 4,800   | 501.00    | 2,404,800     |                          |

|      |                      |         |          |             |                            |
|------|----------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 7532 | パン・パシフィック・インターナショナルホ | 367,300 | 2,615.00 | 960,489,500 |                            |
| 7545 | 西松屋チェーン              | 40,300  | 1,518.00 | 61,175,400  |                            |
| 7550 | ゼンショーホールディングス        | 98,700  | 2,938.00 | 289,980,600 | 貸付有価証券<br>22,100株（22,100株） |
| 7554 | 幸楽苑ホールディングス          | 11,700  | 1,761.00 | 20,603,700  |                            |
| 7561 | ハークスレイ               | 3,800   | 932.00   | 3,541,600   |                            |
| 7581 | サイゼリヤ                | 27,200  | 2,303.00 | 62,641,600  | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）   |
| 7593 | V Tホールディングス          | 69,100  | 462.00   | 31,924,200  |                            |
| 7596 | 魚力                   | 5,700   | 1,934.00 | 11,023,800  | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| 7601 | ボプラ                  | 4,800   | 351.00   | 1,684,800   |                            |
| 7605 | フジ・コーポレーション          | 4,900   | 2,562.00 | 12,553,800  |                            |
| 7606 | ユナイテッドアローズ           | 21,000  | 1,966.00 | 41,286,000  | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 7611 | ハイデイ日高               | 26,500  | 1,835.00 | 48,627,500  | 貸付有価証券<br>6,700株（6,700株）   |
| 7615 | 京都きもの友禅              | 11,700  | 288.00   | 3,369,600   |                            |
| 7616 | コロワイド                | 61,000  | 1,996.00 | 121,756,000 | 貸付有価証券<br>24,300株（9,800株）  |
| 7618 | ピーシーデポコーポレーション       | 21,300  | 505.00   | 10,756,500  | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株）   |
| 7630 | 壱番屋                  | 12,900  | 4,975.00 | 64,177,500  | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 7640 | トップカルチャー             | 6,600   | 358.00   | 2,362,800   |                            |
| 7646 | P L A N T            | 4,700   | 749.00   | 3,520,300   |                            |
| 7649 | スギホールディングス           | 36,700  | 8,470.00 | 310,849,000 | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）   |
| 7679 | 薬王堂ホールディングス          | 8,000   | 2,841.00 | 22,728,000  |                            |
| 7918 | ヴィア・ホールディングス         | 22,500  | 225.00   | 5,062,500   | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）   |
| 8005 | スクロール                | 26,200  | 1,101.00 | 28,846,200  | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）   |
| 8008 | ヨンドシーホールディングス        | 16,900  | 1,959.00 | 33,107,100  | 貸付有価証券<br>4,700株（4,700株）   |
| 8160 | 木曽路                  | 24,000  | 2,499.00 | 59,976,000  | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株）   |
| 8163 | S R Sホールディングス        | 23,100  | 882.00   | 20,374,200  |                            |
| 8165 | 千趣会                  | 33,200  | 375.00   | 12,450,000  |                            |
| 8166 | タカキュー                | 14,200  | 140.00   | 1,988,000   |                            |
| 8167 | リテールパートナーズ           | 22,300  | 1,408.00 | 31,398,400  | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）   |
| 8168 | ケーヨー                 | 34,000  | 730.00   | 24,820,000  | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）   |
| 8173 | 上新電機                 | 21,600  | 3,275.00 | 70,740,000  |                            |
| 8174 | 日本瓦斯                 | 30,300  | 5,710.00 | 173,013,000 |                            |
| 8179 | ロイヤルホールディングス         | 32,100  | 2,030.00 | 65,163,000  | 貸付有価証券<br>7,600株           |

|      |                   |         |           |               |                            |
|------|-------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 8181 | 東天紅               | 1,300   | 1,084.00  | 1,409,200     |                            |
| 8182 | いなげや              | 20,500  | 1,708.00  | 35,014,000    | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）   |
| 8185 | チヨダ               | 19,300  | 1,019.00  | 19,666,700    |                            |
| 8194 | ライフコーポレーション       | 13,900  | 3,385.00  | 47,051,500    |                            |
| 8200 | リンガーハット           | 22,600  | 2,355.00  | 53,223,000    | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）   |
| 8203 | MrMaxHD           | 25,200  | 709.00    | 17,866,800    |                            |
| 8207 | テナアライド            | 16,900  | 356.00    | 6,016,400     |                            |
| 8214 | AOKIホールディングス      | 36,800  | 635.00    | 23,368,000    | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）   |
| 8217 | オークワ              | 28,800  | 1,255.00  | 36,144,000    |                            |
| 8218 | コメリ               | 28,400  | 3,130.00  | 88,892,000    | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）   |
| 8219 | 青山商事              | 40,900  | 842.00    | 34,437,800    |                            |
| 8227 | しまむら              | 21,400  | 12,250.00 | 262,150,000   |                            |
| 8230 | はせがわ              | 9,700   | 315.00    | 3,055,500     |                            |
| 8233 | 高島屋               | 133,800 | 1,202.00  | 160,827,600   |                            |
| 8237 | 松屋                | 40,100  | 970.00    | 38,897,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 8242 | エイチ・ツー・オー リテイリング  | 87,000  | 946.00    | 82,302,000    |                            |
| 8244 | 近鉄百貨店             | 7,000   | 3,270.00  | 22,890,000    |                            |
| 8252 | 丸井グループ            | 155,400 | 2,142.00  | 332,866,800   | 貸付有価証券<br>800株             |
| 8255 | アクシアル リテイリング      | 15,200  | 4,905.00  | 74,556,000    |                            |
| 8260 | 井筒屋               | 9,300   | 253.00    | 2,352,900     | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 8267 | イオン               | 707,000 | 3,256.00  | 2,301,992,000 | 貸付有価証券<br>53,000株（53,000株） |
| 8273 | イズミ               | 37,400  | 4,560.00  | 170,544,000   |                            |
| 8276 | 平和堂               | 33,900  | 2,274.00  | 77,088,600    | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）   |
| 8278 | フジ                | 22,200  | 2,222.00  | 49,328,400    |                            |
| 8279 | ヤオコー              | 20,900  | 6,940.00  | 145,046,000   | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株）   |
| 8281 | ゼビオホールディングス       | 22,200  | 933.00    | 20,712,600    |                            |
| 8282 | ケーズホールディングス       | 163,600 | 1,538.00  | 251,616,800   |                            |
| 8289 | Olympicグループ       | 9,500   | 846.00    | 8,037,000     | 貸付有価証券<br>4,500株（2,300株）   |
| 8291 | 日産東京販売ホールディングス    | 27,000  | 261.00    | 7,047,000     |                            |
| 9262 | シルバーライフ           | 2,500   | 2,188.00  | 5,470,000     |                            |
| 9266 | 一家ダイニングプロジェクト     | 2,700   | 583.00    | 1,574,100     |                            |
| 9267 | Genky Drug Stores | 8,100   | 3,820.00  | 30,942,000    |                            |
| 9275 | ナルミヤ・インターナショナル    | 3,500   | 1,305.00  | 4,567,500     |                            |
| 9278 | ブックオフグループホールディングス | 10,700  | 947.00    | 10,132,900    | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）   |
| 9279 | ギフト               | 1,700   | 2,082.00  | 3,539,400     |                            |

|      |                   |         |           |               |                              |
|------|-------------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 9627 | アインホールディングス       | 26,700  | 7,160.00  | 191,172,000   | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株）     |
| 9828 | 元気寿司              | 5,100   | 2,728.00  | 13,912,800    | 貸付有価証券<br>100株（100株）         |
| 9831 | ヤマダホールディングス       | 615,800 | 615.00    | 378,717,000   | 貸付有価証券<br>141,000株（141,000株） |
| 9842 | アークランドサカモト        | 28,800  | 1,850.00  | 53,280,000    |                              |
| 9843 | ニトリホールディングス       | 72,900  | 20,750.00 | 1,512,675,000 |                              |
| 9850 | グルメ杵屋             | 13,100  | 999.00    | 13,086,900    |                              |
| 9854 | 愛眼                | 14,600  | 237.00    | 3,460,200     | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株）     |
| 9856 | ケーユーホールディングス      | 9,600   | 979.00    | 9,398,400     |                              |
| 9861 | 吉野家ホールディングス       | 60,400  | 2,293.00  | 138,497,200   |                              |
| 9887 | 松屋フーズホールディングス     | 8,800   | 3,535.00  | 31,108,000    | 貸付有価証券<br>700株（700株）         |
| 9900 | サガミホールディングス       | 24,900  | 1,188.00  | 29,581,200    |                              |
| 9919 | 関西スーパーマーケット       | 13,900  | 1,171.00  | 16,276,900    | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株）     |
| 9936 | 王将フードサービス         | 12,100  | 5,880.00  | 71,148,000    |                              |
| 9945 | プレナス              | 20,600  | 1,948.00  | 40,128,800    |                              |
| 9946 | ミニストップ            | 13,600  | 1,470.00  | 19,992,000    |                              |
| 9948 | アークス              | 35,100  | 2,399.00  | 84,204,900    | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）     |
| 9956 | バローホールディングス       | 37,500  | 2,577.00  | 96,637,500    | 貸付有価証券<br>2,600株（2,600株）     |
| 9966 | 藤久                | 4,300   | 756.00    | 3,250,800     |                              |
| 9974 | ベルク               | 9,100   | 6,280.00  | 57,148,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）         |
| 9979 | 大庄                | 9,800   | 1,003.00  | 9,829,400     | 貸付有価証券<br>700株（700株）         |
| 9983 | ファーストリテイリング       | 24,600  | 84,900.00 | 2,088,540,000 | 貸付有価証券<br>6,100株（6,100株）     |
| 9989 | サンドラッグ            | 69,100  | 4,070.00  | 281,237,000   |                              |
| 9990 | サックスパー ホールディングス   | 15,600  | 680.00    | 10,608,000    |                              |
| 9993 | ヤマザワ              | 4,300   | 1,744.00  | 7,499,200     |                              |
| 9994 | やまや               | 3,800   | 2,539.00  | 9,648,200     |                              |
| 9997 | ベルーナ              | 39,400  | 1,298.00  | 51,141,200    |                              |
| 7150 | 島根銀行              | 6,300   | 726.00    | 4,573,800     |                              |
| 7161 | じもとホールディングス       | 12,400  | 811.00    | 10,056,400    | 貸付有価証券<br>2,900株             |
| 7167 | めぶきフィナンシャルグループ    | 956,000 | 276.00    | 263,856,000   |                              |
| 7173 | 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 23,100  | 1,484.00  | 34,280,400    |                              |
| 7180 | 九州フィナンシャルグループ     | 375,700 | 499.00    | 187,474,300   |                              |
| 7182 | ゆうちょ銀行            | 521,300 | 1,114.00  | 580,728,200   | 貸付有価証券<br>131,300株（131,300株） |
| 7184 | 富山第一銀行            | 43,900  | 328.00    | 14,399,200    |                              |



|      |                     |            |          |               |                              |
|------|---------------------|------------|----------|---------------|------------------------------|
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,120,900  | 465.00   | 521,218,500   | 貸付有価証券<br>271,700株（271,700株） |
| 7189 | 西日本フィナンシャルホールディングス  | 122,400    | 831.00   | 101,714,400   |                              |
| 7321 | 関西みらいフィナンシャルグループ    | 86,400     | 658.00   | 56,851,200    |                              |
| 7322 | 三十三フィナンシャルグループ      | 15,900     | 1,528.00 | 24,295,200    |                              |
| 7327 | 第四北越フィナンシャルグループ     | 29,900     | 2,727.00 | 81,537,300    | 貸付有価証券<br>2,400株（2,400株）     |
| 7337 | ひろぎんホールディングス        | 271,400    | 727.00   | 197,307,800   | 貸付有価証券<br>16,300株（16,300株）   |
| 8303 | 新生銀行                | 150,000    | 1,922.00 | 288,300,000   |                              |
| 8304 | あおぞら銀行              | 109,600    | 2,595.00 | 284,412,000   |                              |
| 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 12,586,100 | 619.50   | 7,797,088,950 |                              |
| 8308 | りそなホールディングス         | 2,000,600  | 468.60   | 937,481,160   |                              |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス   | 347,800    | 3,946.00 | 1,372,418,800 | 貸付有価証券<br>12,900株（12,900株）   |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ     | 1,273,300  | 4,141.00 | 5,272,735,300 |                              |
| 8331 | 千葉銀行                | 614,000    | 738.00   | 453,132,000   | 貸付有価証券<br>150,100株（150,100株） |
| 8334 | 群馬銀行                | 378,700    | 417.00   | 157,917,900   |                              |
| 8336 | 武蔵野銀行               | 27,400     | 1,946.00 | 53,320,400    |                              |
| 8337 | 千葉興業銀行              | 46,800     | 315.00   | 14,742,000    |                              |
| 8338 | 筑波銀行                | 76,500     | 191.00   | 14,611,500    | 貸付有価証券<br>19,200株（19,200株）   |
| 8341 | 七十七銀行               | 57,700     | 1,635.00 | 94,339,500    |                              |
| 8342 | 青森銀行                | 14,300     | 2,655.00 | 37,966,500    |                              |
| 8343 | 秋田銀行                | 11,000     | 1,565.00 | 17,215,000    |                              |
| 8344 | 山形銀行                | 20,700     | 1,201.00 | 24,860,700    |                              |
| 8345 | 岩手銀行                | 12,100     | 2,621.00 | 31,714,100    |                              |
| 8346 | 東邦銀行                | 164,500    | 266.00   | 43,757,000    | 貸付有価証券<br>5,600株（5,600株）     |
| 8349 | 東北銀行                | 8,800      | 1,170.00 | 10,296,000    |                              |
| 8350 | みちのく銀行              | 11,800     | 1,148.00 | 13,546,400    |                              |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ     | 166,100    | 2,230.00 | 370,403,000   |                              |
| 8355 | 静岡銀行                | 448,100    | 893.00   | 400,153,300   | 貸付有価証券<br>114,700株（114,700株） |
| 8356 | 十六銀行                | 23,100     | 2,326.00 | 53,730,600    |                              |
| 8358 | スルガ銀行               | 161,300    | 453.00   | 73,068,900    | 貸付有価証券<br>14,100株（14,100株）   |
| 8359 | 八十二銀行               | 414,400    | 418.00   | 173,219,200   |                              |
| 8360 | 山梨中央銀行              | 21,400     | 967.00   | 20,693,800    |                              |
| 8361 | 大垣共立銀行              | 36,300     | 2,331.00 | 84,615,300    |                              |
| 8362 | 福井銀行                | 15,700     | 2,091.00 | 32,828,700    |                              |
| 8363 | 北國銀行                | 17,100     | 2,920.00 | 49,932,000    |                              |

|      |                 |           |          |               |                            |
|------|-----------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 8364 | 清水銀行            | 7,600     | 1,804.00 | 13,710,400    |                            |
| 8365 | 富山銀行            | 3,500     | 3,180.00 | 11,130,000    | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 8366 | 滋賀銀行            | 36,900    | 2,443.00 | 90,146,700    |                            |
| 8367 | 南都銀行            | 26,800    | 2,089.00 | 55,985,200    |                            |
| 8368 | 百五銀行            | 165,600   | 348.00   | 57,628,800    |                            |
| 8369 | 京都銀行            | 65,900    | 6,950.00 | 458,005,000   |                            |
| 8370 | 紀陽銀行            | 65,100    | 1,732.00 | 112,753,200   | 貸付有価証券<br>16,400株（16,400株） |
| 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ | 122,500   | 1,086.00 | 133,035,000   |                            |
| 8381 | 山陰合同銀行          | 115,900   | 588.00   | 68,149,200    |                            |
| 8382 | 中国銀行            | 158,300   | 975.00   | 154,342,500   | 貸付有価証券<br>11,900株（11,900株） |
| 8383 | 鳥取銀行            | 5,900     | 1,186.00 | 6,997,400     |                            |
| 8385 | 伊予銀行            | 243,800   | 709.00   | 172,854,200   |                            |
| 8386 | 百十四銀行           | 19,500    | 1,809.00 | 35,275,500    |                            |
| 8387 | 四国銀行            | 26,100    | 856.00   | 22,341,600    |                            |
| 8388 | 阿波銀行            | 28,200    | 2,594.00 | 73,150,800    | 貸付有価証券<br>2,200株（2,200株）   |
| 8392 | 大分銀行            | 10,600    | 2,339.00 | 24,793,400    |                            |
| 8393 | 宮崎銀行            | 11,500    | 2,509.00 | 28,853,500    |                            |
| 8395 | 佐賀銀行            | 10,400    | 1,590.00 | 16,536,000    |                            |
| 8397 | 沖縄銀行            | 16,800    | 3,115.00 | 52,332,000    | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）   |
| 8399 | 琉球銀行            | 39,900    | 828.00   | 33,037,200    |                            |
| 8410 | セブン銀行           | 614,700   | 266.00   | 163,510,200   |                            |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ  | 2,500,100 | 1,650.00 | 4,125,165,000 |                            |
| 8416 | 高知銀行            | 6,700     | 847.00   | 5,674,900     |                            |
| 8418 | 山口フィナンシャルグループ   | 229,700   | 786.00   | 180,544,200   |                            |
| 8521 | 長野銀行            | 6,000     | 1,432.00 | 8,592,000     |                            |
| 8522 | 名古屋銀行           | 14,800    | 3,315.00 | 49,062,000    | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株）   |
| 8524 | 北洋銀行            | 277,400   | 326.00   | 90,432,400    | 貸付有価証券<br>20,800株（20,800株） |
| 8527 | 愛知銀行            | 6,200     | 3,195.00 | 19,809,000    |                            |
| 8530 | 中京銀行            | 6,600     | 1,866.00 | 12,315,600    |                            |
| 8537 | 大光銀行            | 6,300     | 1,615.00 | 10,174,500    |                            |
| 8541 | 愛媛銀行            | 25,700    | 1,089.00 | 27,987,300    |                            |
| 8542 | トマト銀行           | 7,100     | 1,194.00 | 8,477,400     |                            |
| 8544 | 京葉銀行            | 78,500    | 489.00   | 38,386,500    |                            |
| 8550 | 栃木銀行            | 88,900    | 205.00   | 18,224,500    | 貸付有価証券<br>6,700株（6,700株）   |
| 8551 | 北日本銀行           | 5,700     | 2,156.00 | 12,289,200    |                            |
| 8558 | 東和銀行            | 32,300    | 743.00   | 23,998,900    |                            |
| 8562 | 福島銀行            | 21,100    | 271.00   | 5,718,100     | 貸付有価証券<br>4,900株（800株）     |

|      |                      |           |          |               |                            |
|------|----------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 8563 | 大東銀行                 | 8,800     | 761.00   | 6,696,800     |                            |
| 8600 | トモニホールディングス          | 142,200   | 341.00   | 48,490,200    |                            |
| 8713 | フィデアホールディングス         | 178,600   | 149.00   | 26,611,400    |                            |
| 8714 | 池田泉州ホールディングス         | 211,600   | 191.00   | 40,415,600    |                            |
| 7148 | F P G                | 56,700    | 722.00   | 40,937,400    |                            |
| 7172 | ジャパンインベストメントアドバイザー   | 9,300     | 1,460.00 | 13,578,000    |                            |
| 7190 | マーキュリアインベストメント       | 7,200     | 805.00   | 5,796,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| 8473 | S B I ホールディングス       | 225,600   | 3,075.00 | 693,720,000   |                            |
| 8518 | 日本アジア投資              | 15,500    | 273.00   | 4,231,500     |                            |
| 8595 | ジャフコ グループ            | 28,300    | 6,650.00 | 188,195,000   |                            |
| 8601 | 大和証券グループ本社           | 1,377,900 | 585.00   | 806,071,500   |                            |
| 8604 | 野村ホールディングス           | 2,809,200 | 708.60   | 1,990,599,120 |                            |
| 8609 | 岡三証券グループ             | 156,800   | 479.00   | 75,107,200    | 貸付有価証券<br>11,700株（11,700株） |
| 8613 | 丸三証券                 | 54,600    | 713.00   | 38,929,800    |                            |
| 8614 | 東洋証券                 | 60,700    | 205.00   | 12,443,500    | 貸付有価証券<br>16,600株（16,600株） |
| 8616 | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 196,200   | 425.00   | 83,385,000    |                            |
| 8617 | 光世証券                 | 4,400     | 795.00   | 3,498,000     | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 8622 | 水戸証券                 | 49,100    | 342.00   | 16,792,200    | 貸付有価証券<br>13,400株（13,400株） |
| 8624 | いちよし証券               | 36,900    | 656.00   | 24,206,400    |                            |
| 8628 | 松井証券                 | 90,100    | 924.00   | 83,252,400    |                            |
| 8698 | マネックスグループ            | 165,000   | 894.00   | 147,510,000   | 貸付有価証券<br>34,600株（34,600株） |
| 8706 | 極東証券                 | 24,700    | 923.00   | 22,798,100    |                            |
| 8707 | 岩井コスモホールディングス        | 18,800    | 1,950.00 | 36,660,000    |                            |
| 8708 | 藍澤證券                 | 33,000    | 1,079.00 | 35,607,000    | 貸付有価証券<br>2,500株（2,500株）   |
| 8732 | マネーパートナーズグループ        | 19,600    | 262.00   | 5,135,200     | 貸付有価証券<br>6,100株（1,500株）   |
| 8739 | スパークス・グループ           | 85,000    | 314.00   | 26,690,000    |                            |
| 8742 | 小林洋行                 | 5,300     | 298.00   | 1,579,400     |                            |
| 7181 | かんぽ生命保険              | 228,100   | 2,372.00 | 541,053,200   |                            |
| 8630 | SOMPOホールディングス        | 324,300   | 4,387.00 | 1,422,704,100 |                            |
| 8715 | アニコム ホールディングス        | 51,800    | 1,029.00 | 53,302,200    |                            |
| 8725 | MS&ADインシュアランスグループホール | 446,800   | 3,363.00 | 1,502,588,400 |                            |
| 8750 | 第一生命ホールディングス         | 972,000   | 1,918.50 | 1,864,782,000 |                            |
| 8766 | 東京海上ホールディングス         | 609,900   | 5,462.00 | 3,331,273,800 |                            |
| 8795 | T & Dホールディングス        | 549,900   | 1,438.00 | 790,756,200   |                            |
| 8798 | アドバンスクリエイト           | 3,800     | 2,200.00 | 8,360,000     | 貸付有価証券<br>1,000株           |

|      |                  |           |          |               |                            |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 7164 | 全国保証             | 47,900    | 5,010.00 | 239,979,000   | 貸付有価証券<br>13,000株（13,000株） |
| 7187 | ジェイリース           | 6,100     | 777.00   | 4,739,700     |                            |
| 7191 | イントラスト           | 5,200     | 689.00   | 3,582,800     |                            |
| 7192 | 日本モーゲージサービス      | 9,300     | 1,232.00 | 11,457,600    | 貸付有価証券<br>2,100株（600株）     |
| 7196 | C a s a          | 5,100     | 990.00   | 5,049,000     | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| 7198 | アルヒ              | 27,200    | 1,746.00 | 47,491,200    |                            |
| 7199 | プレミアムグループ        | 8,500     | 2,419.00 | 20,561,500    | 貸付有価証券<br>800株             |
| 8253 | クレディセゾン          | 107,400   | 1,397.00 | 150,037,800   | 貸付有価証券<br>26,300株（26,300株） |
| 8424 | 芙蓉総合リース          | 19,300    | 7,800.00 | 150,540,000   | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）   |
| 8425 | みずほリース           | 28,400    | 3,455.00 | 98,122,000    |                            |
| 8439 | 東京センチュリー         | 42,800    | 7,200.00 | 308,160,000   |                            |
| 8511 | 日本証券金融           | 77,800    | 800.00   | 62,240,000    |                            |
| 8515 | アイフル             | 308,700   | 320.00   | 98,784,000    | 貸付有価証券<br>70,600株（70,600株） |
| 8566 | リコーリース           | 14,500    | 3,755.00 | 54,447,500    |                            |
| 8570 | イオンフィナンシャルサービス   | 112,600   | 1,515.00 | 170,589,000   |                            |
| 8572 | アコム              | 369,800   | 520.00   | 192,296,000   | 貸付有価証券<br>27,700株（27,700株） |
| 8584 | ジャックス            | 20,300    | 2,376.00 | 48,232,800    |                            |
| 8585 | オリエントコーポレーション    | 497,700   | 159.00   | 79,134,300    |                            |
| 8586 | 日立キャピタル          | 43,400    | 3,435.00 | 149,079,000   |                            |
| 8591 | オリックス            | 1,117,000 | 1,934.00 | 2,160,278,000 |                            |
| 8593 | 三菱UFJリース         | 415,100   | 681.00   | 282,683,100   | 貸付有価証券<br>34,800株（34,800株） |
| 8596 | 九州リースサービス        | 9,000     | 747.00   | 6,723,000     |                            |
| 8697 | 日本取引所グループ        | 497,000   | 2,658.00 | 1,321,026,000 |                            |
| 8771 | イー・ギャランティ        | 21,000    | 2,070.00 | 43,470,000    | 貸付有価証券<br>5,000株（5,000株）   |
| 8772 | アサックス            | 9,600     | 757.00   | 7,267,200     |                            |
| 8793 | NECキャピタルソリューション  | 7,500     | 2,152.00 | 16,140,000    |                            |
| 2337 | いちご              | 204,900   | 332.00   | 68,026,800    |                            |
| 2353 | 日本駐車場開発          | 181,600   | 159.00   | 28,874,400    |                            |
| 2975 | スター・マイカ・ホールディングス | 9,500     | 1,240.00 | 11,780,000    |                            |
| 2980 | SREホールディングス      | 2,000     | 4,235.00 | 8,470,000     |                            |
| 2982 | ADワークスグループ       | 35,200    | 162.00   | 5,702,400     |                            |
| 3003 | ヒューリック           | 390,300   | 1,308.00 | 510,512,400   | 貸付有価証券<br>29,400株（29,400株） |
| 3228 | 三栄建築設計           | 7,400     | 1,792.00 | 13,260,800    |                            |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス    | 111,800   | 2,639.00 | 295,040,200   |                            |
| 3232 | 三重交通グループホールディングス | 37,300    | 519.00   | 19,358,700    |                            |

|      |                  |           |          |               |                            |
|------|------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 3244 | サムティ             | 26,100    | 2,002.00 | 52,252,200    |                            |
| 3245 | ディア・ライフ          | 26,000    | 462.00   | 12,012,000    |                            |
| 3246 | コーセーアールイー        | 5,400     | 632.00   | 3,412,800     |                            |
| 3252 | 日本商業開発           | 11,600    | 1,683.00 | 19,522,800    |                            |
| 3254 | プレサンスコーポレーション    | 30,300    | 1,708.00 | 51,752,400    |                            |
| 3271 | THEグローバル社        | 11,500    | 268.00   | 3,082,000     |                            |
| 3275 | ハウスコム            | 3,200     | 1,335.00 | 4,272,000     |                            |
| 3276 | 日本管理センター         | 9,900     | 1,214.00 | 12,018,600    | 貸付有価証券<br>900株（900株）       |
| 3277 | サンセイランディック       | 5,400     | 836.00   | 4,514,400     |                            |
| 3280 | エストラスト           | 2,100     | 707.00   | 1,484,700     |                            |
| 3284 | フージャースホールディングス   | 30,000    | 737.00   | 22,110,000    | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）   |
| 3288 | オープンハウス          | 58,000    | 4,665.00 | 270,570,000   |                            |
| 3289 | 東急不動産ホールディングス    | 500,300   | 677.00   | 338,703,100   |                            |
| 3291 | 飯田グループホールディングス   | 153,500   | 2,750.00 | 422,125,000   |                            |
| 3294 | イーグランド           | 3,000     | 977.00   | 2,931,000     |                            |
| 3299 | ムゲンエステート         | 11,300    | 511.00   | 5,774,300     |                            |
| 3452 | ビーロット            | 8,600     | 704.00   | 6,054,400     |                            |
| 3454 | ファーストブラザーズ       | 3,300     | 1,012.00 | 3,339,600     |                            |
| 3457 | ハウスドゥ            | 9,000     | 1,142.00 | 10,278,000    |                            |
| 3458 | シーアールイー          | 4,700     | 1,312.00 | 6,166,400     | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 3464 | プロパティエージェント      | 2,900     | 2,333.00 | 6,765,700     | 貸付有価証券<br>900株（200株）       |
| 3465 | ケイアイスター不動産       | 5,800     | 3,985.00 | 23,113,000    |                            |
| 3467 | アグレ都市デザイン        | 3,300     | 1,140.00 | 3,762,000     |                            |
| 3475 | グッドコムアセット        | 8,800     | 1,310.00 | 11,528,000    | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 3480 | ジェイ・エス・ビー        | 3,400     | 3,295.00 | 11,203,000    | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| 3484 | テンポイノベーション       | 5,200     | 909.00   | 4,726,800     | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| 3486 | グローバル・リンク・マネジメント | 3,100     | 869.00   | 2,693,900     |                            |
| 4666 | パーク２４            | 98,800    | 2,063.00 | 203,824,400   |                            |
| 4809 | パラカ              | 4,800     | 1,658.00 | 7,958,400     |                            |
| 8801 | 三井不動産            | 838,600   | 2,518.00 | 2,111,594,800 |                            |
| 8802 | 三菱地所             | 1,208,700 | 1,958.00 | 2,366,634,600 | 貸付有価証券<br>96,600株（96,600株） |
| 8803 | 平和不動産            | 31,500    | 3,580.00 | 112,770,000   | 貸付有価証券<br>3,500株（3,500株）   |
| 8804 | 東京建物             | 181,700   | 1,677.00 | 304,710,900   |                            |
| 8806 | ダイビル             | 47,400    | 1,395.00 | 66,123,000    |                            |
| 8818 | 京阪神ビルディング        | 31,700    | 1,532.00 | 48,564,400    |                            |
| 8830 | 住友不動産            | 413,600   | 3,819.00 | 1,579,538,400 |                            |

|      |                 |           |          |             |                            |
|------|-----------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
| 8841 | テーオーシー          | 36,100    | 832.00   | 30,035,200  | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株）   |
| 8842 | 東京楽天地           | 3,000     | 4,885.00 | 14,655,000  |                            |
| 8848 | レオパレス２１         | 152,600   | 152.00   | 23,195,200  | 貸付有価証券<br>53,600株（15,800株） |
| 8850 | スターツコーポレーション    | 21,900    | 3,030.00 | 66,357,000  | 貸付有価証券<br>1,900株（1,900株）   |
| 8860 | フジ住宅            | 21,300    | 755.00   | 16,081,500  |                            |
| 8864 | 空港施設            | 18,400    | 605.00   | 11,132,000  |                            |
| 8869 | 明和地所            | 8,700     | 732.00   | 6,368,400   |                            |
| 8871 | ゴールドクレスト        | 16,600    | 1,732.00 | 28,751,200  |                            |
| 8877 | エスリード           | 7,200     | 1,801.00 | 12,967,200  |                            |
| 8881 | 日神グループホールディングス  | 27,200    | 522.00   | 14,198,400  |                            |
| 8892 | 日本エスコン          | 33,300    | 787.00   | 26,207,100  | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 8897 | タカラレーベン         | 77,100    | 389.00   | 29,991,900  |                            |
| 8904 | A V A N T I A   | 10,300    | 880.00   | 9,064,000   |                            |
| 8905 | イオンモール          | 92,300    | 1,949.00 | 179,892,700 |                            |
| 8908 | 毎日コムネット         | 4,700     | 740.00   | 3,478,000   |                            |
| 8917 | ファースト住建         | 7,800     | 1,335.00 | 10,413,000  | 貸付有価証券<br>600株             |
| 8918 | ランド             | 1,001,500 | 10.00    | 10,015,000  | 貸付有価証券<br>74,200株（74,200株） |
| 8919 | カチタス            | 45,600    | 3,060.00 | 139,536,000 |                            |
| 8923 | トーセイ            | 25,400    | 1,148.00 | 29,159,200  |                            |
| 8928 | 穴吹興産            | 4,000     | 1,887.00 | 7,548,000   |                            |
| 8934 | サンフロンティア不動産     | 22,600    | 1,052.00 | 23,775,200  |                            |
| 8935 | エフ・ジェー・ネクスト     | 18,100    | 1,218.00 | 22,045,800  | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| 8940 | インテリックス         | 4,100     | 666.00   | 2,730,600   |                            |
| 8944 | ランドビジネス         | 6,200     | 402.00   | 2,492,400   |                            |
| 8945 | サンネクスタグループ      | 5,800     | 1,000.00 | 5,800,000   |                            |
| 8999 | グランディハウス        | 12,500    | 515.00   | 6,437,500   |                            |
| 9706 | 日本空港ビルデング       | 63,900    | 5,140.00 | 328,446,000 | 貸付有価証券<br>14,800株（14,800株） |
| 1717 | 明豊ファシリティワークス    | 8,100     | 683.00   | 5,532,300   |                            |
| 1954 | 日本工営            | 11,100    | 3,140.00 | 34,854,000  |                            |
| 2120 | L I F U L L     | 62,200    | 413.00   | 25,688,600  |                            |
| 2121 | ミクシィ            | 34,000    | 2,840.00 | 96,560,000  |                            |
| 2124 | ジェイエイシーリクルートメント | 12,000    | 1,729.00 | 20,748,000  |                            |
| 2127 | 日本M&Aセンター       | 146,100   | 5,910.00 | 863,451,000 | 貸付有価証券<br>9,100株（9,100株）   |
| 2130 | メンバーズ           | 5,300     | 2,431.00 | 12,884,300  |                            |
| 2139 | 中広              | 2,400     | 350.00   | 840,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |

|      |               |         |          |             |                            |
|------|---------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 2146 | ＵＴグループ        | 25,700  | 3,370.00 | 86,609,000  | 貸付有価証券<br>2,900株（2,900株）   |
| 2148 | アイティメディア      | 5,900   | 1,812.00 | 10,690,800  |                            |
| 2151 | タケエイ          | 19,900  | 1,262.00 | 25,113,800  |                            |
| 2153 | Ｅ・Ｊホールディングス   | 7,000   | 1,078.00 | 7,546,000   | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 2154 | ビーネックスグループ    | 22,400  | 1,563.00 | 35,011,200  | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）   |
| 2157 | コシダカホールディングス  | 42,900  | 592.00   | 25,396,800  | 貸付有価証券<br>7,800株（4,400株）   |
| 2163 | アルトナー         | 4,300   | 834.00   | 3,586,200   |                            |
| 2168 | パソナグループ       | 19,300  | 1,817.00 | 35,068,100  | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株）   |
| 2169 | ＣＤＳ           | 4,400   | 1,471.00 | 6,472,400   |                            |
| 2170 | リンクアンドモチベーション | 32,700  | 568.00   | 18,573,600  | 貸付有価証券<br>9,300株           |
| 2174 | ＧＣＡ           | 23,300  | 855.00   | 19,921,500  |                            |
| 2175 | エス・エム・エス      | 60,500  | 3,210.00 | 194,205,000 | 貸付有価証券<br>13,800株（13,800株） |
| 2180 | サニーサイドアップグループ | 6,200   | 739.00   | 4,581,800   | 貸付有価証券<br>1,300株（300株）     |
| 2181 | パーソルホールディングス  | 178,200 | 2,150.00 | 383,130,000 |                            |
| 2183 | リニカル          | 10,000  | 786.00   | 7,860,000   | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株）   |
| 2193 | クックパッド        | 56,000  | 316.00   | 17,696,000  | 貸付有価証券<br>14,800株          |
| 2196 | エスクリ          | 5,600   | 479.00   | 2,682,400   |                            |
| 2198 | アイ・ケイ・ケイ      | 8,700   | 672.00   | 5,846,400   |                            |
| 2301 | 学情            | 6,300   | 1,567.00 | 9,872,100   | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| 2305 | スタジオアリス       | 9,000   | 2,071.00 | 18,639,000  |                            |
| 2309 | シミックホールディングス  | 8,800   | 1,577.00 | 13,877,600  |                            |
| 2311 | エプコ           | 4,300   | 992.00   | 4,265,600   |                            |
| 2325 | ＮＪＳ           | 4,400   | 2,013.00 | 8,857,200   |                            |
| 2331 | 総合警備保障        | 70,900  | 5,270.00 | 373,643,000 |                            |
| 2371 | カカクコム         | 131,700 | 3,055.00 | 402,343,500 | 貸付有価証券<br>10,000株（10,000株） |
| 2372 | アイロムグループ      | 6,400   | 2,421.00 | 15,494,400  | 貸付有価証券<br>2,000株（500株）     |
| 2374 | セントケア・ホールディング | 13,000  | 1,291.00 | 16,783,000  |                            |
| 2376 | サイネックス        | 3,000   | 702.00   | 2,106,000   |                            |
| 2378 | ルネサンス         | 11,100  | 1,200.00 | 13,320,000  |                            |
| 2379 | ディップ          | 27,900  | 2,819.00 | 78,650,100  | 貸付有価証券<br>1,900株（1,900株）   |
| 2389 | デジタルホールディングス  | 12,400  | 2,057.00 | 25,506,800  | 貸付有価証券<br>700株（700株）       |
| 2395 | 新日本科学         | 21,700  | 647.00   | 14,039,900  | 貸付有価証券<br>6,100株（1,500株）   |

|      |                  |         |          |               |                            |
|------|------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 2398 | ツクイホールディングス      | 42,000  | 922.00   | 38,724,000    |                            |
| 2410 | キャリアデザインセンター     | 4,100   | 1,074.00 | 4,403,400     | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| 2412 | ベネフィット・ワン        | 64,900  | 2,830.00 | 183,667,000   | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株）   |
| 2413 | エムスリー            | 314,500 | 7,344.00 | 2,309,688,000 |                            |
| 2418 | ツカダ・グローバルホールディング | 14,200  | 342.00   | 4,856,400     | 貸付有価証券<br>2,800株（100株）     |
| 2424 | プラス              | 2,300   | 651.00   | 1,497,300     |                            |
| 2427 | アウトソーシング         | 102,100 | 1,764.00 | 180,104,400   |                            |
| 2428 | ウェルネット           | 18,000  | 556.00   | 10,008,000    | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）   |
| 2429 | ワールドホールディングス     | 6,100   | 2,804.00 | 17,104,400    |                            |
| 2432 | ディー・エヌ・エー        | 75,400  | 2,138.00 | 161,205,200   | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 2433 | 博報堂ＤＹホールディングス    | 248,100 | 1,867.00 | 463,202,700   | 貸付有価証券<br>52,600株（52,600株） |
| 2440 | ぐるなび             | 31,000  | 617.00   | 19,127,000    | 貸付有価証券<br>15,100株（7,800株）  |
| 2445 | タカミヤ             | 21,600  | 614.00   | 13,262,400    |                            |
| 2453 | ジャパンベストレスキューシステム | 14,100  | 864.00   | 12,182,400    |                            |
| 2461 | ファンコミュニケーションズ    | 49,000  | 419.00   | 20,531,000    |                            |
| 2462 | ライク              | 4,700   | 1,912.00 | 8,986,400     |                            |
| 2464 | ビジネス・ブレークスルー     | 7,400   | 462.00   | 3,418,800     | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 2471 | エスプール            | 45,800  | 1,092.00 | 50,013,600    |                            |
| 2475 | ＷＤＢホールディングス      | 8,100   | 2,649.00 | 21,456,900    |                            |
| 2477 | 手間いらず            | 1,700   | 5,120.00 | 8,704,000     |                            |
| 2485 | ティア              | 10,400  | 510.00   | 5,304,000     | 貸付有価証券<br>800株（800株）       |
| 2487 | ＣＤＧ              | 1,600   | 1,596.00 | 2,553,600     |                            |
| 2489 | アドウェイズ           | 21,700  | 736.00   | 15,971,200    |                            |
| 2491 | バリューコマース         | 12,000  | 3,390.00 | 40,680,000    |                            |
| 2492 | インフォマート          | 180,300 | 919.00   | 165,695,700   | 貸付有価証券<br>14,600株（14,600株） |
| 2749 | ＪＰホールディングス       | 50,900  | 290.00   | 14,761,000    |                            |
| 3521 | エコナックホールディングス    | 32,200  | 99.00    | 3,187,800     |                            |
| 4282 | ＥＰＳホールディングス      | 24,100  | 1,203.00 | 28,992,300    |                            |
| 4286 | レッグス             | 4,400   | 1,672.00 | 7,356,800     |                            |
| 4290 | プレステージ・インターナショナル | 66,800  | 826.00   | 55,176,800    | 貸付有価証券<br>5,000株（5,000株）   |
| 4301 | アミューズ            | 9,700   | 2,600.00 | 25,220,000    |                            |
| 4310 | ドリームインキュベータ      | 5,400   | 1,148.00 | 6,199,200     |                            |
| 4318 | クイック             | 11,100  | 1,239.00 | 13,752,900    |                            |
| 4319 | ＴＡＣ              | 9,600   | 257.00   | 2,467,200     | 貸付有価証券<br>800株（800株）       |



|      |                    |         |           |               |                            |
|------|--------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 4324 | 電通グループ             | 200,400 | 3,660.00  | 733,464,000   | 貸付有価証券<br>13,800株（13,800株） |
| 4331 | テイクアンドギヴ・ニーズ       | 8,300   | 900.00    | 7,470,000     |                            |
| 4337 | ぴあ                 | 5,100   | 3,030.00  | 15,453,000    | 貸付有価証券<br>2,400株（1,200株）   |
| 4343 | イオンファンタジー          | 6,900   | 2,430.00  | 16,767,000    |                            |
| 4345 | シーティーエス            | 20,100  | 878.00    | 17,647,800    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）   |
| 4346 | ネクシィーズグループ         | 5,400   | 1,020.00  | 5,508,000     |                            |
| 4544 | H. U. グループホールディングス | 49,900  | 3,595.00  | 179,390,500   |                            |
| 4641 | アルプス技研             | 15,800  | 2,130.00  | 33,654,000    |                            |
| 4651 | サニックス              | 28,300  | 314.00    | 8,886,200     | 貸付有価証券<br>15,200株（7,800株）  |
| 4653 | ダイオーズ              | 3,500   | 981.00    | 3,433,500     |                            |
| 4658 | 日本空調サービス           | 18,700  | 768.00    | 14,361,600    |                            |
| 4661 | オリエンタルランド          | 189,600 | 16,500.00 | 3,128,400,000 | 貸付有価証券<br>14,300株（14,300株） |
| 4665 | ダスキン               | 41,300  | 2,789.00  | 115,185,700   |                            |
| 4668 | 明光ネットワークジャパン       | 22,500  | 579.00    | 13,027,500    |                            |
| 4671 | ファルコホールディングス       | 8,500   | 1,806.00  | 15,351,000    |                            |
| 4678 | 秀英予備校              | 3,900   | 433.00    | 1,688,700     |                            |
| 4679 | 田谷                 | 3,200   | 585.00    | 1,872,000     |                            |
| 4680 | ラウンドワン             | 60,800  | 1,208.00  | 73,446,400    | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株）   |
| 4681 | リゾートトラスト           | 81,700  | 1,837.00  | 150,082,900   | 貸付有価証券<br>6,100株（6,100株）   |
| 4694 | ビー・エム・エル           | 22,900  | 3,685.00  | 84,386,500    |                            |
| 4696 | ワタベウェディング          | 2,300   | 249.00    | 572,700       | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| 4708 | りらいあコミュニケーションズ     | 27,100  | 1,477.00  | 40,026,700    | 貸付有価証券<br>2,400株（2,400株）   |
| 4714 | リソー教育              | 90,500  | 338.00    | 30,589,000    |                            |
| 4718 | 早稲田アカデミー           | 7,500   | 930.00    | 6,975,000     | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| 4732 | ユー・エス・エス           | 199,600 | 2,140.00  | 427,144,000   |                            |
| 4745 | 東京個別指導学院           | 15,700  | 628.00    | 9,859,600     |                            |
| 4751 | サイバーエージェント         | 109,800 | 7,170.00  | 787,266,000   | 貸付有価証券<br>7,700株（7,700株）   |
| 4755 | 楽天                 | 830,900 | 1,336.00  | 1,110,082,400 |                            |
| 4763 | クリーク・アンド・リバー社      | 9,300   | 1,454.00  | 13,522,200    |                            |
| 4765 | モーニングスター           | 19,500  | 485.00    | 9,457,500     |                            |
| 4767 | テー・オー・ダブリュー        | 31,200  | 319.00    | 9,952,800     | 貸付有価証券<br>2,400株（2,400株）   |
| 4792 | 山田コンサルティンググループ     | 10,400  | 1,047.00  | 10,888,800    |                            |
| 4801 | セントラルスポーツ          | 6,600   | 2,630.00  | 17,358,000    | 貸付有価証券<br>2,100株（500株）     |
| 4848 | フルキャストホールディングス     | 15,600  | 1,936.00  | 30,201,600    |                            |

|      |                     |           |           |               |                          |
|------|---------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| 4849 | エン・ジャパン             | 31,700    | 3,175.00  | 100,647,500   |                          |
| 5261 | リソルホールディングス         | 1,900     | 4,320.00  | 8,208,000     |                          |
| 6028 | テクノプロ・ホールディングス      | 35,600    | 8,710.00  | 310,076,000   | 貸付有価証券<br>2,700株（2,700株） |
| 6029 | アトラ                 | 4,100     | 353.00    | 1,447,300     | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| 6032 | インターワークス            | 5,100     | 409.00    | 2,085,900     |                          |
| 6035 | アイ・アールジャパンホールディングス  | 7,200     | 12,780.00 | 92,016,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 6036 | Keepertech          | 11,500    | 2,328.00  | 26,772,000    |                          |
| 6037 | ファーストロジック           | 3,400     | 790.00    | 2,686,000     | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| 6044 | 三機サービス              | 3,400     | 1,082.00  | 3,678,800     | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 6047 | Gunosy              | 11,100    | 824.00    | 9,146,400     |                          |
| 6048 | デザインワン・ジャパン         | 5,300     | 241.00    | 1,277,300     | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 6050 | イー・ガーディアン           | 7,800     | 2,848.00  | 22,214,400    |                          |
| 6054 | リブセンス               | 9,800     | 236.00    | 2,312,800     | 貸付有価証券<br>2,900株（2,900株） |
| 6055 | ジャパンマテリアル           | 54,800    | 1,360.00  | 74,528,000    |                          |
| 6058 | ベクトル                | 22,200    | 1,235.00  | 27,417,000    |                          |
| 6059 | ウチヤマホールディングス        | 8,800     | 404.00    | 3,555,200     | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| 6062 | チャーム・ケア・コーポレーション    | 13,300    | 1,307.00  | 17,383,100    | 貸付有価証券<br>3,300株         |
| 6070 | キャリアリンク             | 5,800     | 2,285.00  | 13,253,000    | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 6071 | I B J               | 14,600    | 951.00    | 13,884,600    |                          |
| 6073 | アサンテ                | 6,400     | 1,832.00  | 11,724,800    |                          |
| 6077 | N・フィールド             | 12,200    | 1,197.00  | 14,603,400    |                          |
| 6078 | バリューHR              | 7,100     | 1,589.00  | 11,281,900    | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 6080 | M&Aキャピタルパートナーズ      | 14,600    | 5,390.00  | 78,694,000    |                          |
| 6082 | ライドオンエクスプレスホールディングス | 6,900     | 1,711.00  | 11,805,900    | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| 6083 | ERIホールディングス         | 5,000     | 610.00    | 3,050,000     |                          |
| 6087 | アピスト                | 2,800     | 3,245.00  | 9,086,000     | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 6088 | シグマクシス              | 9,800     | 1,875.00  | 18,375,000    |                          |
| 6089 | ウィルグループ             | 13,000    | 1,030.00  | 13,390,000    |                          |
| 6093 | エスクロー・エージェント・ジャパン   | 26,400    | 298.00    | 7,867,200     |                          |
| 6095 | メドピア                | 8,400     | 6,330.00  | 53,172,000    | 貸付有価証券<br>2,800株（800株）   |
| 6096 | レアジョブ               | 2,500     | 2,174.00  | 5,435,000     |                          |
| 6098 | リクルートホールディングス       | 1,276,900 | 5,126.00  | 6,545,389,400 |                          |
| 6099 | エラン                 | 24,600    | 1,387.00  | 34,120,200    |                          |
| 6171 | 土木管理総合試験所           | 8,700     | 352.00    | 3,062,400     |                          |

|      |                       |           |           |               |                              |
|------|-----------------------|-----------|-----------|---------------|------------------------------|
| 6175 | ネットマーケティング            | 8,600     | 583.00    | 5,013,800     | 貸付有価証券<br>2,000株（500株）       |
| 6178 | 日本郵政                  | 1,348,600 | 1,061.50  | 1,431,538,900 | 貸付有価証券<br>109,500株（109,500株） |
| 6183 | ベルシステム24ホールディングス      | 29,900    | 1,896.00  | 56,690,400    | 貸付有価証券<br>2,200株（2,200株）     |
| 6184 | 鎌倉新書                  | 18,000    | 1,252.00  | 22,536,000    |                              |
| 6185 | SMN                   | 3,800     | 763.00    | 2,899,400     | 貸付有価証券<br>200株（200株）         |
| 6186 | 一蔵                    | 2,200     | 416.00    | 915,200       |                              |
| 6187 | LITALICO              | 7,200     | 3,915.00  | 28,188,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株）         |
| 6189 | グローバルキッズCOMPANY       | 3,200     | 1,016.00  | 3,251,200     |                              |
| 6191 | エアトリ                  | 9,600     | 2,140.00  | 20,544,000    |                              |
| 6194 | アトラエ                  | 5,400     | 3,365.00  | 18,171,000    | 貸付有価証券<br>1,100株             |
| 6196 | ストライク                 | 6,700     | 4,955.00  | 33,198,500    |                              |
| 6197 | ソラスト                  | 43,700    | 1,352.00  | 59,082,400    |                              |
| 6199 | セラク                   | 5,600     | 1,811.00  | 10,141,600    |                              |
| 6200 | インソース                 | 14,800    | 2,260.00  | 33,448,000    |                              |
| 6532 | ベイカレント・コンサルティング       | 11,700    | 24,820.00 | 290,394,000   | 貸付有価証券<br>800株（800株）         |
| 6533 | Orchestra Holdings    | 4,000     | 2,922.00  | 11,688,000    |                              |
| 6535 | アイモバイル                | 6,300     | 1,450.00  | 9,135,000     |                              |
| 6538 | キャリアインデックス            | 7,300     | 674.00    | 4,920,200     |                              |
| 6539 | MS-Japan              | 7,200     | 1,090.00  | 7,848,000     | 貸付有価証券<br>400株（400株）         |
| 6540 | 船場                    | 3,500     | 886.00    | 3,101,000     |                              |
| 6541 | グレイステクノロジー            | 9,000     | 4,920.00  | 44,280,000    | 貸付有価証券<br>2,500株（600株）       |
| 6544 | ジャパンエレベーターサービスホールディング | 51,300    | 2,361.00  | 121,119,300   | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）     |
| 6546 | フルテック                 | 2,500     | 1,471.00  | 3,677,500     |                              |
| 6547 | グリーンズ                 | 6,700     | 589.00    | 3,946,300     |                              |
| 6551 | ツナググループ・ホールディングス      | 3,100     | 309.00    | 957,900       | 貸付有価証券<br>500株               |
| 6552 | GameWith              | 5,300     | 669.00    | 3,545,700     |                              |
| 6553 | ソウルダウト                | 4,200     | 1,610.00  | 6,762,000     |                              |
| 6555 | MS&Consulting         | 2,800     | 600.00    | 1,680,000     |                              |
| 6556 | ウェルビー                 | 4,900     | 1,531.00  | 7,501,900     |                              |
| 6560 | エル・ティー・エス             | 1,300     | 3,620.00  | 4,706,000     |                              |
| 6564 | ミダック                  | 3,900     | 4,670.00  | 18,213,000    |                              |
| 6569 | 日総工産                  | 13,900    | 841.00    | 11,689,900    |                              |
| 6571 | キュービーネットホールディングス      | 8,100     | 1,606.00  | 13,008,600    |                              |
| 6572 | RPAホールディングス           | 20,400    | 623.00    | 12,709,200    |                              |

|      |                    |        |          |             |                          |
|------|--------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| 7030 | スプリックス             | 5,100  | 954.00   | 4,865,400   |                          |
| 7033 | マネジメントソリューションズ     | 8,700  | 1,912.00 | 16,634,400  |                          |
| 7034 | プロレド・パートナーズ        | 2,400  | 3,125.00 | 7,500,000   |                          |
| 7035 | and factory        | 1,700  | 729.00   | 1,239,300   |                          |
| 7037 | テノ・ホールディングス        | 1,400  | 1,138.00 | 1,593,200   |                          |
| 7038 | フロンティア・マネジメント      | 3,000  | 1,852.00 | 5,556,000   |                          |
| 7044 | ピアラ                | 900    | 1,680.00 | 1,512,000   |                          |
| 7059 | コプロ・ホールディングス       | 900    | 2,974.00 | 2,676,600   |                          |
| 7060 | ギークス               | 2,300  | 1,676.00 | 3,854,800   |                          |
| 7085 | カーブスホールディングス       | 48,900 | 1,037.00 | 50,709,300  | 貸付有価証券<br>5,100株（5,100株） |
| 7088 | フォーラムエンジニアリング      | 9,300  | 1,101.00 | 10,239,300  | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| 7354 | ダイレクトマーケティングミックス   | 7,000  | 3,615.00 | 25,305,000  |                          |
| 7358 | ポピンズホールディングス       | 3,500  | 4,045.00 | 14,157,500  |                          |
| 8769 | アドバンテッジリスクマネジメント   | 9,000  | 726.00   | 6,534,000   |                          |
| 8876 | リログループ             | 97,400 | 2,316.00 | 225,578,400 |                          |
| 8920 | 東祥                 | 11,100 | 1,841.00 | 20,435,100  |                          |
| 9603 | エイチ・アイ・エス          | 25,900 | 2,123.00 | 54,985,700  | 貸付有価証券<br>7,000株（7,000株） |
| 9612 | ラックランド             | 5,100  | 2,474.00 | 12,617,400  | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 9616 | 共立メンテナンス           | 29,500 | 3,620.00 | 106,790,000 |                          |
| 9619 | イチネンホールディングス       | 18,500 | 1,416.00 | 26,196,000  |                          |
| 9621 | 建設技術研究所            | 11,500 | 2,584.00 | 29,716,000  |                          |
| 9622 | スペース               | 11,600 | 967.00   | 11,217,200  |                          |
| 9624 | 長大                 | 7,100  | 1,771.00 | 12,574,100  |                          |
| 9628 | 燦ホールディングス          | 7,700  | 1,110.00 | 8,547,000   |                          |
| 9632 | スバル興業              | 1,100  | 8,070.00 | 8,877,000   |                          |
| 9633 | 東京テアトル             | 7,000  | 1,316.00 | 9,212,000   |                          |
| 9644 | タナベ経営              | 3,400  | 1,475.00 | 5,015,000   |                          |
| 9663 | ナガワ                | 5,700  | 9,130.00 | 52,041,000  | 貸付有価証券<br>1,700株（400株）   |
| 9672 | 東京都競馬              | 11,700 | 5,600.00 | 65,520,000  |                          |
| 9675 | 常磐興産               | 7,100  | 1,502.00 | 10,664,200  |                          |
| 9678 | カナモト               | 31,400 | 2,831.00 | 88,893,400  |                          |
| 9699 | 西尾レントオール           | 16,400 | 2,946.00 | 48,314,400  |                          |
| 9704 | アゴーラ・ホスピタリティー・グループ | 97,900 | 26.00    | 2,545,400   | 貸付有価証券<br>8,600株（8,600株） |
| 9715 | トランス・コスモス          | 17,000 | 3,060.00 | 52,020,000  |                          |
| 9716 | 乃村工芸社              | 76,400 | 939.00   | 71,739,600  | 貸付有価証券<br>3,600株（3,600株） |
| 9722 | 藤田観光               | 7,100  | 1,902.00 | 13,504,200  | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株） |
| 9726 | KNT－CTホールディングス     | 9,500  | 1,028.00 | 9,766,000   | 貸付有価証券<br>5,400株（2,800株） |

|      |              |             |          |                 |                          |
|------|--------------|-------------|----------|-----------------|--------------------------|
| 9728 | 日本管財         | 19,100      | 2,274.00 | 43,433,400      |                          |
| 9729 | トーカイ         | 17,200      | 2,484.00 | 42,724,800      |                          |
| 9731 | 白洋舎          | 2,000       | 2,379.00 | 4,758,000       |                          |
| 9735 | セコム          | 175,700     | 9,249.00 | 1,625,049,300   |                          |
| 9740 | セントラル警備保障    | 8,600       | 3,405.00 | 29,283,000      | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 9743 | 丹青社          | 33,700      | 916.00   | 30,869,200      |                          |
| 9744 | メイテック        | 21,800      | 6,200.00 | 135,160,000     | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株） |
| 9755 | 応用地質         | 20,800      | 1,311.00 | 27,268,800      |                          |
| 9757 | 船井総研ホールディングス | 36,500      | 2,175.00 | 79,387,500      | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| 9760 | 進学会ホールディングス  | 7,000       | 469.00   | 3,283,000       | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| 9765 | オオバ          | 12,500      | 818.00   | 10,225,000      | 貸付有価証券<br>3,300株         |
| 9768 | いであ          | 4,300       | 1,827.00 | 7,856,100       | 貸付有価証券<br>800株           |
| 9769 | 学究社          | 5,200       | 1,384.00 | 7,196,800       |                          |
| 9783 | ベネッセホールディングス | 65,300      | 2,394.00 | 156,328,200     |                          |
| 9787 | イオンディライト     | 22,000      | 3,380.00 | 74,360,000      |                          |
| 9788 | ナック          | 8,400       | 1,011.00 | 8,492,400       |                          |
| 9793 | ダイセキ         | 29,900      | 3,680.00 | 110,032,000     | 貸付有価証券<br>2,200株（2,200株） |
| 9795 | ステップ         | 6,500       | 1,588.00 | 10,322,000      |                          |
| 合 計  |              | 196,035,400 |          | 500,358,470,370 |                          |

(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 3年 3月25日現在]

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| <b>資産の部</b>     |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 23,052,792,996  |
| コール・ローン         | 4,819,692,506   |
| 株式              | 837,953,318,557 |
| 投資証券            | 18,542,582,665  |
| 派生商品評価勘定        | 15,646,389      |
| 未収入金            | 41,210,214      |
| 未収配当金           | 1,067,528,548   |
| 差入委託証拠金         | 7,586,733,939   |
| 流動資産合計          | 893,079,505,814 |
| 資産合計            |                 |
| 893,079,505,814 |                 |
| <b>負債の部</b>     |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 500,336,695     |
| 未払解約金           | 4,303,146,829   |
| 未払利息            | 835             |
| 流動負債合計          | 4,803,484,359   |
| 負債合計            |                 |
| 4,803,484,359   |                 |
| <b>純資産の部</b>    |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 239,184,802,487 |
| 剰余金             |                 |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 649,091,218,968 |
| 元本等合計           | 888,276,021,455 |
| 純資産合計           |                 |
| 888,276,021,455 |                 |
| 負債純資産合計         |                 |
| 893,079,505,814 |                 |

## 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。<br>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。<br>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。<br>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<br>「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 3年 3月25日現在] |
| 1. 期首 | 令和 2年 3月26日     |

|                                  | [令和 3年 3月25日現在]  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首元本額                            | 159,489,237,165円 |
| 期中追加設定元本額                        | 174,110,978,567円 |
| 期中一部解約元本額                        | 94,415,413,245円  |
| 元本の内訳※                           |                  |
| MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信         | 3,292,176,487円   |
| MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信        | 1,067,644,467円   |
| ファンド・マネジャー（海外株式）                 | 22,714,791円      |
| eMAXIS 先進国株式インデックス               | 13,643,255,166円  |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）              | 1,165,006,900円   |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                | 247,493,150円     |
| コアバランス                           | 192,352円         |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金） | 55,071,260円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金） | 88,297,052円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金） | 66,013,420円      |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス          | 47,718,847,204円  |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）                | 1,237,145,316円   |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）         | 2,807,313,357円   |
| つみたて先進国株式                        | 7,678,333,672円   |
| つみたて8資産均等バランス                    | 1,310,980,484円   |
| つみたて4資産均等バランス                    | 372,615,870円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s            | 1,307,497円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s            | 1,436,371円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s            | 1,936,345円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金） | 44,089,401円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金） | 38,165,380円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金） | 22,136,029円      |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）          | 11,215,260,915円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）        | 290,111,554円     |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）     | 27,638,379,834円  |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金） | 29,108,859円      |
| 先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）           | 21,530,447,225円  |
| つみたて全世界株式                        | 10,981,512円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金） | 1,337,431円       |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド           | 19,760,116,285円  |
| eMAXIS 全世界株式インデックス               | 2,744,976,274円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）        | 1,232,246,249円   |

|                                            | [令和 3年 3月25日現在] |
|--------------------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）                  | 2,443,469,900円  |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）                 | 591,060,363円    |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）             | 589,669,002円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）                  | 429,124,623円    |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）                        | 229,587,336円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）                  | 61,489,159円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）                  | 72,880,616円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）                 | 280,061,674円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                    | 208,454,439円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）                   | 433,361,702円    |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）              | 20,853,515円     |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）              | 6,812,151,438円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）            | 100,617,003円    |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）            | 1,223,953,335円  |
| MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）             | 23,401,144,231円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）            | 793,175円        |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）              | 1,014,282,448円  |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）            | 7,725,347,593円  |
| アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）             | 16,422,211円     |
| アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）            | 93,245,628円     |
| MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）    | 2,611,893,443円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）   | 1,004,907,066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）      | 497,470,275円    |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                 | 52,477,852円     |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）          | 2,205,780,158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）    | 104,540,645円    |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）           | 2,112,473,713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）        | 343,308,770円    |
| MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定） | 9,804,151,970円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）  | 49,495,874円     |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド                       | 1,946,609,140円  |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                 | 1,050,369円      |



|                                           | [令和 3年 3月25日現在]  |
|-------------------------------------------|------------------|
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA              | 4,043,603円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA                | 2,739,116円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA                | 3,958,143円       |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA                    | 38,380,967円      |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）                | 5,953,769円       |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）                | 33,773,727円      |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）                | 7,491,360円       |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）                | 37,404,637円      |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド                  | 5,457,582,463円   |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定型）   | 139,494,810円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（安定成長型） | 546,768,977円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（成長型）   | 565,883,742円     |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド<br>（積極型）   | 524,060,398円     |
| 合計                                        | 239,184,802,487円 |
| 2. 受益権の総数                                 | 239,184,802,487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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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 | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [令和 3年 3月25日現在]    |  |
|------|--------------------|--|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |  |
| 株式   | 154,960,405,110    |  |
| 投資証券 | 2,097,745,197      |  |
| 合計   | 157,058,150,307    |  |

（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 3年 3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<br>買建 | 32,236,768,365 | —     | 31,751,499,851 | △485,268,514 |
| 合計   |                | 32,236,768,365 | —     | 31,751,499,851 | △485,268,514 |

（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 3年 3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<br>買建 |             |       |             |         |
|           | アメリカドル       | 433,379,083 | —     | 433,955,820 | 576,737 |
|           | カナダドル        | 15,882,824  | —     | 15,930,720  | 47,896  |
|           | オーストラリアドル    | 18,604,890  | —     | 18,605,250  | 360     |
|           | イギリスポンド      | 26,266,204  | —     | 26,234,560  | △31,644 |
|           | スイスフラン       | 14,883,161  | —     | 14,894,080  | 10,919  |
|           | ユーロ          | 112,594,810 | —     | 112,568,750 | △26,060 |
| 合計        |              | 621,610,972 | —     | 622,189,180 | 578,208 |

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

|              |                 |
|--------------|-----------------|
|              | [令和 3年 3月25日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 3.7138円         |
| (1万口当たり純資産額) | (37,138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         | 110,239 | 22.07  | 2,432,974.73  |    |
|        | CABOT OIL & GAS CORP    | 68,398  | 18.23  | 1,246,895.54  |    |
|        | CHENIERE ENERGY INC     | 36,410  | 71.95  | 2,619,699.50  |    |
|        | CHEVRON CORP            | 309,440 | 104.70 | 32,398,368.00 |    |
|        | CONOCOPHILLIPS          | 216,802 | 53.21  | 11,536,034.42 |    |
|        | DEVON ENERGY CORP       | 99,707  | 22.34  | 2,227,454.38  |    |
|        | EOG RESOURCES INC       | 94,808  | 72.54  | 6,877,372.32  |    |
|        | EXXON MOBIL CORP        | 679,464 | 56.34  | 38,281,001.76 |    |
|        | HALLIBURTON CO          | 139,171 | 21.30  | 2,964,342.30  |    |
|        | HESS CORP               | 43,964  | 69.08  | 3,037,033.12  |    |
|        | KINDER MORGAN INC       | 321,642 | 16.19  | 5,207,383.98  |    |
|        | MARATHON PETROLEUM CORP | 105,787 | 53.17  | 5,624,694.79  |    |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 148,296 | 27.06  | 4,012,889.76  |  |
| ONEOK INC                    | 72,635  | 48.74  | 3,540,229.90  |  |
| PHILLIPS 66                  | 70,336  | 82.03  | 5,769,662.08  |  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 32,509  | 161.30 | 5,243,701.70  |  |
| SCHLUMBERGER LTD             | 222,740 | 27.42  | 6,107,530.80  |  |
| VALERO ENERGY CORP           | 65,330  | 71.78  | 4,689,387.40  |  |
| WILLIAMS COS INC             | 196,822 | 23.49  | 4,623,348.78  |  |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 35,322  | 278.01 | 9,819,869.22  |  |
| ALBEMARLE CORP               | 18,299  | 146.63 | 2,683,182.37  |  |
| AMCOR PLC                    | 257,745 | 11.31  | 2,915,095.95  |  |
| AVERY DENNISON CORP          | 13,070  | 177.10 | 2,314,697.00  |  |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 34,588  | 28.75  | 994,405.00    |  |
| BALL CORP                    | 53,399  | 85.35  | 4,557,604.65  |  |
| CELANESE CORP                | 18,880  | 142.92 | 2,698,329.60  |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 36,156  | 44.75  | 1,617,981.00  |  |
| CORTEVA INC                  | 121,385 | 46.19  | 5,606,773.15  |  |
| CROWN HOLDINGS INC           | 22,427  | 97.03  | 2,176,091.81  |  |
| DOW INC                      | 119,439 | 62.04  | 7,409,995.56  |  |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | 86,632  | 76.68  | 6,642,941.76  |  |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 22,366  | 108.76 | 2,432,526.16  |  |
| ECOLAB INC                   | 41,071  | 208.46 | 8,561,660.66  |  |
| FMC CORP                     | 20,465  | 109.51 | 2,241,122.15  |  |
| FREEPORT-MCMORAN INC         | 233,441 | 31.61  | 7,379,070.01  |  |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 61,143  | 52.20  | 3,191,664.60  |  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 35,923  | 136.43 | 4,900,974.89  |  |
| LINDE PLC                    | 84,643  | 269.77 | 22,834,142.11 |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 43,161  | 102.13 | 4,408,032.93  |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 9,804   | 322.25 | 3,159,339.00  |  |
| MOSAIC CO/THE                | 55,493  | 30.21  | 1,676,443.53  |  |
| NEWMONT CORP                 | 128,067 | 60.37  | 7,731,404.79  |  |
| NUCOR CORP                   | 47,470  | 69.47  | 3,297,740.90  |  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 14,744  | 129.89 | 1,915,098.16  |  |
| PPG INDUSTRIES INC           | 38,324  | 148.16 | 5,678,083.84  |  |
| RPM INTERNATIONAL INC        | 20,577  | 90.28  | 1,857,691.56  |  |
| SEALED AIR CORP              | 24,383  | 45.22  | 1,102,599.26  |  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 13,100  | 724.15 | 9,486,365.00  |  |
| STEEL DYNAMICS INC           | 32,423  | 46.07  | 1,493,727.61  |  |
| VULCAN MATERIALS CO          | 21,530  | 160.55 | 3,456,641.50  |  |
| WESTROCK CO                  | 40,906  | 49.42  | 2,021,574.52  |  |
| 3M CO                        | 92,991  | 190.69 | 17,732,453.79 |  |
| ALLEGION PLC                 | 14,695  | 121.65 | 1,787,646.75  |  |
| AMETEK INC                   | 37,486  | 122.81 | 4,603,655.66  |  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| BOEING CO/THE                | 86,432    | 239.24 | 20,677,991.68 |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 134,429   | 40.14  | 5,395,980.06  |
| CATERPILLAR INC              | 87,429    | 221.23 | 19,341,917.67 |
| CUMMINS INC                  | 23,846    | 257.70 | 6,145,114.20  |
| DEERE & CO                   | 48,064    | 360.91 | 17,346,778.24 |
| DOVER CORP                   | 23,479    | 135.67 | 3,185,395.93  |
| EATON CORP PLC               | 64,068    | 134.45 | 8,613,942.60  |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 95,671    | 88.06  | 8,424,788.26  |
| FASTENAL CO                  | 92,289    | 48.23  | 4,451,098.47  |
| FORTIVE CORP                 | 47,962    | 69.26  | 3,321,848.12  |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 21,507    | 88.37  | 1,900,573.59  |
| GENERAC HOLDINGS INC         | 10,200    | 296.88 | 3,028,176.00  |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 39,287    | 176.42 | 6,931,012.54  |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 1,411,987 | 12.50  | 17,649,837.50 |
| HEICO CORP                   | 7,231     | 122.75 | 887,605.25    |
| HEICO CORP-CLASS A           | 11,631    | 114.00 | 1,325,934.00  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 112,988   | 212.22 | 23,978,313.36 |
| HOWMET AEROSPACE INC         | 62,452    | 30.35  | 1,895,418.20  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 6,440     | 194.12 | 1,250,132.80  |
| IDEX CORP                    | 11,987    | 201.34 | 2,413,462.58  |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 51,306    | 220.36 | 11,305,790.16 |
| INGERSOLL-RAND INC           | 56,322    | 48.34  | 2,722,605.48  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 34,500    | 66.71  | 2,301,495.00  |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 36,300    | 33.84  | 1,228,392.00  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 116,625   | 58.59  | 6,833,058.75  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 33,787    | 195.96 | 6,620,900.52  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 5,609     | 306.30 | 1,718,036.70  |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 40,601    | 356.12 | 14,458,828.12 |
| MASCO CORP                   | 42,725    | 57.30  | 2,448,142.50  |
| NORDSON CORP                 | 8,714     | 199.71 | 1,740,272.94  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 25,432    | 316.03 | 8,037,274.96  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 66,316    | 67.17  | 4,454,445.72  |
| OWENS CORNING                | 17,756    | 86.45  | 1,535,006.20  |
| PACCAR INC                   | 56,074    | 90.69  | 5,085,351.06  |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 20,829    | 308.33 | 6,422,205.57  |
| PENTAIR PLC                  | 26,974    | 59.86  | 1,614,663.64  |
| PLUG POWER INC               | 75,243    | 33.20  | 2,498,067.60  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP   | 244,128   | 75.55  | 18,443,870.40 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 18,951    | 263.19 | 4,987,713.69  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 16,874    | 406.28 | 6,855,568.72  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 25,838    | 58.04  | 1,499,637.52  |
| SMITH (A.O.) CORP            | 22,709    | 65.26  | 1,481,989.34  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| SNAP-ON INC                  | 8,484   | 215.49 | 1,828,217.16  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 26,128  | 194.38 | 5,078,760.64  |
| SUNRUN INC                   | 18,430  | 55.25  | 1,018,257.50  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC    | 5,996   | 388.10 | 2,327,047.60  |
| TEXTRON INC                  | 36,240  | 52.57  | 1,905,136.80  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 38,827  | 161.21 | 6,259,300.67  |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 8,426   | 592.82 | 4,995,101.32  |
| UNITED RENTALS INC           | 11,865  | 305.41 | 3,623,689.65  |
| WABTEC CORP                  | 29,134  | 76.04  | 2,215,349.36  |
| WW GRAINGER INC              | 7,442   | 395.39 | 2,942,492.38  |
| XYLEM INC                    | 29,609  | 101.11 | 2,993,765.99  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 21,669  | 79.73  | 1,727,669.37  |
| CINTAS CORP                  | 14,386  | 335.95 | 4,832,976.70  |
| COPART INC                   | 34,211  | 105.90 | 3,622,944.90  |
| COSTAR GROUP INC             | 6,365   | 804.23 | 5,118,923.95  |
| EQUIFAX INC                  | 19,181  | 174.41 | 3,345,358.21  |
| IHS MARKIT LTD               | 61,082  | 96.19  | 5,875,477.58  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 21,153  | 123.30 | 2,608,164.90  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 21,839  | 94.88  | 2,072,084.32  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 35,547  | 98.22  | 3,491,426.34  |
| ROBERT HALF INTL INC         | 17,817  | 73.69  | 1,312,934.73  |
| ROLLINS INC                  | 36,239  | 33.81  | 1,225,240.59  |
| TRANSUNION                   | 31,124  | 88.35  | 2,749,805.40  |
| VERISK ANALYTICS INC         | 25,211  | 176.93 | 4,460,582.23  |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 41,683  | 105.75 | 4,407,977.25  |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 67,600  | 124.82 | 8,437,832.00  |
| AMERCO                       | 1,455   | 587.73 | 855,147.15    |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 21,778  | 95.07  | 2,070,434.46  |
| CSX CORP                     | 122,262 | 94.17  | 11,513,412.54 |
| DELTA AIR LINES INC          | 25,351  | 45.61  | 1,156,259.11  |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 28,054  | 102.23 | 2,867,960.42  |
| FEDEX CORP                   | 40,430  | 268.29 | 10,846,964.70 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 13,265  | 159.53 | 2,116,165.45  |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 15,296  | 254.11 | 3,886,866.56  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 21,711  | 44.66  | 969,613.26    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 40,814  | 264.31 | 10,787,548.34 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 14,824  | 234.11 | 3,470,446.64  |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 23,466  | 57.70  | 1,353,988.20  |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 157,053 | 52.57  | 8,256,276.21  |
| UNION PACIFIC CORP           | 108,631 | 212.90 | 23,127,539.90 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 115,102 | 159.91 | 18,405,960.82 |
| XPO LOGISTICS INC            | 14,476  | 116.50 | 1,686,454.00  |

|                              |         |          |                |
|------------------------------|---------|----------|----------------|
| APTIV PLC                    | 43,409  | 139.85   | 6,070,748.65   |
| AUTOLIV INC                  | 12,960  | 88.32    | 1,144,627.20   |
| BORGWARNER INC               | 39,617  | 43.50    | 1,723,339.50   |
| FORD MOTOR CO                | 626,079 | 12.14    | 7,600,599.06   |
| GENERAL MOTORS CO            | 208,688 | 55.81    | 11,646,877.28  |
| LEAR CORP                    | 9,633   | 170.84   | 1,645,701.72   |
| TESLA INC                    | 122,036 | 630.27   | 76,915,629.72  |
| DR HORTON INC                | 56,574  | 83.56    | 4,727,323.44   |
| GARMIN LTD                   | 23,599  | 126.78   | 2,991,881.22   |
| HASBRO INC                   | 20,443  | 95.63    | 1,954,964.09   |
| LENNAR CORP-A                | 45,228  | 94.65    | 4,280,830.20   |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 19,904  | 307.31   | 6,116,698.24   |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 9,336   | 185.40   | 1,730,894.40   |
| NEWELL BRANDS INC            | 65,665  | 24.91    | 1,635,715.15   |
| NIKE INC -CL B               | 201,922 | 133.16   | 26,887,933.52  |
| NVR INC                      | 559     | 4,539.65 | 2,537,664.35   |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A    | 39,034  | 101.79   | 3,973,270.86   |
| PULTEGROUP INC               | 41,552  | 48.21    | 2,003,221.92   |
| VF CORP                      | 54,318  | 76.66    | 4,164,017.88   |
| WHIRLPOOL CORP               | 9,906   | 211.06   | 2,090,760.36   |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 8,409   | 178.85   | 1,503,949.65   |
| ARAMARK                      | 34,722  | 38.07    | 1,321,866.54   |
| CARNIVAL CORP                | 125,312 | 24.85    | 3,114,003.20   |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 4,296   | 1,422.96 | 6,113,036.16   |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 20,791  | 133.93   | 2,784,538.63   |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 6,195   | 366.22   | 2,268,732.90   |
| DRAFTKINGS INC - CL A        | 27,687  | 66.63    | 1,844,784.81   |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 44,097  | 118.50   | 5,225,494.50   |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 56,001  | 59.16    | 3,313,019.16   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 43,828  | 143.28   | 6,279,675.84   |
| MCDONALD'S CORP              | 119,941 | 224.05   | 26,872,781.05  |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 33,367  | 20.16    | 672,678.72     |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 75,301  | 36.90    | 2,778,606.90   |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 36,868  | 81.58    | 3,007,691.44   |
| STARBUCKS CORP               | 188,872 | 104.97   | 19,825,893.84  |
| VAIL RESORTS INC             | 6,397   | 278.35   | 1,780,604.95   |
| WYNN RESORTS LTD             | 16,566  | 125.18   | 2,073,731.88   |
| YUM! BRANDS INC              | 49,196  | 107.08   | 5,267,907.68   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 124,935 | 90.51    | 11,307,866.85  |
| ALPHABET INC-CL A            | 64,591  | 2,032.53 | 131,283,145.23 |
| ALPHABET INC-CL C            | 31,650  | 2,045.06 | 64,726,149.00  |
| ALTICE USA INC- A            | 34,920  | 34.01    | 1,187,629.20   |



|                               |         |          |                |
|-------------------------------|---------|----------|----------------|
| CABLE ONE INC                 | 778     | 1,765.20 | 1,373,325.60   |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 22,512  | 651.56   | 14,667,918.72  |
| COMCAST CORP-CLASS A          | 734,608 | 55.92    | 41,079,279.36  |
| DISCOVERY INC - A             | 25,556  | 61.94    | 1,582,938.64   |
| DISCOVERY INC-C               | 49,619  | 54.54    | 2,706,220.26   |
| DISH NETWORK CORP-A           | 40,567  | 35.52    | 1,440,939.84   |
| ELECTRONIC ARTS INC           | 46,489  | 129.80   | 6,034,272.20   |
| FACEBOOK INC-CLASS A          | 386,861 | 282.14   | 109,148,962.54 |
| FOX CORP - CLASS A            | 53,639  | 40.12    | 2,151,996.68   |
| FOX CORP - CLASS B            | 27,366  | 37.95    | 1,038,539.70   |
| IAC/INTERACTIVECORP           | 12,953  | 223.46   | 2,894,477.38   |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC  | 64,665  | 27.83    | 1,799,626.95   |
| LIBERTY BROADBAND-A           | 4,561   | 151.64   | 691,630.04     |
| LIBERTY BROADBAND-C           | 25,036  | 156.84   | 3,926,646.24   |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A  | 14,828  | 44.32    | 657,176.96     |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C  | 26,504  | 44.18    | 1,170,946.72   |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C  | 33,820  | 43.27    | 1,463,391.40   |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN  | 27,011  | 81.55    | 2,202,747.05   |
| MATCH GROUP INC               | 40,785  | 139.80   | 5,701,743.00   |
| NETFLIX INC                   | 71,097  | 520.81   | 37,028,028.57  |
| NEWS CORP - CLASS A           | 61,728  | 25.45    | 1,570,977.60   |
| OMNICOM GROUP                 | 34,620  | 74.89    | 2,592,691.80   |
| PINTEREST INC- CLASS A        | 82,136  | 69.60    | 5,716,665.60   |
| ROKU INC                      | 17,525  | 318.45   | 5,580,836.25   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC        | 173,853 | 6.11     | 1,062,241.83   |
| SNAP INC - A                  | 148,959 | 50.51    | 7,523,919.09   |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 18,195  | 170.26   | 3,097,880.70   |
| TWITTER INC                   | 128,363 | 62.06    | 7,966,207.78   |
| VIACOMCBS INC - CLASS B       | 91,600  | 70.10    | 6,421,160.00   |
| WALT DISNEY CO/THE            | 291,345 | 184.72   | 53,817,248.40  |
| ZILLOW GROUP INC - A          | 9,806   | 133.22   | 1,306,355.32   |
| ZILLOW GROUP INC - C          | 24,175  | 127.36   | 3,078,928.00   |
| ADVANCE AUTO PARTS INC        | 10,935  | 181.73   | 1,987,217.55   |
| AMAZON.COM INC                | 68,641  | 3,087.07 | 211,899,571.87 |
| AUTOZONE INC                  | 3,698   | 1,353.49 | 5,005,206.02   |
| BEST BUY CO INC               | 38,022  | 114.32   | 4,346,675.04   |
| BOOKING HOLDINGS INC          | 6,616   | 2,202.73 | 14,573,261.68  |
| BURLINGTON STORES INC         | 10,866  | 288.80   | 3,138,100.80   |
| CARMAX INC                    | 26,602  | 128.35   | 3,414,366.70   |
| CARVANA CO                    | 10,298  | 252.85   | 2,603,849.30   |
| CHEWY INC - CLASS A           | 12,701  | 79.00    | 1,003,379.00   |
| DOLLAR GENERAL CORP           | 39,933  | 197.08   | 7,869,995.64   |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| DOLLAR TREE INC              | 38,381  | 110.50   | 4,241,100.50  |
| EBAY INC                     | 109,812 | 57.64    | 6,329,563.68  |
| ETSY INC                     | 20,278  | 199.18   | 4,038,972.04  |
| EXPEDIA GROUP INC            | 21,993  | 166.14   | 3,653,917.02  |
| GENUINE PARTS CO             | 23,129  | 114.81   | 2,655,440.49  |
| HOME DEPOT INC               | 173,285 | 292.75   | 50,729,183.75 |
| LKQ CORP                     | 46,064  | 41.03    | 1,890,005.92  |
| LOWE'S COS INC               | 117,922 | 180.68   | 21,306,146.96 |
| MERCADOLIBRE INC             | 7,247   | 1,387.85 | 10,057,748.95 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 11,671  | 488.86   | 5,705,485.06  |
| POOL CORP                    | 6,593   | 340.10   | 2,242,279.30  |
| ROSS STORES INC              | 57,339  | 115.48   | 6,621,507.72  |
| TARGET CORP                  | 80,950  | 188.28   | 15,241,266.00 |
| TJX COMPANIES INC            | 192,024 | 64.33    | 12,352,903.92 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 18,892  | 169.06   | 3,193,881.52  |
| ULTA BEAUTY INC              | 8,401   | 301.00   | 2,528,701.00  |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 11,124  | 326.68   | 3,633,988.32  |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 71,135  | 338.04   | 24,046,475.40 |
| KROGER CO                    | 122,515 | 35.71    | 4,375,010.65  |
| SYSCO CORP                   | 78,270  | 77.65    | 6,077,665.50  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 119,158 | 51.78    | 6,170,001.24  |
| WALMART INC                  | 228,064 | 133.11   | 30,357,599.04 |
| ALTRIA GROUP INC             | 300,740 | 49.51    | 14,889,637.40 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 90,557  | 55.92    | 5,063,947.44  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 50,169  | 69.07    | 3,465,172.83  |
| BUNGE LTD                    | 21,655  | 75.53    | 1,635,602.15  |
| CAMPBELL SOUP CO             | 30,056  | 48.77    | 1,465,831.12  |
| COCA-COLA CO/THE             | 656,953 | 51.52    | 33,846,218.56 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 32,884  | 50.89    | 1,673,466.76  |
| CONAGRA BRANDS INC           | 76,259  | 36.90    | 2,813,957.10  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 27,058  | 229.68   | 6,214,681.44  |
| GENERAL MILLS INC            | 98,722  | 58.62    | 5,787,083.64  |
| HERSHEY CO/THE               | 23,433  | 157.26   | 3,685,073.58  |
| HORMEL FOODS CORP            | 47,218  | 48.06    | 2,269,297.08  |
| JM SMUCKER CO/THE            | 18,418  | 123.14   | 2,267,992.52  |
| KELLOGG CO                   | 40,183  | 61.51    | 2,471,656.33  |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 90,574  | 34.36    | 3,112,575.51  |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 109,902 | 38.23    | 4,201,553.46  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 23,281  | 77.99    | 1,815,685.19  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 39,099  | 87.53    | 3,422,335.47  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 32,241  | 48.36    | 1,559,174.76  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 231,095 | 58.06    | 13,417,375.70 |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 63,849  | 88.72  | 5,664,683.28  |
| PEPSICO INC                  | 222,627 | 138.81 | 30,902,853.87 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 251,016 | 88.55  | 22,227,466.80 |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 47,899  | 73.57  | 3,523,929.43  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 39,351  | 84.57  | 3,327,914.07  |
| CLOROX COMPANY               | 20,390  | 189.22 | 3,858,195.80  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 130,246 | 77.77  | 10,129,231.42 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 36,507  | 284.98 | 10,403,764.86 |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 54,797  | 135.68 | 7,434,856.96  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 398,495 | 132.56 | 52,824,497.20 |
| ABBOTT LABORATORIES          | 285,253 | 118.02 | 33,665,559.06 |
| ABIOMED INC                  | 7,450   | 294.21 | 2,191,864.50  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 12,025  | 506.17 | 6,086,694.25  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 24,077  | 115.37 | 2,777,763.49  |
| ANTHEM INC                   | 40,266  | 360.87 | 14,530,791.42 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 81,539  | 82.08  | 6,692,721.12  |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 46,967  | 241.77 | 11,355,211.59 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 228,616 | 37.58  | 8,591,389.28  |
| CARDINAL HEALTH INC          | 45,885  | 59.11  | 2,712,262.35  |
| CENTENE CORP                 | 94,336  | 64.94  | 6,126,179.84  |
| CERNER CORP                  | 49,800  | 71.83  | 3,577,134.00  |
| CIGNA CORP                   | 58,015  | 240.54 | 13,954,928.10 |
| COOPER COS INC/THE           | 8,639   | 380.31 | 3,285,498.09  |
| CVS HEALTH CORP              | 211,595 | 73.21  | 15,490,869.95 |
| DANAHER CORP                 | 102,914 | 219.47 | 22,586,535.58 |
| DAVITA INC                   | 12,840  | 109.03 | 1,399,945.20  |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 34,327  | 60.35  | 2,071,634.45  |
| DEXCOM INC                   | 15,462  | 355.73 | 5,500,297.26  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 99,436  | 80.21  | 7,975,761.56  |
| HCA HEALTHCARE INC           | 43,490  | 184.59 | 8,027,819.10  |
| HENRY SCHEIN INC             | 22,951  | 65.66  | 1,506,962.66  |
| HOLOGIC INC                  | 42,191  | 71.98  | 3,036,908.18  |
| HUMANA INC                   | 21,232  | 414.66 | 8,804,061.12  |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 13,637  | 472.97 | 6,449,891.89  |
| INSULET CORP                 | 10,329  | 263.63 | 2,723,034.27  |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 18,920  | 711.07 | 13,453,444.40 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 15,770  | 250.42 | 3,949,123.40  |
| MASIMO CORP                  | 8,570   | 225.62 | 1,933,563.40  |
| MCKESSON CORP                | 25,642  | 187.80 | 4,815,567.60  |
| MEDTRONIC PLC                | 216,573 | 115.96 | 25,113,805.08 |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 9,216   | 235.10 | 2,166,681.60  |
| NOVOCURE LTD                 | 14,253  | 128.88 | 1,836,926.64  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 21,176  | 126.89   | 2,687,022.64  |
| RESMED INC                   | 22,908  | 192.18   | 4,402,459.44  |
| STERIS PLC                   | 13,856  | 187.75   | 2,601,464.00  |
| STRYKER CORP                 | 54,709  | 233.81   | 12,791,511.29 |
| TELADOC HEALTH INC           | 18,661  | 181.99   | 3,396,115.39  |
| TELEFLEX INC                 | 7,489   | 403.66   | 3,023,009.74  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 152,792 | 370.60   | 56,624,715.20 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 12,462  | 133.48   | 1,663,427.76  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 14,260  | 176.44   | 2,516,034.40  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 21,760  | 254.39   | 5,535,526.40  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 11,745  | 278.08   | 3,266,049.60  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 33,568  | 157.45   | 5,285,281.60  |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A     | 10,731  | 169.05   | 1,814,075.55  |
| ABBVIE INC                   | 284,206 | 103.06   | 29,290,270.36 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 49,761  | 120.84   | 6,013,119.24  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 35,512  | 151.54   | 5,381,488.48  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 19,138  | 134.63   | 2,576,548.94  |
| AMGEN INC                    | 93,848  | 245.47   | 23,036,868.56 |
| AVANTOR INC                  | 86,599  | 27.98    | 2,423,040.02  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 3,710   | 559.38   | 2,075,299.80  |
| BIOGEN INC                   | 24,712  | 265.69   | 6,565,731.28  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 28,856  | 74.73    | 2,156,408.88  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 363,555 | 62.30    | 22,649,476.50 |
| CATALENT INC                 | 26,518  | 102.98   | 2,730,823.64  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 66,902  | 28.29    | 1,892,657.58  |
| ELI LILLY & CO               | 138,558 | 180.17   | 24,963,994.86 |
| EXACT SCIENCES CORP          | 25,830  | 130.32   | 3,366,165.60  |
| GILEAD SCIENCES INC          | 200,963 | 64.35    | 12,931,969.05 |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 36,017  | 82.12    | 2,957,716.04  |
| ILLUMINA INC                 | 23,365  | 406.80   | 9,504,882.00  |
| INCYTE CORP                  | 30,744  | 78.48    | 2,412,789.12  |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 20,901  | 43.28    | 904,595.28    |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 30,939  | 186.11   | 5,758,057.29  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 9,076   | 163.71   | 1,485,831.96  |
| JOHNSON & JOHNSON            | 423,713 | 161.91   | 68,603,371.83 |
| MERCK & CO. INC.             | 407,144 | 76.24    | 31,040,658.56 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 3,771   | 1,109.88 | 4,185,357.48  |
| MODERNA INC                  | 44,264  | 131.61   | 5,825,585.04  |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 14,302  | 87.57    | 1,252,426.14  |
| PERKINELMER INC              | 17,701  | 125.20   | 2,216,165.20  |
| PFIZER INC                   | 894,551 | 35.61    | 31,854,961.11 |
| PPD INC                      | 21,251  | 36.62    | 778,211.62    |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 16,791    | 460.32 | 7,729,233.12  |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 28,088    | 43.35  | 1,217,614.80  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC     | 11,524    | 74.98  | 864,069.52    |
| SEAGEN INC                   | 20,447    | 140.19 | 2,866,464.93  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 172,225   | 11.26  | 1,939,253.50  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 63,782    | 445.37 | 28,406,589.34 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 41,928    | 211.54 | 8,869,449.12  |
| VIATRIS INC                  | 201,255   | 14.01  | 2,819,582.55  |
| WATERS CORP                  | 9,870     | 269.05 | 2,655,523.50  |
| ZOETIS INC                   | 76,090    | 155.43 | 11,826,668.70 |
| BANK OF AMERICA CORP         | 1,253,091 | 36.90  | 46,239,057.90 |
| CITIGROUP INC                | 335,396   | 70.08  | 23,504,551.68 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 67,968    | 42.24  | 2,870,968.32  |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 112,651   | 36.28  | 4,086,978.28  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 28,006    | 165.47 | 4,634,152.82  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 167,667   | 15.32  | 2,568,658.44  |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 490,598   | 150.62 | 73,893,870.76 |
| KEYCORP                      | 153,752   | 19.26  | 2,961,263.52  |
| M & T BANK CORP              | 21,119    | 147.77 | 3,120,754.63  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 67,784    | 170.25 | 11,540,226.00 |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 151,772   | 19.92  | 3,023,298.24  |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 8,230     | 487.42 | 4,011,466.60  |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 218,118   | 55.82  | 12,175,346.76 |
| US BANCORP                   | 216,804   | 53.47  | 11,592,509.88 |
| WELLS FARGO & CO             | 632,167   | 38.12  | 24,098,206.04 |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 82,636    | 16.55  | 1,367,625.80  |
| ALLY FINANCIAL INC           | 61,669    | 43.47  | 2,680,751.43  |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 110,696   | 138.42 | 15,322,540.32 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 18,986    | 222.47 | 4,223,815.42  |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 232,296   | 8.74   | 2,030,267.04  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 28,586    | 47.67  | 1,362,694.62  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 129,646   | 45.25  | 5,866,481.50  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 220,688   | 249.63 | 55,090,345.44 |
| BLACKROCK INC                | 24,606    | 722.75 | 17,783,986.50 |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE     | 107,903   | 72.15  | 7,785,201.45  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 73,108    | 123.91 | 9,058,812.28  |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 24,405    | 36.76  | 897,127.80    |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 17,518    | 103.06 | 1,805,405.08  |
| CME GROUP INC                | 57,391    | 204.78 | 11,752,528.98 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 48,626    | 92.93  | 4,518,814.18  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 64,715    | 30.73  | 1,988,691.95  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 5,952     | 321.35 | 1,912,675.20  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 46,657  | 28.59    | 1,333,923.63  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 52,678  | 328.65   | 17,312,624.70 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 90,431  | 112.61   | 10,183,434.91 |
| INVESCO LTD                  | 62,240  | 23.25    | 1,447,080.00  |
| KKR & CO INC                 | 84,154  | 47.98    | 4,037,708.92  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 6,187   | 500.93   | 3,099,253.91  |
| MOODY'S CORP                 | 27,153  | 296.25   | 8,044,076.25  |
| MORGAN STANLEY               | 226,463 | 79.33    | 17,965,309.79 |
| MSCI INC                     | 13,184  | 424.03   | 5,590,411.52  |
| NASDAQ INC                   | 17,981  | 147.33   | 2,649,140.73  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 32,272  | 99.35    | 3,206,223.20  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 19,172  | 118.56   | 2,273,032.32  |
| S&P GLOBAL INC               | 38,546  | 351.79   | 13,560,097.34 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 247,010 | 64.12    | 15,838,281.20 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 19,838  | 59.28    | 1,175,996.64  |
| STATE STREET CORP            | 56,992  | 79.86    | 4,551,381.12  |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 85,858  | 39.49    | 3,390,532.42  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 36,665  | 170.31   | 6,244,416.15  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 14,013  | 72.98    | 1,022,668.74  |
| VOYA FINANCIAL INC           | 19,576  | 61.78    | 1,209,405.28  |
| AFLAC INC                    | 107,080 | 49.90    | 5,343,292.00  |
| ALLEGHANY CORP               | 2,345   | 633.96   | 1,486,636.20  |
| ALLSTATE CORP                | 48,850  | 112.85   | 5,512,722.50  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 12,222  | 114.47   | 1,399,052.34  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 139,551 | 44.99    | 6,278,399.49  |
| AON PLC-CLASS A              | 36,007  | 225.21   | 8,109,136.47  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 65,317  | 37.25    | 2,433,058.25  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 31,191  | 124.22   | 3,874,546.02  |
| ASSURANT INC                 | 8,906   | 142.00   | 1,264,652.00  |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 21,360  | 50.19    | 1,072,058.40  |
| BROWN & BROWN INC            | 38,326  | 45.88    | 1,758,396.88  |
| CHUBB LTD                    | 72,246  | 156.62   | 11,315,168.52 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 25,032  | 104.62   | 2,618,847.84  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 4,123   | 226.27   | 932,911.21    |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 6,504   | 242.95   | 1,580,146.80  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL  | 44,319  | 38.84    | 1,721,349.96  |
| GLOBE LIFE INC               | 15,493  | 96.65    | 1,497,398.45  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 58,709  | 67.05    | 3,936,438.45  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 31,540  | 58.51    | 1,845,405.40  |
| LOEWS CORP                   | 40,057  | 50.90    | 2,038,901.30  |
| MARKEL CORP                  | 2,186   | 1,126.62 | 2,462,791.32  |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 81,024  | 118.00   | 9,560,832.00  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| METLIFE INC                  | 123,695 | 58.54  | 7,241,105.30  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 44,604  | 57.95  | 2,584,801.80  |
| PROGRESSIVE CORP             | 93,810  | 92.49  | 8,676,486.90  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 64,127  | 88.80  | 5,694,477.60  |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 10,372  | 123.19 | 1,277,726.68  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD   | 8,293   | 162.98 | 1,351,593.14  |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 40,883  | 149.28 | 6,103,014.24  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 19,963  | 223.74 | 4,466,521.62  |
| WR BERKLEY CORP              | 23,267  | 74.54  | 1,734,322.18  |
| CBRE GROUP INC - A           | 54,253  | 74.16  | 4,023,402.48  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 200,400 | 5.01   | 1,004,004.00  |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 101,755 | 267.55 | 27,224,550.25 |
| ADOBE INC                    | 77,225  | 451.51 | 34,867,859.75 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 26,662  | 98.39  | 2,623,274.18  |
| ANSYS INC                    | 13,915  | 330.37 | 4,597,098.55  |
| AUTODESK INC                 | 35,526  | 263.18 | 9,349,732.68  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 68,724  | 185.27 | 12,732,495.48 |
| AVALARA INC                  | 12,464  | 128.52 | 1,601,873.28  |
| BLACK KNIGHT INC             | 25,802  | 73.50  | 1,896,447.00  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 18,952  | 148.87 | 2,821,384.24  |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | 44,903  | 126.97 | 5,701,333.91  |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | 21,903  | 80.80  | 1,769,762.40  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 18,153  | 114.28 | 2,074,524.84  |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 18,379  | 135.03 | 2,481,716.37  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 31,988  | 67.83  | 2,169,746.04  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 85,113  | 76.94  | 6,548,594.22  |
| COUPA SOFTWARE INC           | 11,072  | 253.00 | 2,801,216.00  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 28,187  | 181.60 | 5,118,759.20  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 6,282   | 134.47 | 844,740.54    |
| DATADOG INC - CLASS A        | 28,453  | 81.26  | 2,312,090.78  |
| DOCUSIGN INC                 | 28,041  | 198.46 | 5,565,016.86  |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 53,333  | 26.54  | 1,415,457.82  |
| DYNATRACE INC                | 28,828  | 48.04  | 1,384,897.12  |
| EPAM SYSTEMS INC             | 8,940   | 368.51 | 3,294,479.40  |
| FAIR ISAAC CORP              | 4,672   | 475.39 | 2,221,022.08  |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 100,266 | 143.40 | 14,378,144.40 |
| FISERV INC                   | 92,286  | 123.25 | 11,374,249.50 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 13,273  | 273.86 | 3,634,943.78  |
| FORTINET INC                 | 22,339  | 171.30 | 3,826,670.70  |
| GARTNER INC                  | 14,465  | 181.10 | 2,619,611.50  |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 47,871  | 201.67 | 9,654,144.57  |
| GODADDY INC - CLASS A        | 26,661  | 74.63  | 1,989,710.43  |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       | 13,245    | 100.97 | 1,337,347.65   |
| HUBSPOT INC                  | 6,948     | 438.04 | 3,043,501.92   |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 143,590   | 130.62 | 18,755,725.80  |
| INTUIT INC                   | 42,296    | 377.29 | 15,957,857.84  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC  | 11,847    | 153.92 | 1,823,490.24   |
| MASTERCARD INC - A           | 143,399   | 359.65 | 51,573,450.35  |
| MICROSOFT CORP               | 1,155,997 | 235.46 | 272,191,053.62 |
| MONGODB INC                  | 8,497     | 283.58 | 2,409,579.26   |
| NORTONLIFELOCK INC           | 86,683    | 21.06  | 1,825,543.98   |
| OKTA INC                     | 19,446    | 218.59 | 4,250,701.14   |
| ORACLE CORP                  | 315,219   | 66.83  | 21,066,085.77  |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 15,195    | 321.00 | 4,877,595.00   |
| PAYCHEX INC                  | 52,067    | 96.96  | 5,048,416.32   |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 8,162     | 364.37 | 2,973,987.94   |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 179,153   | 234.27 | 41,970,173.31  |
| PTC INC                      | 18,174    | 126.84 | 2,305,190.16   |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A      | 12,104    | 308.17 | 3,730,089.68   |
| SALESFORCE.COM INC           | 146,471   | 209.53 | 30,690,068.63  |
| SERVICENOW INC               | 31,396    | 472.32 | 14,828,958.72  |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A | 73,876    | 40.45  | 2,988,284.20   |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 4,064     | 208.60 | 847,750.40     |
| SPLUNK INC                   | 25,859    | 134.94 | 3,489,413.46   |
| SQUARE INC - A               | 61,747    | 213.51 | 13,183,601.97  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 36,257    | 67.30  | 2,440,277.38   |
| SYNOPSYS INC                 | 24,406    | 233.05 | 5,687,818.30   |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 6,771     | 668.06 | 4,523,434.26   |
| TWILIO INC - A               | 22,550    | 326.50 | 7,362,575.00   |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 6,652     | 411.33 | 2,736,167.16   |
| VERISIGN INC                 | 16,557    | 195.03 | 3,229,111.71   |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 272,404   | 208.07 | 56,679,100.28  |
| VMWARE INC-CLASS A           | 13,281    | 144.54 | 1,919,635.74   |
| WESTERN UNION CO             | 67,086    | 24.24  | 1,626,164.64   |
| WIX.COM LTD                  | 8,913     | 277.76 | 2,475,674.88   |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 28,987    | 246.07 | 7,132,831.09   |
| ZENDESK INC                  | 18,809    | 129.01 | 2,426,549.09   |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 31,340    | 314.96 | 9,870,846.40   |
| ZSCALER INC                  | 11,937    | 175.10 | 2,090,168.70   |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 96,106    | 63.65  | 6,117,146.90   |
| APPLE INC                    | 2,736,374 | 120.09 | 328,611,153.66 |
| ARISTA NETWORKS INC          | 9,071     | 284.46 | 2,580,336.66   |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 12,286    | 103.59 | 1,272,706.74   |
| CDW CORP/DE                  | 22,535    | 156.41 | 3,524,699.35   |



|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| CISCO SYSTEMS INC            | 680,092   | 49.65  | 33,766,567.80 |
| COGNEX CORP                  | 28,014    | 77.50  | 2,171,085.00  |
| CORNING INC                  | 124,298   | 40.25  | 5,002,994.50  |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 39,829    | 86.35  | 3,439,234.15  |
| F5 NETWORKS INC              | 9,639     | 197.71 | 1,905,726.69  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 205,429   | 14.76  | 3,032,132.04  |
| HP INC                       | 220,967   | 29.37  | 6,489,800.79  |
| IPG PHOTONICS CORP           | 5,735     | 202.83 | 1,163,230.05  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 55,446    | 24.50  | 1,358,427.00  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN     | 29,279    | 135.26 | 3,960,277.54  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 27,660    | 181.04 | 5,007,566.40  |
| NETAPP INC                   | 36,568    | 68.63  | 2,509,661.84  |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 38,183    | 71.33  | 2,723,593.39  |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 53,055    | 124.89 | 6,626,038.95  |
| TRIMBLE INC                  | 39,379    | 70.93  | 2,793,152.47  |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 48,013    | 63.66  | 3,056,507.58  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 8,454     | 463.81 | 3,921,049.74  |
| AT&T INC                     | 1,146,388 | 29.99  | 34,380,176.12 |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 59,643    | 25.61  | 1,527,457.23  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 23,763    | 25.72  | 611,184.36    |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       | 151,088   | 13.22  | 1,997,383.36  |
| T-MOBILE US INC              | 90,520    | 122.36 | 11,076,027.20 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 666,100   | 57.01  | 37,974,361.00 |
| AES CORP                     | 109,785   | 25.65  | 2,815,985.25  |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 41,577    | 53.32  | 2,216,885.64  |
| AMEREN CORPORATION           | 38,760    | 80.99  | 3,139,172.40  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 79,772    | 84.99  | 6,779,822.28  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 29,255    | 144.91 | 4,239,342.05  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 20,494    | 95.85  | 1,964,349.90  |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 88,495    | 21.75  | 1,924,766.25  |
| CMS ENERGY CORP              | 45,051    | 60.88  | 2,742,704.88  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 54,099    | 73.43  | 3,972,489.57  |
| DOMINION ENERGY INC          | 131,194   | 74.16  | 9,729,347.04  |
| DTE ENERGY COMPANY           | 31,446    | 130.53 | 4,104,646.38  |
| DUKE ENERGY CORP             | 119,286   | 94.39  | 11,259,405.54 |
| EDISON INTERNATIONAL         | 59,619    | 59.93  | 3,572,966.67  |
| ENTERGY CORP                 | 31,653    | 97.43  | 3,083,951.79  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 37,055    | 43.35  | 1,606,334.25  |
| EVERGY INC                   | 35,075    | 59.04  | 2,070,828.00  |
| EVERSOURCE ENERGY            | 55,819    | 85.63  | 4,779,780.97  |
| EXELON CORP                  | 156,614   | 42.93  | 6,723,439.02  |
| FIRSTENERGY CORP             | 89,008    | 34.33  | 3,055,644.64  |

|       |                              |            |        |                                       |  |
|-------|------------------------------|------------|--------|---------------------------------------|--|
|       | NEXTERA ENERGY INC           | 315,341    | 72.83  | 22,966,285.03                         |  |
|       | NISOURCE INC                 | 60,141     | 23.88  | 1,436,167.08                          |  |
|       | NRG ENERGY INC               | 39,560     | 35.93  | 1,421,390.80                          |  |
|       | OGE ENERGY CORP              | 31,768     | 32.02  | 1,017,211.36                          |  |
|       | P G & E CORP                 | 235,607    | 11.31  | 2,664,715.17                          |  |
|       | PINNACLE WEST CAPITAL        | 18,573     | 79.60  | 1,478,410.80                          |  |
|       | PPL CORP                     | 122,000    | 28.42  | 3,467,240.00                          |  |
|       | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 82,541     | 58.71  | 4,845,982.11                          |  |
|       | SEMPRA ENERGY                | 46,832     | 128.97 | 6,039,923.04                          |  |
|       | SOUTHERN CO/THE              | 168,798    | 60.69  | 10,244,350.62                         |  |
|       | UGI CORP                     | 35,036     | 40.70  | 1,425,965.20                          |  |
|       | VISTRA CORP                  | 71,702     | 16.82  | 1,206,027.64                          |  |
|       | WEC ENERGY GROUP INC         | 51,205     | 91.95  | 4,708,299.75                          |  |
|       | XCEL ENERGY INC              | 85,049     | 65.58  | 5,577,513.42                          |  |
|       | ADVANCED MICRO DEVICES       | 193,513    | 76.48  | 14,799,874.24                         |  |
|       | ANALOG DEVICES INC           | 59,017     | 150.44 | 8,878,517.48                          |  |
|       | APPLIED MATERIALS INC        | 147,550    | 121.10 | 17,868,305.00                         |  |
|       | BROADCOM INC                 | 65,098     | 457.27 | 29,767,362.46                         |  |
|       | ENPHASE ENERGY INC           | 19,738     | 147.98 | 2,920,829.24                          |  |
|       | INTEL CORP                   | 659,518    | 62.04  | 40,916,496.72                         |  |
|       | KLA CORP                     | 24,966     | 297.89 | 7,437,121.74                          |  |
|       | LAM RESEARCH CORP            | 23,029     | 552.45 | 12,722,371.05                         |  |
|       | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 108,689    | 45.25  | 4,918,177.25                          |  |
|       | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 43,747     | 89.39  | 3,910,544.33                          |  |
|       | MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 41,890     | 146.76 | 6,147,776.40                          |  |
|       | MICRON TECHNOLOGY INC        | 179,533    | 83.00  | 14,901,239.00                         |  |
|       | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 6,675      | 330.99 | 2,209,358.25                          |  |
|       | NVIDIA CORP                  | 99,614     | 505.72 | 50,376,792.08                         |  |
|       | NXP SEMICONDUCTORS NV        | 44,671     | 187.28 | 8,365,984.88                          |  |
|       | ON SEMICONDUCTOR CORP        | 67,581     | 38.12  | 2,576,187.72                          |  |
|       | QORVO INC                    | 18,645     | 171.79 | 3,203,024.55                          |  |
|       | QUALCOMM INC                 | 182,051    | 127.18 | 23,153,246.18                         |  |
|       | SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 27,027     | 171.19 | 4,626,752.13                          |  |
|       | SOLAREGE TECHNOLOGIES INC    | 8,271      | 267.59 | 2,213,236.89                          |  |
|       | TERADYNE INC                 | 27,018     | 112.00 | 3,026,016.00                          |  |
|       | TEXAS INSTRUMENTS INC        | 147,751    | 178.90 | 26,432,653.90                         |  |
|       | XILINX INC                   | 39,593     | 119.96 | 4,749,576.28                          |  |
|       | アメリカドル 小計                    | 50,732,435 |        | 5,504,087,763.10<br>(599,285,075,646) |  |
| カナダドル | CAMECO CORP                  | 66,500     | 21.12  | 1,404,480.00                          |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 189,900    | 37.84  | 7,185,816.00                          |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC           | 203,900    | 9.65   | 1,967,635.00                          |  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| ENBRIDGE INC                 | 327,700 | 46.30  | 15,172,510.00 |
| IMPERIAL OIL LTD             | 38,000  | 30.21  | 1,147,980.00  |
| INTER PIPELINE LTD           | 72,900  | 17.94  | 1,307,826.00  |
| KEYERA CORP                  | 31,900  | 26.25  | 837,375.00    |
| PARKLAND CORP                | 25,700  | 37.79  | 971,203.00    |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 87,832  | 35.83  | 3,147,020.56  |
| SUNCOR ENERGY INC            | 245,800 | 26.56  | 6,528,448.00  |
| TC ENERGY CORP               | 151,800 | 58.72  | 8,913,696.00  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 39,900  | 73.85  | 2,946,615.00  |
| B2GOLD CORP                  | 168,600 | 5.67   | 955,962.00    |
| BARRICK GOLD CORP            | 285,900 | 25.30  | 7,233,270.00  |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 23,800  | 67.45  | 1,605,310.00  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 95,900  | 23.60  | 2,263,240.00  |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 29,900  | 153.69 | 4,595,331.00  |
| KINROSS GOLD CORP            | 191,900 | 8.33   | 1,598,527.00  |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD       | 43,300  | 41.63  | 1,802,579.00  |
| LUNDIN MINING CORP           | 110,500 | 13.11  | 1,448,655.00  |
| NUTRIEN LTD                  | 92,859  | 68.46  | 6,357,127.14  |
| PAN AMERICAN SILVER CORP     | 35,800  | 38.33  | 1,372,214.00  |
| SSR MINING INC               | 40,200  | 17.85  | 717,570.00    |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 72,500  | 23.26  | 1,686,350.00  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 13,200  | 78.30  | 1,033,560.00  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 72,000  | 47.72  | 3,435,840.00  |
| YAMANA GOLD INC              | 164,600 | 5.62   | 925,052.00    |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC    | 36,200  | 27.87  | 1,008,894.00  |
| CAE INC                      | 42,400  | 34.34  | 1,456,016.00  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD      | 14,300  | 92.50  | 1,322,750.00  |
| WSP GLOBAL INC               | 17,600  | 120.61 | 2,122,736.00  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 29,100  | 41.89  | 1,218,999.00  |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS     | 16,800  | 71.22  | 1,196,496.00  |
| THOMSON REUTERS CORP         | 28,132  | 110.15 | 3,098,739.80  |
| AIR CANADA                   | 22,600  | 26.45  | 597,770.00    |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 113,700 | 146.24 | 16,627,488.00 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 21,800  | 448.75 | 9,782,750.00  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 46,100  | 108.84 | 5,017,524.00  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 33,700  | 37.29  | 1,256,673.00  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 47,810  | 82.39  | 3,939,065.90  |
| QUEBECOR INC -CL B           | 25,900  | 35.26  | 913,234.00    |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 77,500  | 33.56  | 2,600,900.00  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 8,900   | 175.34 | 1,560,526.00  |
| DOLLARAMA INC                | 46,400  | 51.74  | 2,400,736.00  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  | 139,200 | 39.60  | 5,512,320.00  |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 30,200  | 38.62    | 1,166,324.00  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 27,700  | 69.00    | 1,911,300.00  |
| METRO INC/CN                 | 40,100  | 56.87    | 2,280,487.00  |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 12,511  | 107.69   | 1,347,309.59  |
| SAPUTO INC                   | 38,700  | 37.39    | 1,446,993.00  |
| BAUSCH HEALTH COS INC        | 51,300  | 38.71    | 1,985,823.00  |
| CANOPY GROWTH CORP           | 36,500  | 39.32    | 1,435,180.00  |
| BANK OF MONTREAL             | 103,300 | 110.56   | 11,420,848.00 |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 196,300 | 78.15    | 15,340,845.00 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 72,000  | 125.86   | 9,061,920.00  |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 55,100  | 86.86    | 4,785,986.00  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 229,300 | 115.96   | 26,589,628.00 |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 292,000 | 81.57    | 23,818,440.00 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 206,250 | 56.56    | 11,665,500.00 |
| IGM FINANCIAL INC            | 10,800  | 39.10    | 422,280.00    |
| ONEX CORPORATION             | 11,900  | 78.54    | 934,626.00    |
| TMX GROUP LTD                | 9,400   | 129.75   | 1,219,650.00  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 4,100   | 538.03   | 2,205,923.00  |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 44,500  | 33.18    | 1,476,510.00  |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 15,900  | 69.41    | 1,103,619.00  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 22,400  | 152.97   | 3,426,528.00  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 314,600 | 26.68    | 8,393,528.00  |
| POWER CORP OF CANADA         | 86,400  | 32.95    | 2,846,880.00  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 94,300  | 63.78    | 6,014,454.00  |
| FIRSTSERVICE CORP            | 6,100   | 188.17   | 1,147,837.00  |
| BLACKBERRY LTD               | 86,600  | 12.09    | 1,046,994.00  |
| CGI INC                      | 38,000  | 102.39   | 3,890,820.00  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 3,200   | 1,734.69 | 5,551,008.00  |
| OPEN TEXT CORP               | 44,900  | 59.90    | 2,689,510.00  |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 17,700  | 1,390.46 | 24,611,142.00 |
| BCE INC                      | 24,700  | 57.42    | 1,418,274.00  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 58,900  | 60.80    | 3,581,120.00  |
| TELUS CORP                   | 50,100  | 26.15    | 1,310,115.00  |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 95,200  | 19.77    | 1,882,104.00  |
| ALTAGAS LTD                  | 41,300  | 20.59    | 850,367.00    |
| ATCO LTD -CLASS I            | 9,500   | 41.13    | 390,735.00    |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 20,850  | 55.83    | 1,164,055.50  |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 23,200  | 33.75    | 783,000.00    |
| EMERA INC                    | 39,600  | 55.46    | 2,196,216.00  |
| FORTIS INC                   | 76,100  | 53.93    | 4,104,073.00  |
| HYDRO ONE LTD                | 55,500  | 29.48    | 1,636,140.00  |
| NORTHLAND POWER INC          | 32,800  | 43.72    | 1,434,016.00  |

|               |                              |           |        |                                    |  |
|---------------|------------------------------|-----------|--------|------------------------------------|--|
|               | カナダドル 小計                     | 6,420,744 |        | 352,182,917.49<br>(30,495,518,825) |  |
| オーストラリア<br>ドル | AMPOL LTD                    | 42,710    | 24.94  | 1,065,187.40                       |  |
|               | OIL SEARCH LTD               | 324,022   | 4.13   | 1,338,210.86                       |  |
|               | ORIGIN ENERGY LTD            | 278,609   | 4.74   | 1,320,606.66                       |  |
|               | SANTOS LTD                   | 299,069   | 7.06   | 2,111,427.14                       |  |
|               | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 13,920    | 30.97  | 431,102.40                         |  |
|               | WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 159,193   | 24.20  | 3,852,470.60                       |  |
|               | BHP GROUP LTD                | 474,487   | 44.88  | 21,294,976.56                      |  |
|               | BLUESCOPE STEEL LTD          | 80,098    | 18.55  | 1,485,817.90                       |  |
|               | EVOLUTION MINING LTD         | 271,023   | 4.32   | 1,170,819.36                       |  |
|               | FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 272,941   | 19.35  | 5,281,408.35                       |  |
|               | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 69,761    | 38.50  | 2,685,798.50                       |  |
|               | NEWCREST MINING LTD          | 133,680   | 25.05  | 3,348,684.00                       |  |
|               | NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 170,773   | 10.25  | 1,750,423.25                       |  |
|               | ORICA LTD                    | 58,204    | 14.02  | 816,020.08                         |  |
|               | RIO TINTO LTD                | 58,869    | 109.70 | 6,457,929.30                       |  |
|               | SOUTH32 LTD                  | 760,022   | 2.70   | 2,052,059.40                       |  |
|               | CIMIC GROUP LTD              | 12,366    | 17.75  | 219,496.50                         |  |
|               | BRAMBLES LTD                 | 231,258   | 10.31  | 2,384,269.98                       |  |
|               | AURIZON HOLDINGS LTD         | 316,214   | 3.91   | 1,236,396.74                       |  |
|               | QANTAS AIRWAYS LTD           | 157,727   | 5.13   | 809,139.51                         |  |
|               | SYDNEY AIRPORT               | 212,579   | 5.89   | 1,252,090.31                       |  |
|               | TRANSURBAN GROUP             | 433,779   | 12.83  | 5,565,384.57                       |  |
|               | ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 92,905    | 34.81  | 3,234,023.05                       |  |
|               | CROWN RESORTS LTD            | 68,133    | 11.84  | 806,694.72                         |  |
|               | TABCORP HOLDINGS LTD         | 359,038   | 4.83   | 1,734,153.54                       |  |
|               | REA GROUP LTD                | 8,604     | 140.61 | 1,209,808.44                       |  |
|               | SEEK LTD                     | 52,612    | 27.81  | 1,463,139.72                       |  |
|               | WESFARMERS LTD               | 181,754   | 52.13  | 9,474,836.02                       |  |
|               | COLES GROUP LTD              | 219,084   | 15.98  | 3,500,962.32                       |  |
|               | WOOLWORTHS GROUP LTD         | 203,895   | 40.33  | 8,223,085.35                       |  |
|               | COCA-COLA AMATIL LTD         | 87,959    | 13.45  | 1,183,048.55                       |  |
|               | TREASURY WINE ESTATES LTD    | 124,673   | 10.90  | 1,358,935.70                       |  |
|               | COCHLEAR LTD                 | 10,461    | 213.08 | 2,229,029.88                       |  |
|               | RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 28,197    | 68.10  | 1,920,215.70                       |  |
|               | SONIC HEALTHCARE LTD         | 71,565    | 35.06  | 2,509,068.90                       |  |
|               | CSL LTD                      | 73,540    | 266.02 | 19,563,110.80                      |  |
|               | AUST AND NZ BANKING GROUP    | 453,782   | 28.00  | 12,705,896.00                      |  |
|               | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 285,436   | 86.37  | 24,653,107.32                      |  |
|               | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 525,992   | 25.84  | 13,591,633.28                      |  |
|               | WESTPAC BANKING CORP         | 585,644   | 24.19  | 14,166,728.36                      |  |

|         |                              |            |        |                                    |  |
|---------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
|         | AMP LTD                      | 614,794    | 1.38   | 851,489.69                         |  |
|         | ASX LTD                      | 32,675     | 72.25  | 2,360,768.75                       |  |
|         | MACQUARIE GROUP LTD          | 55,631     | 151.51 | 8,428,652.81                       |  |
|         | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 20,923     | 45.97  | 961,830.31                         |  |
|         | INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 375,820    | 4.84   | 1,818,968.80                       |  |
|         | MEDIBANK PRIVATE LTD         | 444,691    | 2.91   | 1,294,050.81                       |  |
|         | QBE INSURANCE GROUP LTD      | 239,120    | 9.64   | 2,305,116.80                       |  |
|         | SUNCORP GROUP LTD            | 215,008    | 9.99   | 2,147,929.92                       |  |
|         | LENDLEASE GROUP              | 118,940    | 13.00  | 1,546,220.00                       |  |
|         | AFTERPAY LTD                 | 34,542     | 107.50 | 3,713,265.00                       |  |
|         | COMPUTERSHARE LTD            | 81,227     | 14.99  | 1,217,592.73                       |  |
|         | WISETECH GLOBAL LTD          | 21,412     | 27.86  | 596,538.32                         |  |
|         | XERO LTD                     | 19,246     | 123.47 | 2,376,303.62                       |  |
|         | TELSTRA CORP LTD             | 676,003    | 3.30   | 2,230,809.90                       |  |
|         | TPG TELECOM LTD              | 47,954     | 6.92   | 331,841.68                         |  |
|         | AGL ENERGY LTD               | 100,342    | 10.34  | 1,037,536.28                       |  |
|         | APA GROUP                    | 193,858    | 10.12  | 1,961,842.96                       |  |
|         | AUSNET SERVICES              | 360,836    | 1.82   | 658,525.70                         |  |
|         | オーストラリアドル 小計                 | 11,917,600 |        | 227,296,481.10<br>(18,795,146,022) |  |
| イギリスポンド | BP PLC                       | 3,258,237  | 3.01   | 9,825,213.67                       |  |
|         | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 664,240    | 14.63  | 9,719,159.68                       |  |
|         | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 594,627    | 13.87  | 8,248,665.74                       |  |
|         | ANGLO AMERICAN PLC           | 198,112    | 27.83  | 5,513,456.96                       |  |
|         | ANTOFAGASTA PLC              | 62,142     | 16.85  | 1,047,403.41                       |  |
|         | BHP GROUP PLC                | 339,931    | 20.57  | 6,994,080.32                       |  |
|         | CRODA INTERNATIONAL PLC      | 22,191     | 63.94  | 1,418,892.54                       |  |
|         | EVRAZ PLC                    | 82,637     | 5.33   | 441,116.30                         |  |
|         | FRESNILLO PLC                | 28,190     | 9.10   | 256,529.00                         |  |
|         | GLENCORE PLC                 | 1,614,286  | 2.78   | 4,490,136.50                       |  |
|         | JOHNSON MATTHEY PLC          | 31,751     | 30.02  | 953,165.02                         |  |
|         | MONDI PLC                    | 75,814     | 18.71  | 1,418,859.01                       |  |
|         | RIO TINTO PLC                | 181,030    | 54.22  | 9,815,446.60                       |  |
|         | ASHTED GROUP PLC             | 72,578     | 43.28  | 3,141,175.84                       |  |
|         | BAE SYSTEMS PLC              | 518,288    | 4.99   | 2,590,921.71                       |  |
|         | BUNZL PLC                    | 53,020     | 23.18  | 1,229,003.60                       |  |
|         | DCC PLC                      | 15,173     | 66.14  | 1,003,542.22                       |  |
|         | FERGUSON PLC                 | 36,189     | 86.42  | 3,127,453.38                       |  |
|         | MELROSE INDUSTRIES PLC       | 764,715    | 1.69   | 1,293,133.06                       |  |
|         | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 1,323,931  | 1.08   | 1,429,845.48                       |  |
|         | SMITHS GROUP PLC             | 60,852     | 14.75  | 897,567.00                         |  |
|         | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 11,470     | 114.30 | 1,311,021.00                       |  |

|                              |            |       |               |
|------------------------------|------------|-------|---------------|
| EXPERIAN PLC                 | 148,134    | 24.53 | 3,633,727.02  |
| INTERTEK GROUP PLC           | 26,657     | 55.30 | 1,474,132.10  |
| RELX PLC                     | 311,928    | 17.99 | 5,613,144.36  |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | 307,195    | 4.91  | 1,509,249.03  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 157,832    | 7.64  | 1,206,783.47  |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 20,863     | 43.99 | 917,763.37    |
| BURBERRY GROUP PLC           | 66,384     | 19.93 | 1,323,365.04  |
| PERSIMMON PLC                | 53,131     | 29.45 | 1,564,707.95  |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 561,129    | 1.78  | 999,651.31    |
| COMPASS GROUP PLC            | 287,249    | 14.70 | 4,222,560.30  |
| ENTAIN PLC                   | 96,181     | 15.40 | 1,481,187.40  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 27,229     | 49.40 | 1,345,112.60  |
| WHITBREAD PLC                | 33,847     | 33.48 | 1,133,197.56  |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 159,456    | 5.73  | 914,001.79    |
| INFORMA PLC                  | 234,087    | 5.69  | 1,331,955.03  |
| PEARSON PLC                  | 124,328    | 7.86  | 977,218.08    |
| WPP PLC                      | 200,466    | 9.29  | 1,863,131.00  |
| JD SPORTS FASHION PLC        | 76,698     | 8.18  | 627,389.64    |
| KINGFISHER PLC               | 323,779    | 3.25  | 1,052,281.75  |
| NEXT PLC                     | 22,084     | 76.68 | 1,693,401.12  |
| OCADO GROUP PLC              | 79,448     | 20.55 | 1,632,656.40  |
| SAINSBURY (J) PLC            | 264,520    | 2.42  | 641,725.52    |
| TESCO PLC                    | 1,239,798  | 2.29  | 2,839,137.42  |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 356,141    | 1.79  | 638,382.74    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 56,609     | 23.30 | 1,318,989.70  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 369,747    | 28.50 | 10,537,789.50 |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 34,277     | 22.79 | 781,172.83    |
| DIAGEO PLC                   | 376,557    | 30.08 | 11,328,717.34 |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 153,495    | 14.95 | 2,295,517.72  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 114,582    | 64.34 | 7,372,205.88  |
| UNILEVER PLC                 | 423,148    | 40.56 | 17,162,882.88 |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 143,311    | 13.42 | 1,923,233.62  |
| ASTRAZENECA PLC              | 211,417    | 71.30 | 15,074,032.10 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 807,882    | 12.84 | 10,379,667.93 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 25,548     | 22.19 | 566,910.12    |
| BARCLAYS PLC                 | 2,798,731  | 1.84  | 5,155,822.24  |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 3,280,422  | 4.23  | 13,899,148.01 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 11,427,549 | 0.42  | 4,826,425.32  |
| NATWEST GROUP PLC            | 763,476    | 1.95  | 1,496,031.22  |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 437,535    | 4.88  | 2,135,170.80  |
| 3I GROUP PLC                 | 153,110    | 11.52 | 1,763,827.20  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 53,234     | 15.28 | 813,415.52    |

|        |                              |            |           |                                    |  |
|--------|------------------------------|------------|-----------|------------------------------------|--|
|        | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 50,954     | 70.80     | 3,607,543.20                       |  |
|        | M&G PLC                      | 437,392    | 2.03      | 888,780.54                         |  |
|        | SCHRODERS PLC                | 21,568     | 35.45     | 764,585.60                         |  |
|        | ST JAMES'S PLACE PLC         | 82,879     | 12.66     | 1,049,248.14                       |  |
|        | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC   | 350,806    | 2.89      | 1,015,232.56                       |  |
|        | ADMIRAL GROUP PLC            | 30,353     | 29.93     | 908,465.29                         |  |
|        | AVIVA PLC                    | 635,770    | 3.98      | 2,533,543.45                       |  |
|        | DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 200,927    | 3.16      | 635,331.17                         |  |
|        | LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 961,810    | 2.72      | 2,621,894.06                       |  |
|        | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | 94,487     | 7.20      | 680,684.34                         |  |
|        | PRUDENTIAL PLC               | 420,136    | 15.53     | 6,526,812.76                       |  |
|        | RSA INSURANCE GROUP PLC      | 154,294    | 6.80      | 1,050,433.55                       |  |
|        | AVEVA GROUP PLC              | 19,699     | 33.90     | 667,796.10                         |  |
|        | SAGE GROUP PLC/THE           | 185,557    | 6.01      | 1,115,939.79                       |  |
|        | HALMA PLC                    | 63,105     | 23.59     | 1,488,646.95                       |  |
|        | BT GROUP PLC                 | 1,394,770  | 1.46      | 2,039,851.12                       |  |
|        | VODAFONE GROUP PLC           | 4,320,767  | 1.33      | 5,786,371.16                       |  |
|        | NATIONAL GRID PLC            | 567,668    | 8.62      | 4,894,433.49                       |  |
|        | SEVERN TRENT PLC             | 37,963     | 22.81     | 865,936.03                         |  |
|        | SSE PLC                      | 168,142    | 14.29     | 2,402,749.18                       |  |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 103,846    | 9.10      | 944,998.60                         |  |
|        | イギリスポンド 小計                   | 47,121,491 |           | 268,121,887.05<br>(39,968,929,702) |  |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG              | 29,779     | 18.94     | 564,163.15                         |  |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 1,371      | 836.00    | 1,146,156.00                       |  |
|        | GIVAUDAN-REG                 | 1,486      | 3,616.00  | 5,373,376.00                       |  |
|        | LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 82,932     | 53.94     | 4,473,352.08                       |  |
|        | SIKA AG-REG                  | 22,983     | 262.00    | 6,021,546.00                       |  |
|        | ABB LTD-REG                  | 295,840    | 29.05     | 8,594,152.00                       |  |
|        | GEBERIT AG-REG               | 6,042      | 588.40    | 3,555,112.80                       |  |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 3,384      | 267.20    | 904,204.80                         |  |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 6,476      | 271.50    | 1,758,234.00                       |  |
|        | ADECCO GROUP AG-REG          | 23,854     | 63.42     | 1,512,820.68                       |  |
|        | SGS SA-REG                   | 996        | 2,757.00  | 2,745,972.00                       |  |
|        | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 8,465      | 272.50    | 2,306,712.50                       |  |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 83,670     | 90.60     | 7,580,502.00                       |  |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 5,006      | 270.20    | 1,352,621.20                       |  |
|        | SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 7,069      | 51.95     | 367,234.55                         |  |
|        | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 479        | 2,094.00  | 1,003,026.00                       |  |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 169        | 8,205.00  | 1,386,645.00                       |  |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 17         | 86,800.00 | 1,475,600.00                       |  |
|        | NESTLE SA-REG                | 463,752    | 104.06    | 48,258,033.12                      |  |



|      |                              |           |          |                                    |  |
|------|------------------------------|-----------|----------|------------------------------------|--|
|      | ALCON INC                    | 79,678    | 65.02    | 5,180,663.56                       |  |
|      | SONOVA HOLDING AG-REG        | 8,944     | 253.00   | 2,262,832.00                       |  |
|      | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 1,641     | 1,128.00 | 1,851,048.00                       |  |
|      | LONZA GROUP AG-REG           | 11,968    | 554.20   | 6,632,665.60                       |  |
|      | NOVARTIS AG-REG              | 357,435   | 80.61    | 28,812,835.35                      |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-BR          | 5,039     | 314.60   | 1,585,269.40                       |  |
|      | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 113,112   | 304.65   | 34,459,570.80                      |  |
|      | VIFOR PHARMA AG              | 7,203     | 125.15   | 901,455.45                         |  |
|      | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 4,570     | 96.00    | 438,720.00                         |  |
|      | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 395,072   | 12.23    | 4,833,705.92                       |  |
|      | JULIUS BAER GROUP LTD        | 34,993    | 61.50    | 2,152,069.50                       |  |
|      | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 3,048     | 1,205.00 | 3,672,840.00                       |  |
|      | UBS GROUP AG-REG             | 587,587   | 14.92    | 8,766,798.04                       |  |
|      | BALOISE HOLDING AG - REG     | 7,042     | 159.50   | 1,123,199.00                       |  |
|      | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 5,034     | 458.50   | 2,308,089.00                       |  |
|      | SWISS RE AG                  | 46,136    | 92.82    | 4,282,343.52                       |  |
|      | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 24,063    | 400.30   | 9,632,418.90                       |  |
|      | SWISS PRIME SITE-REG         | 11,915    | 93.20    | 1,110,478.00                       |  |
|      | TEMENOS AG - REG             | 10,848    | 139.05   | 1,508,414.40                       |  |
|      | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 26,525    | 95.84    | 2,542,156.00                       |  |
|      | SWISSCOM AG-REG              | 4,298     | 504.00   | 2,166,192.00                       |  |
|      | スイスフラン 小計                    | 2,789,921 |          | 226,603,228.32<br>(26,367,551,647) |  |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 438,868   | 61.00    | 26,770,948.00                      |  |
|      | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 223,000   | 124.00   | 27,652,000.00                      |  |
|      | XINYI GLASS HOLDINGS LTD     | 304,000   | 23.55    | 7,159,200.00                       |  |
|      | MTR CORP                     | 253,500   | 43.95    | 11,141,325.00                      |  |
|      | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 355,000   | 67.50    | 23,962,500.00                      |  |
|      | SANDS CHINA LTD              | 378,800   | 37.20    | 14,091,360.00                      |  |
|      | SJM HOLDINGS LTD             | 365,000   | 9.74     | 3,555,100.00                       |  |
|      | WYNN MACAU LTD               | 286,400   | 14.82    | 4,244,448.00                       |  |
|      | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 285,500   | 23.25    | 6,637,875.00                       |  |
|      | WH GROUP LTD                 | 1,590,000 | 6.96     | 11,066,400.00                      |  |
|      | BANK OF EAST ASIA LTD        | 208,820   | 16.70    | 3,487,294.00                       |  |
|      | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 583,000   | 27.80    | 16,207,400.00                      |  |
|      | HANG SENG BANK LTD           | 126,500   | 147.90   | 18,709,350.00                      |  |
|      | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 194,400   | 435.80   | 84,719,520.00                      |  |
|      | AIA GROUP LTD                | 1,946,600 | 92.75    | 180,547,150.00                     |  |
|      | CK ASSET HOLDINGS LTD        | 417,868   | 47.95    | 20,036,770.60                      |  |
|      | ESR CAYMAN LTD               | 295,000   | 23.85    | 7,035,750.00                       |  |
|      | HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 340,000   | 19.48    | 6,623,200.00                       |  |
|      | HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 234,641   | 33.10    | 7,766,617.10                       |  |

|            |                              |            |        |                                   |  |
|------------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
|            | NEW WORLD DEVELOPMENT        | 230,250    | 37.95  | 8,737,987.50                      |  |
|            | SINO LAND CO                 | 491,400    | 10.90  | 5,356,260.00                      |  |
|            | SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 205,000    | 113.00 | 23,165,000.00                     |  |
|            | SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 85,000     | 53.40  | 4,539,000.00                      |  |
|            | SWIRE PROPERTIES LTD         | 174,000    | 23.50  | 4,089,000.00                      |  |
|            | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 257,000    | 41.40  | 10,639,800.00                     |  |
|            | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 634,000    | 10.92  | 6,923,280.00                      |  |
|            | PCCW LTD                     | 549,000    | 4.37   | 2,399,130.00                      |  |
|            | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 101,000    | 45.45  | 4,590,450.00                      |  |
|            | CLP HOLDINGS LTD             | 257,500    | 74.85  | 19,273,875.00                     |  |
|            | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | 501,500    | 7.83   | 3,926,745.00                      |  |
|            | HONG KONG & CHINA GAS        | 1,668,808  | 12.06  | 20,125,824.48                     |  |
|            | POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 234,500    | 45.30  | 10,622,850.00                     |  |
|            | ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 44,100     | 97.15  | 4,284,315.00                      |  |
|            | 香港ドル 小計                      | 14,259,955 |        | 610,087,724.68<br>(8,553,429,900) |  |
| シンガポールドル   | KEPPEL CORP LTD              | 238,900    | 5.22   | 1,247,058.00                      |  |
|            | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 268,500    | 3.88   | 1,041,780.00                      |  |
|            | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 201,740    | 5.53   | 1,115,622.20                      |  |
|            | GENTING SINGAPORE LTD        | 864,900    | 0.92   | 795,708.00                        |  |
|            | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 306,900    | 5.33   | 1,635,777.00                      |  |
|            | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 291,900    | 28.30  | 8,260,770.00                      |  |
|            | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 546,400    | 11.61  | 6,343,704.00                      |  |
|            | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 192,400    | 25.44  | 4,894,656.00                      |  |
|            | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 133,600    | 9.88   | 1,319,968.00                      |  |
|            | CAPITALAND LTD               | 415,600    | 3.71   | 1,541,876.00                      |  |
|            | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 58,700     | 7.83   | 459,621.00                        |  |
|            | UOL GROUP LTD                | 59,900     | 7.71   | 461,829.00                        |  |
|            | VENTURE CORP LTD             | 46,100     | 20.39  | 939,979.00                        |  |
|            | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 1,295,960  | 2.37   | 3,071,425.20                      |  |
|            | シンガポールドル 小計                  | 4,921,500  |        | 33,129,773.40<br>(2,680,198,668)  |  |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 200,225    | 7.44   | 1,489,674.00                      |  |
|            | A2 MILK CO LTD               | 115,334    | 9.04   | 1,042,619.36                      |  |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 92,498     | 31.40  | 2,904,437.20                      |  |
|            | RYMAN HEALTHCARE LTD         | 65,340     | 15.21  | 993,821.40                        |  |
|            | SPARK NEW ZEALAND LTD        | 297,267    | 4.42   | 1,313,920.14                      |  |
|            | MERCURY NZ LTD               | 123,073    | 6.59   | 811,051.07                        |  |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD          | 207,221    | 5.25   | 1,087,910.25                      |  |
|            | ニュージーランドドル 小計                | 1,100,958  |        | 9,643,433.42<br>(732,418,768)     |  |
|            | LUNDIN ENERGY AB             | 31,637     | 282.40 | 8,934,288.80                      |  |

|               |                              |           |          |                                    |  |
|---------------|------------------------------|-----------|----------|------------------------------------|--|
| スウェーデンクローネ    | BOLIDEN AB                   | 42,325    | 318.80   | 13,493,210.00                      |  |
|               | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 96,640    | 158.60   | 15,327,104.00                      |  |
|               | ALFA LAVAL AB                | 48,307    | 270.70   | 13,076,704.90                      |  |
|               | ASSA ABLOY AB-B              | 163,169   | 238.70   | 38,948,440.30                      |  |
|               | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 108,494   | 515.00   | 55,874,410.00                      |  |
|               | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 62,257    | 437.70   | 27,249,888.90                      |  |
|               | EPIROC AB-A                  | 103,134   | 189.20   | 19,512,952.80                      |  |
|               | EPIROC AB-B                  | 65,627    | 172.70   | 11,333,782.90                      |  |
|               | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 26,287    | 218.60   | 5,746,338.20                       |  |
|               | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 49,914    | 266.00   | 13,277,124.00                      |  |
|               | SANDVIK AB                   | 179,310   | 233.00   | 41,779,230.00                      |  |
|               | SKANSKA AB-B SHS             | 55,468    | 229.00   | 12,702,172.00                      |  |
|               | SKF AB-B SHARES              | 61,034    | 245.00   | 14,953,330.00                      |  |
|               | VOLVO AB-B SHS               | 231,071   | 225.40   | 52,083,403.40                      |  |
|               | SECURITAS AB-B SHS           | 46,121    | 144.90   | 6,682,932.90                       |  |
|               | ELECTROLUX AB-SER B          | 38,512    | 257.90   | 9,932,244.80                       |  |
|               | HUSQVARNA AB-B SHS           | 71,384    | 124.50   | 8,887,308.00                       |  |
|               | EVOLUTION GAMING GROUP       | 26,092    | 1,260.00 | 32,875,920.00                      |  |
|               | HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 126,639   | 206.50   | 26,150,953.50                      |  |
|               | ICA GRUPPEN AB               | 17,227    | 426.70   | 7,350,760.90                       |  |
|               | SWEDISH MATCH AB             | 25,563    | 665.00   | 16,999,395.00                      |  |
|               | ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 99,662    | 276.60   | 27,566,509.20                      |  |
|               | NORDEA BANK ABP              | 513,660   | 85.49    | 43,912,793.40                      |  |
|               | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 266,923   | 109.35   | 29,188,030.05                      |  |
|               | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 244,351   | 101.15   | 24,716,103.65                      |  |
|               | SWEDBANK AB - A SHARES       | 141,926   | 161.60   | 22,935,241.60                      |  |
|               | EQT AB                       | 38,884    | 266.00   | 10,343,144.00                      |  |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 17,548    | 320.80   | 5,629,398.40                       |  |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 25,773    | 309.20   | 7,969,011.60                       |  |
|               | INVESTOR AB-B SHS            | 73,467    | 684.40   | 50,280,814.80                      |  |
|               | KINNEVIK AB - B              | 38,085    | 426.70   | 16,250,869.50                      |  |
|               | LUNDBERGS AB-B SHS           | 10,879    | 471.80   | 5,132,712.20                       |  |
|               | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS  | 15,289    | 433.40   | 6,626,252.60                       |  |
|               | ERICSSON LM-B SHS            | 471,636   | 114.40   | 53,955,158.40                      |  |
|               | HEXAGON AB-B SHS             | 45,680    | 769.20   | 35,137,056.00                      |  |
|               | TELE2 AB-B SHS               | 79,613    | 115.40   | 9,187,340.20                       |  |
|               | TELIA CO AB                  | 409,275   | 37.99    | 15,548,357.25                      |  |
| スウェーデンクローネ 小計 |                              | 4,168,863 |          | 817,550,688.15<br>(10,342,016,205) |  |
| ノルウェークローネ     | EQUINOR ASA                  | 156,102   | 167.80   | 26,193,915.60                      |  |
|               | NORSK HYDRO ASA              | 220,397   | 49.89    | 10,995,606.33                      |  |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA       | 28,144    | 431.90   | 12,155,393.60                      |  |

|           |                           |         |           |                                   |  |
|-----------|---------------------------|---------|-----------|-----------------------------------|--|
|           | ADEVINTA ASA              | 41,557  | 138.10    | 5,739,021.70                      |  |
|           | SCHIBSTED ASA-B SHS       | 14,879  | 320.80    | 4,773,183.20                      |  |
|           | SCHIBSTED ASA-CL A        | 11,227  | 373.50    | 4,193,284.50                      |  |
|           | MOWI ASA                  | 71,206  | 206.00    | 14,668,436.00                     |  |
|           | ORKLA ASA                 | 121,260 | 84.32     | 10,224,643.20                     |  |
|           | DNB ASA                   | 149,372 | 179.30    | 26,782,399.60                     |  |
|           | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 35,073  | 208.40    | 7,309,213.20                      |  |
|           | TELENOR ASA               | 113,645 | 149.45    | 16,984,245.25                     |  |
|           | ノルウェークローネ 小計              | 962,862 |           | 140,019,342.18<br>(1,775,445,258) |  |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S    | 16,194  | 564.60    | 9,143,132.40                      |  |
|           | NOVOZYMES A/S-B SHARES    | 34,335  | 400.90    | 13,764,901.50                     |  |
|           | ROCKWOOL INTL A/S-B SHS   | 1,135   | 2,528.00  | 2,869,280.00                      |  |
|           | VESTAS WIND SYSTEMS A/S   | 31,897  | 1,132.50  | 36,123,352.50                     |  |
|           | AP MOLLER-MAERSK A/S-A    | 477     | 12,830.00 | 6,119,910.00                      |  |
|           | AP MOLLER-MAERSK A/S-B    | 1,017   | 13,630.00 | 13,861,710.00                     |  |
|           | DSV PANALPINA A/S         | 33,631  | 1,156.50  | 38,894,251.50                     |  |
|           | PANDORA A/S               | 16,039  | 651.00    | 10,441,389.00                     |  |
|           | CARLSBERG AS-B            | 16,244  | 982.00    | 15,951,608.00                     |  |
|           | AMBU A/S-B                | 25,886  | 282.30    | 7,307,617.80                      |  |
|           | COLOPLAST-B               | 19,220  | 954.60    | 18,347,412.00                     |  |
|           | DEMANT A/S                | 15,657  | 260.50    | 4,078,648.50                      |  |
|           | GN STORE NORD A/S         | 20,791  | 488.10    | 10,148,087.10                     |  |
|           | GENMAB A/S                | 10,632  | 2,020.00  | 21,476,640.00                     |  |
|           | H LUNDBECK A/S            | 12,999  | 219.00    | 2,846,781.00                      |  |
|           | NOVO NORDISK A/S-B        | 277,893 | 422.10    | 117,298,635.30                    |  |
|           | DANSKE BANK A/S           | 112,289 | 119.30    | 13,396,077.70                     |  |
|           | TRYG A/S                  | 23,244  | 145.80    | 3,388,975.20                      |  |
|           | ORSTED A/S                | 30,058  | 983.20    | 29,553,025.60                     |  |
|           | デンマーククローネ 小計              | 699,638 |           | 375,011,435.10<br>(6,487,697,827) |  |
| イスラエルシェケル | ICL GROUP LTD             | 130,066 | 19.83     | 2,579,208.78                      |  |
|           | ELBIT SYSTEMS LTD         | 3,465   | 461.10    | 1,597,711.50                      |  |
|           | BANK HAPOLIM BM           | 175,741 | 25.90     | 4,551,691.90                      |  |
|           | BANK LEUMI LE-ISRAEL      | 220,982 | 21.80     | 4,817,407.60                      |  |
|           | ISRAEL DISCOUNT BANK-A    | 204,489 | 14.04     | 2,871,025.56                      |  |
|           | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD  | 18,225  | 87.59     | 1,596,327.75                      |  |
|           | AZRIELI GROUP LTD         | 9,146   | 212.40    | 1,942,610.40                      |  |
|           | NICE LTD                  | 9,783   | 734.00    | 7,180,722.00                      |  |
|           | イスラエルシェケル 小計              | 771,897 |           | 27,136,705.49<br>(891,983,509)    |  |
| ユーロ       | ENI SPA                   | 408,620 | 10.24     | 4,186,720.52                      |  |

|                             |         |        |               |
|-----------------------------|---------|--------|---------------|
| GALP ENERGIA SGPS SA        | 84,034  | 10.06  | 845,802.21    |
| NESTE OYJ                   | 68,193  | 49.20  | 3,355,095.60  |
| OMV AG                      | 24,140  | 43.22  | 1,043,330.80  |
| REPSOL SA                   | 243,914 | 10.69  | 2,607,440.66  |
| TENARIS SA                  | 78,513  | 9.42   | 740,220.56    |
| TOTAL SE                    | 406,327 | 40.06  | 16,279,491.25 |
| VOPAK                       | 12,317  | 42.00  | 517,314.00    |
| AIR LIQUIDE SA              | 76,639  | 136.10 | 10,430,567.90 |
| AKZO NOBEL N.V.             | 31,253  | 94.34  | 2,948,408.02  |
| ARCELORMITTAL               | 119,226 | 22.66  | 2,701,661.16  |
| ARKEMA                      | 11,538  | 103.50 | 1,194,183.00  |
| BASF SE                     | 148,374 | 69.98  | 10,383,212.52 |
| COVESTRO AG                 | 29,777  | 54.12  | 1,611,531.24  |
| CRH PLC                     | 127,755 | 37.92  | 4,844,469.60  |
| EVONIK INDUSTRIES AG        | 33,254  | 29.87  | 993,296.98    |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF      | 9,927   | 40.78  | 404,823.06    |
| HEIDELBERGCEMENT AG         | 24,488  | 74.62  | 1,827,294.56  |
| KONINKLIJKE DSM NV          | 28,074  | 145.50 | 4,084,767.00  |
| LANXESS AG                  | 13,421  | 63.50  | 852,233.50    |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 40,487  | 40.40  | 1,635,674.80  |
| SOLVAY SA                   | 11,304  | 106.35 | 1,202,180.40  |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        | 92,258  | 16.11  | 1,486,276.38  |
| SYMRISE AG                  | 21,324  | 100.90 | 2,151,591.60  |
| UMICORE                     | 31,574  | 45.08  | 1,423,355.92  |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 86,702  | 31.94  | 2,769,261.88  |
| VOESTALPINE AG              | 16,995  | 34.76  | 590,746.20    |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 37,815  | 26.29  | 994,156.35    |
| AIRBUS SE                   | 95,210  | 95.97  | 9,137,303.70  |
| ALSTOM                      | 42,585  | 40.95  | 1,743,855.75  |
| BOUYGUES SA                 | 38,278  | 33.85  | 1,295,710.30  |
| BRENTAG SE                  | 25,275  | 71.20  | 1,799,580.00  |
| CNH INDUSTRIAL NV           | 159,453 | 13.06  | 2,082,456.18  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN   | 80,839  | 49.31  | 3,986,171.09  |
| DASSAULT AVIATION SA        | 465     | 930.50 | 432,682.50    |
| EIFFAGE                     | 13,381  | 86.64  | 1,159,329.84  |
| FERROVIAL SA                | 78,699  | 21.74  | 1,710,916.26  |
| GEA GROUP AG                | 25,583  | 34.83  | 891,055.89    |
| HOCHTIEF AG                 | 3,195   | 73.35  | 234,353.25    |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 24,271  | 68.40  | 1,660,136.40  |
| KION GROUP AG               | 12,586  | 78.46  | 987,497.56    |
| KNORR-BREMSE AG             | 11,550  | 101.14 | 1,168,167.00  |
| KONE OYJ-B                  | 55,428  | 68.16  | 3,777,972.48  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| LEGRAND SA                   | 43,362  | 74.80  | 3,243,477.60  |
| MTU AERO ENGINES AG          | 8,176   | 196.30 | 1,604,948.80  |
| PRYSMIAN SPA                 | 39,563  | 26.26  | 1,038,924.38  |
| RATIONAL AG                  | 905     | 668.00 | 604,540.00    |
| SAFRAN SA                    | 51,732  | 116.65 | 6,034,537.80  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 86,185  | 124.95 | 10,768,815.75 |
| SIEMENS AG-REG               | 123,297 | 135.56 | 16,714,141.32 |
| SIEMENS ENERGY AG            | 64,097  | 29.38  | 1,883,169.86  |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 36,513  | 28.34  | 1,034,778.42  |
| THALES SA                    | 17,267  | 82.52  | 1,424,872.84  |
| VINCI SA                     | 83,497  | 87.92  | 7,341,056.24  |
| WARTSILA OYJ ABP             | 65,918  | 9.03   | 595,371.37    |
| BUREAU VERITAS SA            | 45,344  | 23.86  | 1,081,907.84  |
| RANDSTAD NV                  | 18,516  | 60.72  | 1,124,291.52  |
| TELEPERFORMANCE              | 9,439   | 304.30 | 2,872,287.70  |
| WOLTERS KLUWER               | 42,319  | 72.00  | 3,046,968.00  |
| ADP                          | 5,184   | 102.10 | 529,286.40    |
| AENA SME SA                  | 10,979  | 136.90 | 1,503,025.10  |
| ATLANTIA SPA                 | 82,100  | 15.79  | 1,296,769.50  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 49,916  | 11.02  | 550,323.90    |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | 158,465 | 44.62  | 7,070,708.30  |
| GETLINK SE                   | 68,170  | 13.27  | 904,615.90    |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 53,710  | 82.59  | 4,435,908.90  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 8,409   | 65.55  | 551,209.95    |
| CONTINENTAL AG               | 17,470  | 110.90 | 1,937,423.00  |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 138,356 | 71.65  | 9,913,207.40  |
| FAURECIA                     | 13,740  | 44.55  | 612,117.00    |
| FERRARI NV                   | 20,410  | 169.55 | 3,460,515.50  |
| MICHELIN (CGDE)              | 27,012  | 124.50 | 3,362,994.00  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   | 24,658  | 84.68  | 2,088,039.44  |
| RENAULT SA                   | 29,484  | 37.00  | 1,090,908.00  |
| STELLANTIS NV                | 336,354 | 14.20  | 4,778,244.92  |
| VALEO SA                     | 37,841  | 28.18  | 1,066,359.38  |
| VOLKSWAGEN AG                | 5,239   | 285.20 | 1,494,162.80  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 29,778  | 218.85 | 6,516,915.30  |
| ADIDAS AG                    | 30,452  | 278.80 | 8,490,017.60  |
| ESSILORLUXOTTICA             | 45,759  | 133.60 | 6,113,402.40  |
| HERMES INTERNATIONAL         | 5,155   | 938.40 | 4,837,452.00  |
| KERING                       | 12,159  | 571.20 | 6,945,220.80  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 44,684  | 553.40 | 24,728,125.60 |
| MONCLER SPA                  | 30,779  | 48.18  | 1,482,932.22  |
| PUMA SE                      | 15,930  | 84.02  | 1,338,438.60  |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| SEB SA                       | 3,606   | 146.40 | 527,918.40    |
| ACCOR SA                     | 30,762  | 32.52  | 1,000,380.24  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC    | 26,246  | 189.60 | 4,976,241.60  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM   | 12,720  | 39.20  | 498,624.00    |
| SODEXO SA                    | 14,297  | 81.00  | 1,158,057.00  |
| BOLLORE                      | 137,374 | 4.08   | 561,035.41    |
| PUBLICIS GROUPE              | 34,376  | 50.44  | 1,733,925.44  |
| SCOUT24 AG                   | 17,842  | 64.70  | 1,154,377.40  |
| SES                          | 68,465  | 7.16   | 490,483.26    |
| UBISOFT ENTERTAINMENT        | 14,966  | 63.62  | 952,136.92    |
| VIVENDI                      | 133,765 | 28.14  | 3,764,147.10  |
| DELIVERY HERO SE             | 21,377  | 109.25 | 2,335,437.25  |
| HELLOFRESH SE                | 23,413  | 63.40  | 1,484,384.20  |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL   | 177,144 | 27.97  | 4,954,717.68  |
| JUST EAT TAKEAWAY            | 20,480  | 77.24  | 1,581,875.20  |
| PROSUS NV                    | 77,926  | 93.10  | 7,254,910.60  |
| ZALANDO SE                   | 24,218  | 86.48  | 2,094,372.64  |
| CARREFOUR SA                 | 99,831  | 15.09  | 1,506,449.79  |
| COLRUYT SA                   | 9,744   | 49.92  | 486,420.48    |
| JERONIMO MARTINS             | 42,529  | 13.39  | 569,675.95    |
| KESKO OYJ-B SHS              | 40,867  | 24.90  | 1,017,588.30  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 178,581 | 23.14  | 4,132,364.34  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 122,334 | 52.92  | 6,473,915.28  |
| DANONE                       | 99,588  | 58.30  | 5,805,980.40  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV     | 92,086  | 9.48   | 873,343.62    |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 18,309  | 76.20  | 1,395,145.80  |
| HEINEKEN NV                  | 41,011  | 87.92  | 3,605,687.12  |
| JDE PEET'S NV                | 11,100  | 31.28  | 347,208.00    |
| KERRY GROUP PLC-A            | 24,921  | 105.00 | 2,616,705.00  |
| PERNOD RICARD SA             | 33,805  | 158.30 | 5,351,331.50  |
| REMY COINTREAU               | 3,357   | 160.00 | 537,120.00    |
| BEIERSDORF AG                | 16,868  | 89.22  | 1,504,962.96  |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 16,175  | 81.50  | 1,318,262.50  |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   | 29,518  | 94.00  | 2,774,692.00  |
| L'OREAL                      | 40,393  | 318.20 | 12,853,052.60 |
| AMPLIFON SPA                 | 21,192  | 31.84  | 674,753.28    |
| BIOMERIEUX                   | 6,814   | 108.40 | 738,637.60    |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR   | 6,830   | 130.00 | 887,900.00    |
| DIASORIN SPA                 | 4,411   | 140.00 | 617,540.00    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  | 33,264  | 61.50  | 2,045,736.00  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       | 68,394  | 36.29  | 2,482,018.26  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 145,288 | 47.21  | 6,859,046.48  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| ORPEA                        | 8,232     | 100.15 | 824,434.80    |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 5,689     | 440.60 | 2,506,573.40  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | 42,123    | 46.38  | 1,953,664.74  |
| ARGENX SE                    | 7,054     | 242.80 | 1,712,711.20  |
| BAYER AG-REG                 | 157,204   | 53.65  | 8,433,994.60  |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 20,874    | 81.51  | 1,701,439.74  |
| GALAPAGOS NV                 | 7,338     | 66.24  | 486,069.12    |
| GRIFOLS SA                   | 49,300    | 22.23  | 1,095,939.00  |
| IPSEN                        | 6,733     | 67.40  | 453,804.20    |
| MERCK KGAA                   | 21,059    | 143.80 | 3,028,284.20  |
| ORION OYJ-CLASS B            | 18,091    | 34.92  | 631,737.72    |
| QIAGEN N.V.                  | 35,849    | 41.40  | 1,484,148.60  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  | 17,261    | 45.19  | 780,024.59    |
| SANOFI                       | 181,423   | 81.90  | 14,858,543.70 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH     | 4,310     | 360.60 | 1,554,186.00  |
| UCB SA                       | 20,162    | 78.88  | 1,590,378.56  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         | 75,399    | 10.33  | 778,871.67    |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 1,077,599 | 4.39   | 4,736,047.60  |
| BANCO SANTANDER SA           | 2,771,202 | 2.87   | 7,974,133.75  |
| BNP PARIBAS                  | 180,123   | 51.12  | 9,207,887.76  |
| CAIXABANK SA                 | 578,822   | 2.60   | 1,507,252.48  |
| COMMERZBANK AG               | 161,446   | 5.36   | 865,350.56    |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 184,965   | 12.06  | 2,231,602.72  |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 42,718    | 29.27  | 1,250,355.86  |
| FINECOBANK SPA               | 98,210    | 14.01  | 1,376,413.15  |
| ING GROEP NV                 | 628,209   | 10.17  | 6,388,885.53  |
| INTESA SANPAOLO              | 2,660,716 | 2.29   | 6,107,673.57  |
| KBC GROUP NV                 | 41,035    | 62.28  | 2,555,659.80  |
| MEDIOBANCA SPA               | 104,907   | 9.46   | 992,630.03    |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 26,632    | 18.38  | 489,496.16    |
| SOCIETE GENERALE SA          | 127,787   | 22.11  | 2,825,370.57  |
| UNICREDIT SPA                | 336,890   | 9.08   | 3,061,319.43  |
| AMUNDI SA                    | 10,517    | 67.20  | 706,742.40    |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 312,616   | 10.61  | 3,318,106.22  |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 30,626    | 136.30 | 4,174,323.80  |
| EURAZEO SE                   | 7,132     | 65.95  | 470,355.40    |
| EXOR NV                      | 16,728    | 71.40  | 1,194,379.20  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 17,656    | 88.20  | 1,557,259.20  |
| NATIXIS                      | 139,223   | 4.04   | 562,460.92    |
| SOFINA                       | 2,674     | 287.50 | 768,775.00    |
| WENDEL                       | 4,862     | 103.00 | 500,786.00    |
| AEGON NV                     | 283,341   | 3.92   | 1,113,246.78  |



|                              |           |          |               |
|------------------------------|-----------|----------|---------------|
| AGEAS                        | 28,346    | 49.67    | 1,407,945.82  |
| ALLIANZ SE-REG               | 66,038    | 212.55   | 14,036,376.90 |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 180,355   | 16.89    | 3,046,195.95  |
| AXA SA                       | 311,185   | 22.51    | 7,006,330.27  |
| CNP ASSURANCES               | 31,208    | 16.10    | 502,448.80    |
| HANNOVER RUECK SE            | 9,774     | 153.90   | 1,504,218.60  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 22,632    | 261.20   | 5,911,478.40  |
| NN GROUP NV                  | 47,538    | 40.88    | 1,943,353.44  |
| POSTE ITALIANE SPA           | 87,776    | 10.47    | 919,014.72    |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 76,153    | 36.73    | 2,797,099.69  |
| SCOR SE                      | 27,160    | 29.84    | 810,454.40    |
| AROUNDTOWN SA                | 170,559   | 6.22     | 1,061,218.09  |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           | 56,738    | 40.41    | 2,292,782.58  |
| LEG IMMOBILIEN SE            | 12,018    | 113.90   | 1,368,850.20  |
| VONOVIA SE                   | 86,580    | 56.00    | 4,848,480.00  |
| ADYEN NV                     | 2,919     | 1,896.00 | 5,534,424.00  |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 71,410    | 58.20    | 4,156,062.00  |
| ATOS SE                      | 16,434    | 64.00    | 1,051,776.00  |
| BECHTLE AG                   | 4,126     | 159.80   | 659,334.80    |
| CAPGEMINI SE                 | 26,012    | 142.05   | 3,695,004.60  |
| DASSAULT SYSTEMES SE         | 21,436    | 180.20   | 3,862,767.20  |
| EDEXRED                      | 39,271    | 44.61    | 1,751,879.31  |
| NEMETSCHEK SE                | 8,419     | 54.50    | 458,835.50    |
| NEXI SPA                     | 74,508    | 15.01    | 1,118,737.62  |
| SAP SE                       | 168,262   | 102.82   | 17,300,698.84 |
| TEAMVIEWER AG                | 25,425    | 36.73    | 933,860.25    |
| WORLDLINE SA                 | 37,901    | 70.84    | 2,684,906.84  |
| NOKIA OYJ                    | 901,868   | 3.38     | 3,052,823.18  |
| CELLNEX TELECOM SA           | 51,936    | 44.94    | 2,334,003.84  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      | 533,493   | 16.72    | 8,922,670.42  |
| ELISA OYJ                    | 23,784    | 52.32    | 1,244,378.88  |
| ILIAD SA                     | 2,776     | 159.40   | 442,494.40    |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 47,802    | 9.30     | 444,558.60    |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 561,774   | 2.88     | 1,622,965.08  |
| ORANGE                       | 323,647   | 10.42    | 3,374,019.97  |
| PROXIMUS                     | 26,824    | 17.95    | 481,490.80    |
| TELECOM ITALIA SPA           | 1,422,555 | 0.43     | 615,112.78    |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 847,742   | 0.47     | 399,456.03    |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 168,220   | 2.37     | 399,017.84    |
| TELEFONICA SA                | 796,377   | 4.00     | 3,187,897.13  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 18,896    | 35.50    | 670,808.00    |
| E.ON SE                      | 352,753   | 9.15     | 3,227,689.95  |

|                              |             |        |                                      |  |
|------------------------------|-------------|--------|--------------------------------------|--|
| EDF                          | 99,950      | 11.29  | 1,128,435.50                         |  |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 434,518     | 4.90   | 2,130,007.23                         |  |
| ELIA GROUP SA/NV             | 5,662       | 89.80  | 508,447.60                           |  |
| ENAGAS SA                    | 42,336      | 18.40  | 778,982.40                           |  |
| ENDESA SA                    | 52,405      | 22.30  | 1,168,631.50                         |  |
| ENEL SPA                     | 1,302,620   | 8.42   | 10,975,876.12                        |  |
| ENGIE                        | 288,864     | 11.96  | 3,456,257.76                         |  |
| FORTUM OYJ                   | 70,476      | 22.87  | 1,611,786.12                         |  |
| IBERDROLA SA                 | 987,314     | 10.92  | 10,786,405.45                        |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 47,043      | 20.92  | 984,139.56                           |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 71,520      | 14.48  | 1,035,967.20                         |  |
| RWE AG                       | 101,468     | 32.54  | 3,301,768.72                         |  |
| SNAM SPA                     | 334,118     | 4.66   | 1,557,658.11                         |  |
| SUEZ                         | 55,054      | 18.15  | 999,230.10                           |  |
| TERNA SPA                    | 231,929     | 6.32   | 1,467,646.71                         |  |
| UNIPER SE                    | 31,628      | 31.12  | 984,263.36                           |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 86,891      | 21.59  | 1,875,976.69                         |  |
| VERBUND AG                   | 11,251      | 61.50  | 691,936.50                           |  |
| ASM INTERNATIONAL NV         | 7,619       | 228.00 | 1,737,132.00                         |  |
| ASML HOLDING NV              | 68,531      | 492.20 | 33,730,958.20                        |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 208,994     | 34.45  | 7,200,888.27                         |  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 100,694     | 31.25  | 3,146,687.50                         |  |
| ユーロ 小計                       | 30,025,803  |        | 711,837,594.87<br>(91,577,906,580)   |  |
| 合 計                          | 175,893,667 |        | 837,953,318,557<br>(837,953,318,557) |  |

(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<br>ドル | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 21,698 | 3,612,717.00  |    |
|            |      | AMERICAN TOWER CORP          | 71,698 | 16,275,446.00 |    |
|            |      | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 22,847 | 4,223,267.95  |    |
|            |      | BOSTON PROPERTIES INC        | 23,547 | 2,419,454.25  |    |
|            |      | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 15,886 | 1,741,264.46  |    |
|            |      | CROWN CASTLE INTL CORP       | 69,032 | 11,575,285.76 |    |
|            |      | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 45,086 | 6,316,097.74  |    |
|            |      | DUKE REALTY CORP             | 59,699 | 2,506,761.01  |    |
|            |      | EQUINIX INC                  | 14,402 | 9,539,020.68  |    |

|              |        |                              |           |                                    |  |
|--------------|--------|------------------------------|-----------|------------------------------------|--|
|              |        | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 27,812    | 1,780,802.36                       |  |
|              |        | EQUITY RESIDENTIAL           | 60,749    | 4,345,375.97                       |  |
|              |        | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 10,322    | 2,851,865.38                       |  |
|              |        | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 20,858    | 2,731,772.26                       |  |
|              |        | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 84,689    | 2,654,153.26                       |  |
|              |        | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 113,592   | 1,939,015.44                       |  |
|              |        | INVITATION HOMES INC         | 92,032    | 2,862,195.20                       |  |
|              |        | IRON MOUNTAIN INC            | 48,019    | 1,750,772.74                       |  |
|              |        | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 94,870    | 2,017,884.90                       |  |
|              |        | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 18,548    | 2,677,032.84                       |  |
|              |        | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 37,887    | 1,384,769.85                       |  |
|              |        | PROLOGIS INC                 | 118,345   | 12,286,577.90                      |  |
|              |        | PUBLIC STORAGE               | 25,393    | 6,123,268.02                       |  |
|              |        | REALTY INCOME CORP           | 56,744    | 3,587,923.12                       |  |
|              |        | REGENCY CENTERS CORP         | 26,020    | 1,441,508.00                       |  |
|              |        | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 17,631    | 4,803,742.26                       |  |
|              |        | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 52,576    | 5,751,814.40                       |  |
|              |        | SUN COMMUNITIES INC          | 17,306    | 2,583,439.68                       |  |
|              |        | UDR INC                      | 45,807    | 1,992,604.50                       |  |
|              |        | VENTAS INC                   | 60,629    | 3,250,926.98                       |  |
|              |        | VEREIT INC                   | 36,245    | 1,382,746.75                       |  |
|              |        | VICI PROPERTIES INC          | 83,849    | 2,258,053.57                       |  |
|              |        | VORNADO REALTY TRUST         | 26,516    | 1,198,258.04                       |  |
|              |        | WELLTOWER INC                | 67,418    | 4,798,813.24                       |  |
|              |        | WEYERHAEUSER CO              | 117,838   | 3,984,102.78                       |  |
| WP CAREY INC | 28,536 | 1,972,122.96                 |           |                                    |  |
| アメリカドル合計     |        |                              | 1,734,126 | 142,620,857.25<br>(15,528,558,937) |  |
| カナダドル        | 投資証券   | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 14,900    | 809,368.00                         |  |
|              |        | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 30,800    | 599,368.00                         |  |
| カナダドル合計      |        |                              | 45,700    | 1,408,736.00<br>(121,982,450)      |  |
| オーストラリアドル    | 投資証券   | DEXUS                        | 172,849   | 1,647,250.97                       |  |
|              |        | GOODMAN GROUP                | 262,866   | 4,739,473.98                       |  |
|              |        | GPT GROUP                    | 311,121   | 1,428,045.39                       |  |
|              |        | MIRVAC GROUP                 | 610,283   | 1,489,090.52                       |  |
|              |        | SCENTRE GROUP                | 825,910   | 2,370,361.70                       |  |
|              |        | STOCKLAND                    | 364,901   | 1,609,213.41                       |  |
|              |        | VICINITY CENTRES             | 685,696   | 1,124,541.44                       |  |
| オーストラリアドル合計  |        |                              | 3,233,626 | 14,407,977.41<br>(1,191,395,652)   |  |
|              | 投資証券   | BRITISH LAND CO PLC          | 132,156   | 679,546.15                         |  |

有価証券届出書（内国投資信託）

|                  |      |                              |           |                                    |  |
|------------------|------|------------------------------|-----------|------------------------------------|--|
| イギリス<br>ポンド      |      | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 120,755   | 841,541.59                         |  |
|                  |      | SEGRO PLC                    | 187,002   | 1,736,126.56                       |  |
| イギリスポンド合計        |      |                              | 439,913   | 3,257,214.30<br>(485,552,935)      |  |
| 香港ドル             | 投資証券 | LINK REIT                    | 335,300   | 23,420,705.00                      |  |
| 香港ドル合計           |      |                              | 335,300   | 23,420,705.00<br>(328,358,284)     |  |
| シンガ<br>ポールド<br>ル | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 481,500   | 1,449,315.00                       |  |
|                  |      | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 763,500   | 1,618,620.00                       |  |
|                  |      | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 383,600   | 801,724.00                         |  |
|                  |      | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 478,000   | 912,980.00                         |  |
|                  |      | SUNTEC REIT                  | 254,700   | 387,144.00                         |  |
| シンガポールドル合計       |      |                              | 2,361,300 | 5,169,783.00<br>(418,235,444)      |  |
| ユーロ              | 投資証券 | COVIVIO                      | 9,200     | 662,860.00                         |  |
|                  |      | GECINA SA                    | 7,182     | 865,431.00                         |  |
|                  |      | KLEPIERRE                    | 28,639    | 573,639.17                         |  |
|                  |      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 22,777    | 1,539,725.20                       |  |
| ユーロ合計            |      |                              | 67,798    | 3,641,655.37<br>(468,498,963)      |  |
| 合計               |      |                              |           | 18,542,582,665<br>(18,542,582,665) |  |

(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<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-----------|-----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル    | 株式 595銘柄  | 97.47%       | —              | 69.97%                  |
|           | 投資証券 35銘柄 | —            | 2.53%          | 1.81%                   |
| カナダドル     | 株式 87銘柄   | 99.60%       | —              | 3.56%                   |
|           | 投資証券 2銘柄  | —            | 0.40%          | 0.01%                   |
| オーストラリアドル | 株式 58銘柄   | 94.04%       | —              | 2.19%                   |
|           | 投資証券 7銘柄  | —            | 5.96%          | 0.14%                   |
| イギリスポンド   | 株式 85銘柄   | 98.80%       | —              | 4.67%                   |
|           | 投資証券 3銘柄  | —            | 1.20%          | 0.06%                   |
| スイスフラン    | 株式 40銘柄   | 100.00%      | —              | 3.08%                   |
| 香港ドル      | 株式 33銘柄   | 96.30%       | —              | 1.00%                   |
|           | 投資証券 1銘柄  | —            | 3.70%          | 0.04%                   |
| シンガポールドル  | 株式 14銘柄   | 86.50%       | —              | 0.31%                   |
|           | 投資証券 5銘柄  | —            | 13.50%         | 0.05%                   |

|            |      |       |         |       |        |
|------------|------|-------|---------|-------|--------|
| ニュージーランドドル | 株式   | 7銘柄   | 100.00% | —     | 0.09%  |
| スウェーデンクローネ | 株式   | 38銘柄  | 100.00% | —     | 1.21%  |
| ノルウェークローネ  | 株式   | 11銘柄  | 100.00% | —     | 0.21%  |
| デンマーククローネ  | 株式   | 19銘柄  | 100.00% | —     | 0.76%  |
| イスラエルシェケル  | 株式   | 8銘柄   | 100.00% | —     | 0.10%  |
| ユーロ        | 株式   | 233銘柄 | 99.49%  | —     | 10.69% |
|            | 投資証券 | 4銘柄   | —       | 0.51% | 0.05%  |

## 第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

## 新興国株式インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 3月25日現在]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| 預金          | 5,547,117,273   |
| コール・ローン     | 566,249,533     |
| 株式          | 196,269,499,593 |
| 投資証券        | 161,404,803     |
| 派生商品評価勘定    | 289,382         |
| 未収配当金       | 485,999,987     |
| 差入委託証拠金     | 1,182,024,378   |
| 流動資産合計      | 204,212,584,949 |
| 資産合計        | 204,212,584,949 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 派生商品評価勘定    | 327,574,736     |
| 未払金         | 15,354          |
| 未払解約金       | 366,305,417     |
| 未払利息        | 98              |
| 流動負債合計      | 693,895,605     |
| 負債合計        | 693,895,605     |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 65,349,738,535  |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（△） | 138,168,950,809 |
| 元本等合計       | 203,518,689,344 |
| 純資産合計       | 203,518,689,344 |
| 負債純資産合計     | 204,212,584,949 |

### 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。<br>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。<br>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。<br>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<br>「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 3年 3月25日現在] |
|------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                        | 令和 2年 3月26日     |
| 期首元本額                        | 45,619,307,653円 |
| 期中追加設定元本額                    | 27,612,441,563円 |
| 期中一部解約元本額                    | 7,882,010,681円  |
| 元本の内訳※                       |                 |
| MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信    | 206,819,714円    |
| eMAXIS 新興国株式インデックス           | 11,684,127,491円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）          | 1,307,795,765円  |
| eMAXIS バランス（波乗り型）            | 156,706,639円    |
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）  | 331,997,836円    |
| コアバランス                       | 106,990円        |
| 海外株式セレクション（ラップ向け）            | 103,470,305円    |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）     | 3,260,496,071円  |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス      | 18,177,591,070円 |
| つみたて新興国株式                    | 3,214,658,812円  |
| つみたて8資産均等バランス                | 1,511,101,451円  |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s        | 581,816円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s        | 959,176円        |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s        | 2,056,100円      |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）      | 2,185,125,358円  |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）    | 339,046,168円    |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー） | 5,384,944,709円  |
| 新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）      | 1,116,297,618円  |
| つみたて全世界株式                    | 2,139,612円      |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド      | 12,134,028,218円 |

|                                  | [令和 3年 3月25日現在] |
|----------------------------------|-----------------|
| 新興国株式インデックスオープン                  | 410,735,999円    |
| eMAXIS 全世界株式インデックス               | 534,816,591円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）       | 720,392,600円    |
| 新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）           | 867,022円        |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）        | 22,703,433円     |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）       | 130,619,683円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）          | 112,650,255円    |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）         | 460,643,380円    |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）  | 1,496,431,465円  |
| アドバンスト・バランスⅠ（FOFs用）（適格機関投資家限定）   | 2,287,022円      |
| アドバンスト・バランスⅡ（FOFs用）（適格機関投資家限定）   | 8,405,259円      |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）       | 11,667,391円     |
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定） | 62,528,265円     |
| MUKAM バランスファンド2020-04（適格機関投資家限定） | 67,287,767円     |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 63,166,573円     |
| MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定） | 62,842,560円     |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 61,642,351円     |
| 合計                               | 65,349,738,535円 |
| 2. 受益権の総数                        | 65,349,738,535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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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 | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [令和 3年 3月25日現在]    |  |
|------|--------------------|--|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |  |
| 株式   | 41,733,995,162     |  |
| 投資証券 | 16,490,314         |  |
| 合計   | 41,750,485,476     |  |

（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 3年 3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<br>買建 | 7,214,426,364 | —     | 6,886,851,628 | △327,574,736 |
| 合計   |                | 7,214,426,364 | —     | 6,886,851,628 | △327,574,736 |

## （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 3年 3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<br>の取引 | 為替予約取引<br>買建 |             |       |             |         |
|               | アメリカドル       | 133,842,755 | —     | 134,127,840 | 285,085 |
|               | 売建           |             |       |             |         |
|               | アメリカドル       | 68,810,137  | —     | 68,805,840  | 4,297   |
| 合計            |              | 202,652,892 | —     | 202,933,680 | 289,382 |

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （１口当たり情報）

|              | [令和 3年 3月25日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 3.1143円         |
| (1万口当たり純資産額) | (31,143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        | 1,297,152 | 5.87   | 7,616,876.54 |    |
|        | LUKOIL PJSC-SPON ADR         | 89,498    | 81.30  | 7,276,187.40 |    |
|        | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 21,179    | 199.40 | 4,223,092.60 |    |
|        | ROSNEFT OIL CO PJSC          | 270,830   | 7.51   | 2,033,933.54 |    |
|        | SURGUTNEFTEGAS PJSC          | 1,618,400 | 0.45   | 733,341.22   |    |
|        | SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE    | 1,923,900 | 0.53   | 1,026,499.92 |    |
|        | TATNEFT PJSC                 | 334,682   | 8.01   | 2,682,406.58 |    |
|        | YPF S.A.-SPONSORED ADR       | 45,994    | 4.10   | 188,575.40   |    |
|        | ALROSA PJSC                  | 614,570   | 1.39   | 858,449.69   |    |
|        | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 49,646    | 10.20  | 506,389.20   |    |
|        | MMC NORILSK NICKEL PJSC      | 14,802    | 281.91 | 4,172,973.19 |    |
|        | NOVOLIPETSK STEEL PJSC       | 284,070   | 2.85   | 811,393.23   |    |
|        | PHOSAGRO PJSC-GDR REG S      | 34,870    | 17.34  | 604,645.80   |    |
|        | POLYUS PJSC-REG S-GDR        | 14,471    | 91.75  | 1,327,714.25 |    |

|                              |             |        |               |
|------------------------------|-------------|--------|---------------|
| SEVERSTAL PJSC               | 50,752      | 18.50  | 939,391.30    |
| SOUTHERN COPPER CORP         | 20,582      | 67.48  | 1,388,873.36  |
| 51JOB INC-ADR                | 5,658       | 62.33  | 352,663.14    |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR   | 96,624      | 27.67  | 2,673,586.08  |
| LI AUTO INC - ADR            | 40,666      | 22.89  | 930,844.74    |
| NIO INC - ADR                | 291,284     | 36.96  | 10,765,856.64 |
| XPENG INC - ADR              | 41,630      | 30.85  | 1,284,285.50  |
| GSX TECHEDU INC- ADR         | 16,779      | 69.50  | 1,166,140.50  |
| HUAZHU GROUP LTD-ADR         | 37,633      | 53.10  | 1,998,312.30  |
| NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 335,890     | 15.57  | 5,229,807.30  |
| TAL EDUCATION GROUP- ADR     | 86,545      | 61.08  | 5,286,168.60  |
| YUM CHINA HOLDINGS INC       | 91,728      | 60.29  | 5,530,281.12  |
| AUTOHOME INC-ADR             | 12,836      | 99.07  | 1,271,662.52  |
| BAIDU INC - SPON ADR         | 61,328      | 239.19 | 14,669,044.32 |
| BILIBILI INC-SPONSORED ADR   | 27,625      | 95.70  | 2,643,712.50  |
| DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR | 18,300      | 11.64  | 213,012.00    |
| HUYA INC-ADR                 | 20,986      | 21.20  | 444,903.20    |
| IQIYI INC-ADR                | 63,172      | 23.17  | 1,463,695.24  |
| JOYY INC                     | 13,170      | 108.39 | 1,427,496.30  |
| MAIL.RU GROUP-GDR REGS       | 26,189      | 22.96  | 601,534.61    |
| MOMO INC-SPON ADR            | 32,727      | 14.54  | 475,850.58    |
| NETEASE INC-ADR              | 94,538      | 102.69 | 9,708,107.22  |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 82,480      | 23.18  | 1,911,886.40  |
| WEIBO CORP-SPON ADR          | 12,479      | 51.03  | 636,803.37    |
| YANDEX NV-A                  | 65,200      | 63.06  | 4,111,512.00  |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 430,660     | 229.59 | 98,875,229.40 |
| BAOZUN INC-SPN ADR           | 12,650      | 36.50  | 461,725.00    |
| JD.COM INC-ADR               | 196,428     | 79.07  | 15,531,561.96 |
| PINDUODUO INC-ADR            | 89,388      | 124.18 | 11,100,201.84 |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR       | 109,294     | 37.89  | 4,141,149.66  |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR   | 101,743     | 35.81  | 3,643,416.83  |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    | 89,898      | 14.89  | 1,338,581.22  |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 28,003      | 31.74  | 888,815.22    |
| RLX TECHNOLOGY INC-ADR       | 25,215      | 8.94   | 225,422.10    |
| BEIGENE LTD-ADR              | 10,727      | 320.62 | 3,439,290.74  |
| HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR | 16,179      | 27.01  | 436,994.79    |
| ZAI LAB LTD-ADR              | 16,642      | 126.27 | 2,101,385.34  |
| COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 351,231     | 3.76   | 1,322,384.71  |
| CREDICORP LTD                | 15,028      | 138.75 | 2,085,135.00  |
| SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 578,028     | 15.10  | 8,728,222.80  |
| TCS GROUP HOLDING-GDR REG S  | 27,500      | 56.70  | 1,559,250.00  |
| VTB BANK PJSC                | 881,970,000 | 0.00   | 441,602.37    |

|         |                              |             |        |                                    |  |
|---------|------------------------------|-------------|--------|------------------------------------|--|
|         | LUFAX HOLDING LTD            | 34,853      | 13.56  | 472,606.68                         |  |
|         | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 332,890     | 2.21   | 736,352.11                         |  |
|         | NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS   | 7,365       | 43.33  | 319,125.45                         |  |
|         | KE HOLDINGS INC              | 27,489      | 52.81  | 1,451,694.09                       |  |
|         | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 196,860     | 0.88   | 174,614.82                         |  |
|         | 21VIANET GROUP INC-ADR       | 18,950      | 28.08  | 532,116.00                         |  |
|         | GDS HOLDINGS LTD - ADR       | 21,569      | 81.24  | 1,752,265.56                       |  |
|         | GLOBANT SA                   | 8,556       | 208.98 | 1,788,032.88                       |  |
|         | KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR  | 13,811      | 40.65  | 561,417.15                         |  |
|         | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    | 105,567     | 8.15   | 860,371.05                         |  |
|         | TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR  | 14,804      | 5.47   | 80,977.88                          |  |
|         | INTER RAO UES PJSC           | 8,865,000   | 0.06   | 589,855.82                         |  |
|         | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR     | 11,620      | 66.09  | 767,965.80                         |  |
|         | アメリカドル 小計                    | 901,988,813 |        | 277,595,673.67<br>(30,224,616,949) |  |
| イギリスポンド | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC  | 50,863      | 14.43  | 734,207.40                         |  |
|         | イギリスポンド 小計                   | 50,863      |        | 734,207.40<br>(109,448,297)        |  |
| 香港ドル    | CHINA OILFIELD SERVICES-H    | 394,000     | 7.51   | 2,958,940.00                       |  |
|         | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 5,514,000   | 3.98   | 21,945,720.00                      |  |
|         | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 832,500     | 14.30  | 11,904,750.00                      |  |
|         | PETROCHINA CO LTD-H          | 4,843,000   | 2.78   | 13,463,540.00                      |  |
|         | YANZHOU COAL MINING CO-H     | 486,000     | 7.90   | 3,839,400.00                       |  |
|         | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 858,000     | 3.09   | 2,651,220.00                       |  |
|         | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 311,500     | 49.40  | 15,388,100.00                      |  |
|         | CHINA HONGQIAO GROUP LTD     | 391,000     | 9.84   | 3,847,440.00                       |  |
|         | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H    | 321,000     | 4.45   | 1,428,450.00                       |  |
|         | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 966,000     | 10.26  | 9,911,160.00                       |  |
|         | CHINA RESOURCES CEMENT       | 686,000     | 8.53   | 5,851,580.00                       |  |
|         | JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 321,000     | 14.14  | 4,538,940.00                       |  |
|         | LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN | 247,000     | 6.92   | 1,709,240.00                       |  |
|         | NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS  | 392,000     | 11.08  | 4,343,360.00                       |  |
|         | SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 155,250     | 15.00  | 2,328,750.00                       |  |
|         | ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H  | 242,500     | 7.24   | 1,755,700.00                       |  |
|         | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 1,342,000   | 9.25   | 12,413,500.00                      |  |
|         | AVICHINA INDUSTRY & TECH-H   | 557,000     | 4.70   | 2,617,900.00                       |  |
|         | BOC AVIATION LTD             | 49,100      | 73.00  | 3,584,300.00                       |  |
|         | CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 654,000     | 3.42   | 2,236,680.00                       |  |
|         | CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 371,500     | 36.30  | 13,485,450.00                      |  |
|         | CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L | 228,000     | 15.66  | 3,570,480.00                       |  |
|         | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 1,124,000   | 4.01   | 4,507,240.00                       |  |
|         | CITIC LTD                    | 1,338,000   | 6.62   | 8,857,560.00                       |  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      | 548,000   | 10.60  | 5,808,800.00  |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS  | 141,000   | 29.30  | 4,131,300.00  |
| SINOTRUK HONG KONG LTD       | 153,500   | 21.90  | 3,361,650.00  |
| WEICHAI POWER CO LTD-H       | 314,800   | 19.80  | 6,233,040.00  |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H  | 156,800   | 14.74  | 2,311,232.00  |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H | 127,400   | 31.60  | 4,025,840.00  |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H  | 322,400   | 10.54  | 3,398,096.00  |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES | 95,250    | 32.15  | 3,062,287.50  |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 942,111   | 5.11   | 4,814,187.21  |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 324,000   | 72.20  | 23,392,800.00 |
| EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV | 154,000   | 17.16  | 2,642,640.00  |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 316,000   | 8.29   | 2,619,640.00  |
| AIR CHINA LTD-H              | 466,000   | 6.43   | 2,996,380.00  |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 406,000   | 6.06   | 2,460,360.00  |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 324,000   | 11.44  | 3,706,560.00  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 280,000   | 5.50   | 1,540,000.00  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 588,500   | 8.49   | 4,996,365.00  |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD     | 360,000   | 6.05   | 2,178,000.00  |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H     | 268,000   | 8.94   | 2,395,920.00  |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS       | 249,500   | 12.48  | 3,113,760.00  |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H     | 332,000   | 6.56   | 2,177,920.00  |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE  | 708,000   | 6.71   | 4,750,680.00  |
| BYD CO LTD-H                 | 172,500   | 168.20 | 29,014,500.00 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 580,000   | 7.05   | 4,089,000.00  |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 121,600   | 39.90  | 4,851,840.00  |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 1,361,000 | 19.90  | 27,083,900.00 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H   | 722,500   | 18.94  | 13,684,150.00 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 642,945   | 6.75   | 4,339,878.75  |
| MINTH GROUP LTD              | 174,000   | 31.15  | 5,420,100.00  |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD     | 248,000   | 16.28  | 4,037,440.00  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 251,000   | 111.90 | 28,086,900.00 |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD      | 804,000   | 3.27   | 2,629,080.00  |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H    | 436,200   | 29.25  | 12,758,850.00 |
| LI NING CO LTD               | 498,000   | 45.15  | 22,484,700.00 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 193,000   | 158.90 | 30,667,700.00 |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDING | 104,500   | 15.64  | 1,634,380.00  |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN | 178,000   | 14.24  | 2,534,720.00  |
| CHINA YUHUA EDUCATION CORP L | 292,000   | 5.92   | 1,728,640.00  |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 193,000   | 53.40  | 10,306,200.00 |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 149,000   | 28.60  | 4,261,400.00  |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING  | 75,000    | 17.64  | 1,323,000.00  |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD   | 2,400,000 | 0.98   | 2,352,000.00  |

|                              |           |        |                |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| CHINA LITERATURE LTD         | 65,800    | 76.05  | 5,004,090.00   |
| KUAISHOU TECHNOLOGY          | 44,600    | 265.00 | 11,819,000.00  |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 1,307,600 | 623.50 | 815,288,600.00 |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS  | 128,000   | 35.50  | 4,544,000.00   |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD     | 2,222,000 | 1.42   | 3,155,240.00   |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC  | 64,450    | 103.80 | 6,689,910.00   |
| MEITUAN-CLASS B              | 819,100   | 292.00 | 239,177,200.00 |
| TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD | 195,200   | 16.12  | 3,146,624.00   |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 299,000   | 12.62  | 3,773,380.00   |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS    | 123,000   | 53.00  | 6,519,000.00   |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD     | 449,500   | 6.70   | 3,011,650.00   |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 28,500    | 103.50 | 2,949,750.00   |
| CHINA FEIHE LTD              | 271,000   | 20.75  | 5,623,250.00   |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS | 372,000   | —      | —              |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO       | 647,000   | 41.85  | 27,076,950.00  |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 326,000   | 58.65  | 19,119,900.00  |
| DALI FOODS GROUP CO LTD      | 498,500   | 4.53   | 2,258,205.00   |
| NONGFU SPRING CO LTD-H       | 68,400    | 39.00  | 2,667,600.00   |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 144,000   | 49.00  | 7,056,000.00   |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 512,000   | 13.92  | 7,127,040.00   |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H    | 106,000   | 66.60  | 7,059,600.00   |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 301,000   | 9.93   | 2,988,930.00   |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 1,135,000 | 5.91   | 6,707,850.00   |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING  | 101,000   | 89.00  | 8,989,000.00   |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD     | 151,500   | 51.30  | 7,771,950.00   |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 101,000   | 24.00  | 2,424,000.00   |
| AK MEDICAL HOLDINGS LTD      | 66,000    | 9.76   | 644,160.00     |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 944,000   | 22.25  | 21,004,000.00  |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD   | 338,000   | 15.20  | 5,137,600.00   |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP    | 156,000   | 39.25  | 6,123,000.00   |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 112,000   | 96.40  | 10,796,800.00  |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 644,000   | 13.18  | 8,487,920.00   |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H   | 265,300   | 14.54  | 3,857,462.00   |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 291,200   | 19.00  | 5,532,800.00   |
| 3SBIO INC                    | 333,500   | 7.01   | 2,337,835.00   |
| CANSINO BIOLOGICS INC-H      | 15,600    | 268.20 | 4,183,920.00   |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 281,000   | 15.62  | 4,389,220.00   |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 560,000   | 5.07   | 2,839,200.00   |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 596,000   | 4.57   | 2,723,720.00   |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 2,003,840 | 9.01   | 18,054,598.40  |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP       | 314,000   | 13.88  | 4,358,320.00   |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H | 26,500    | 140.00 | 3,710,000.00   |

|                              |            |        |                |
|------------------------------|------------|--------|----------------|
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP  | 254,000    | 35.45  | 9,004,300.00   |
| INNOVENT BIOLOGICS INC       | 231,500    | 70.60  | 16,343,900.00  |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-H   | 30,200     | 123.00 | 3,714,600.00   |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 115,000    | 32.50  | 3,737,500.00   |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL       | 2,314,500  | 7.98   | 18,469,710.00  |
| SSY GROUP LTD                | 328,000    | 4.46   | 1,462,880.00   |
| WUXI APPTTEC CO LTD-H        | 62,884     | 139.80 | 8,791,183.20   |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC    | 744,000    | 87.95  | 65,434,800.00  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 6,687,000  | 3.15   | 21,064,050.00  |
| BANK OF CHINA LTD-H          | 18,506,000 | 2.89   | 53,482,340.00  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H  | 1,990,900  | 4.59   | 9,138,231.00   |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD-H    | 541,500    | 2.93   | 1,586,595.00   |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H  | 1,982,000  | 3.84   | 7,610,880.00   |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 21,994,550 | 6.40   | 140,765,120.00 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 626,000    | 3.38   | 2,115,880.00   |
| CHINA MERCHANTS BANK-H       | 850,550    | 61.10  | 51,968,605.00  |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 1,458,320  | 4.93   | 7,189,517.60   |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 981,000    | 3.53   | 3,462,930.00   |
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 13,945,350 | 5.39   | 75,165,436.50  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 2,068,000  | 5.79   | 11,973,720.00  |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 2,271,000  | 1.57   | 3,565,470.00   |
| CHINA EVERBRIGHT LTD         | 270,000    | 9.99   | 2,697,300.00   |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 784,500    | 4.61   | 3,616,545.00   |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H | 2,024,000  | 0.95   | 1,922,800.00   |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 260,800    | 17.54  | 4,574,432.00   |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H    | 506,500    | 16.28  | 8,245,820.00   |
| FAR EAST HORIZON LTD         | 513,000    | 8.84   | 4,534,920.00   |
| GF SECURITIES CO LTD-H       | 303,000    | 10.90  | 3,302,700.00   |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H  | 650,800    | 7.09   | 4,614,172.00   |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H   | 354,200    | 11.44  | 4,052,048.00   |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H    | 1,716,000  | 16.08  | 27,593,280.00  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 562,400    | 30.35  | 17,068,840.00  |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 353,400    | 15.56  | 5,498,904.00   |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 184,400    | 28.60  | 5,273,840.00   |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 2,258,000  | 2.48   | 5,599,840.00   |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 1,556,000  | 6.20   | 9,647,200.00   |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 1,372,500  | 93.15  | 127,848,375.00 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 80,200     | 44.60  | 3,576,920.00   |
| AGILE GROUP HOLDINGS LTD     | 270,000    | 12.16  | 3,283,200.00   |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD       | 264,000    | 7.25   | 1,914,000.00   |
| CHINA EVERGRANDE GROUP       | 457,000    | 14.92  | 6,818,440.00   |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP  | 1,588,000  | 3.10   | 4,922,800.00   |

|                              |            |        |               |
|------------------------------|------------|--------|---------------|
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 863,500    | 20.80  | 17,960,800.00 |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 390,000    | 5.71   | 2,226,900.00  |
| CHINA RESOURCES LAND LTD     | 740,000    | 38.10  | 28,194,000.00 |
| CHINA VANKE CO LTD-H         | 366,951    | 31.15  | 11,430,523.65 |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD   | 848,000    | 7.20   | 6,105,600.00  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 1,794,232  | 9.41   | 16,883,723.12 |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS     | 164,500    | 9.91   | 1,630,195.00  |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 336,000    | 10.64  | 3,575,040.00  |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS  | 124,000    | 25.65  | 3,180,600.00  |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD     | 567,000    | 3.99   | 2,262,330.00  |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD       | 245,500    | 12.56  | 3,083,480.00  |
| LOGAN GROUP CO LTD           | 270,000    | 12.00  | 3,240,000.00  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD   | 412,000    | 46.05  | 18,972,600.00 |
| POLY PROPERTY SERVICES CO LT | 20,400     | 49.95  | 1,018,980.00  |
| SEAZEN GROUP LTD             | 478,000    | 9.18   | 4,388,040.00  |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD      | 542,000    | 2.65   | 1,436,300.00  |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD    | 314,000    | 25.55  | 8,022,700.00  |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD     | 597,000    | 32.80  | 19,581,600.00 |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 343,000    | 19.96  | 6,846,280.00  |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD       | 1,500,000  | 1.73   | 2,595,000.00  |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD  | 386,000    | 5.20   | 2,007,200.00  |
| CHINA YOUZAN LTD             | 2,972,000  | 2.34   | 6,954,480.00  |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR  | 542,000    | 25.75  | 13,956,500.00 |
| KINGSOFT CORP LTD            | 205,000    | 49.75  | 10,198,750.00 |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN | 89,000     | 36.15  | 3,217,350.00  |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H   | 211,000    | 18.54  | 3,911,940.00  |
| WEIMOB INC                   | 357,000    | 16.56  | 5,911,920.00  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 191,000    | 40.10  | 7,659,100.00  |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD   | 150,500    | 40.70  | 6,125,350.00  |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD       | 150,500    | 36.25  | 5,455,625.00  |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 232,500    | 15.34  | 3,566,550.00  |
| LENOVO GROUP LTD             | 1,616,000  | 9.72   | 15,707,520.00 |
| SUNNY OPTICAL TECH           | 166,500    | 168.20 | 28,005,300.00 |
| XIAOMI CORP-CLASS B          | 3,037,200  | 25.00  | 75,930,000.00 |
| ZTE CORP-H                   | 186,531    | 19.86  | 3,704,505.66  |
| CHINA TOWER CORP LTD-H       | 10,292,000 | 1.14   | 11,732,880.00 |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    | 131,500    | 26.80  | 3,524,200.00  |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 1,084,000  | 3.12   | 3,382,080.00  |
| CGN POWER CO LTD-H           | 2,425,000  | 1.86   | 4,510,500.00  |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD       | 583,600    | 31.05  | 18,120,780.00 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 738,000    | 9.60   | 7,084,800.00  |
| CHINA POWER INTERNATIONAL    | 1,234,000  | 1.80   | 2,221,200.00  |



|                |                              |             |        |                                      |  |
|----------------|------------------------------|-------------|--------|--------------------------------------|--|
|                | CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 236,000     | 43.70  | 10,313,200.00                        |  |
|                | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 558,000     | 10.80  | 6,026,400.00                         |  |
|                | ENN ENERGY HOLDINGS LTD      | 186,300     | 124.30 | 23,157,090.00                        |  |
|                | GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 672,000     | 14.24  | 9,569,280.00                         |  |
|                | HUANENG POWER INTL INC-H     | 678,000     | 2.74   | 1,857,720.00                         |  |
|                | KUNLUN ENERGY CO LTD         | 832,000     | 8.37   | 6,963,840.00                         |  |
|                | HANERGY THIN FILM POWER GROU | 960,000     | 3.91   | 3,753,600.00                         |  |
|                | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD   | 107,000     | 40.70  | 4,354,900.00                         |  |
|                | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD     | 980,000     | 13.10  | 12,838,000.00                        |  |
|                | 香港ドル 小計                      | 194,643,114 |        | 3,041,685,787.59<br>(42,644,434,742) |  |
| マレーシアリン<br>ギット | DIALOG GROUP BHD             | 929,580     | 3.18   | 2,956,064.40                         |  |
|                | PETRONAS DAGANGAN BHD        | 94,300      | 20.24  | 1,908,632.00                         |  |
|                | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 507,400     | 8.07   | 4,094,718.00                         |  |
|                | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 296,300     | 9.77   | 2,894,851.00                         |  |
|                | GAMUDA BHD                   | 413,200     | 3.70   | 1,528,840.00                         |  |
|                | HAP SENG CONSOLIDATED        | 133,100     | 8.39   | 1,116,709.00                         |  |
|                | SIME DARBY BERHAD            | 631,900     | 2.37   | 1,497,603.00                         |  |
|                | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD  | 241,800     | 6.31   | 1,525,758.00                         |  |
|                | MISC BHD                     | 317,800     | 6.85   | 2,176,930.00                         |  |
|                | WESTPORTS HOLDINGS BHD       | 257,600     | 4.29   | 1,105,104.00                         |  |
|                | GENTING BHD                  | 441,700     | 5.19   | 2,292,423.00                         |  |
|                | GENTING MALAYSIA BHD         | 628,000     | 3.09   | 1,940,520.00                         |  |
|                | FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD  | 34,500      | 30.50  | 1,052,250.00                         |  |
|                | GENTING PLANTATIONS BHD      | 88,900      | 9.20   | 817,880.00                           |  |
|                | IOI CORP BHD                 | 550,900     | 4.30   | 2,368,870.00                         |  |
|                | KUALA LUMPUR KEPONG BHD      | 96,200      | 23.16  | 2,227,992.00                         |  |
|                | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD     | 19,300      | 137.00 | 2,644,100.00                         |  |
|                | PPB GROUP BERHAD             | 159,940     | 18.78  | 3,003,673.20                         |  |
|                | QL RESOURCES BHD             | 305,250     | 6.08   | 1,855,920.00                         |  |
|                | SIME DARBY PLANTATION BHD    | 454,900     | 4.87   | 2,215,363.00                         |  |
|                | HARTALEGA HOLDINGS BHD       | 354,500     | 9.66   | 3,424,470.00                         |  |
|                | IHH HEALTHCARE BHD           | 584,300     | 5.34   | 3,120,162.00                         |  |
|                | KOSSAN RUBBER INDUSTRIES     | 257,000     | 3.45   | 886,650.00                           |  |
|                | SUPERMAX CORP BHD            | 304,008     | 4.19   | 1,273,793.52                         |  |
|                | TOP GLOVE CORP BHD           | 1,191,600   | 5.12   | 6,100,992.00                         |  |
|                | AMMB HOLDINGS BHD            | 416,500     | 2.98   | 1,241,170.00                         |  |
|                | CIMB GROUP HOLDINGS BHD      | 1,438,300   | 4.50   | 6,472,350.00                         |  |
|                | HONG LEONG BANK BERHAD       | 141,300     | 18.82  | 2,659,266.00                         |  |
|                | HONG LEONG FINANCIAL GROUP   | 66,500      | 17.24  | 1,146,460.00                         |  |
|                | MALAYAN BANKING BHD          | 848,600     | 8.24   | 6,992,464.00                         |  |
|                | PUBLIC BANK BERHAD           | 3,364,000   | 4.18   | 14,061,520.00                        |  |

|       |                              |            |        |                                   |  |
|-------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
|       | RHB BANK BHD                 | 319,249    | 5.31   | 1,695,212.19                      |  |
|       | AXIATA GROUP BERHAD          | 751,100    | 3.66   | 2,749,026.00                      |  |
|       | DIGI.COM BHD                 | 712,600    | 3.66   | 2,608,116.00                      |  |
|       | MAXIS BHD                    | 571,800    | 4.60   | 2,630,280.00                      |  |
|       | TELEKOM MALAYSIA BHD         | 294,900    | 6.11   | 1,801,839.00                      |  |
|       | PETRONAS GAS BHD             | 173,500    | 15.60  | 2,706,600.00                      |  |
|       | TENAGA NASIONAL BHD          | 525,700    | 10.82  | 5,688,074.00                      |  |
|       | マレーシアリングット 小計                | 18,918,027 |        | 108,482,645.31<br>(2,856,348,051) |  |
| タイバーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR   | 302,100    | 112.50 | 33,986,250.00                     |  |
|       | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 645,300    | 33.00  | 21,294,900.00                     |  |
|       | PTT PCL-NVDR                 | 2,644,100  | 40.25  | 106,425,025.00                    |  |
|       | THAI OIL PCL-NVDR            | 238,100    | 61.25  | 14,583,625.00                     |  |
|       | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR   | 420,700    | 45.00  | 18,931,500.00                     |  |
|       | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 515,261    | 63.25  | 32,590,258.25                     |  |
|       | SIAM CEMENT PCL-NVDR         | 173,550    | 396.00 | 68,725,800.00                     |  |
|       | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 975,700    | 67.00  | 65,371,900.00                     |  |
|       | BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR      | 1,651,200  | 8.70   | 14,365,440.00                     |  |
|       | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR  | 1,886,600  | 9.45   | 17,828,370.00                     |  |
|       | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR    | 2,111,500  | 5.05   | 10,663,075.00                     |  |
|       | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 730,500    | 31.50  | 23,010,750.00                     |  |
|       | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 385,017    | 36.75  | 14,149,374.75                     |  |
|       | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 1,579,901  | 14.70  | 23,224,544.70                     |  |
|       | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR  | 243,700    | 37.00  | 9,016,900.00                      |  |
|       | CP ALL PCL-NVDR              | 1,333,200  | 67.75  | 90,324,300.00                     |  |
|       | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR  | 893,100    | 29.00  | 25,899,900.00                     |  |
|       | OSOTSPA PCL-NVDR             | 118,300    | 34.25  | 4,051,775.00                      |  |
|       | THAI UNION GROUP PCL-NVDR    | 727,600    | 14.60  | 10,622,960.00                     |  |
|       | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 2,305,700  | 21.40  | 49,341,980.00                     |  |
|       | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 93,100     | 136.00 | 12,661,600.00                     |  |
|       | SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR | 171,400    | 40.50  | 6,941,700.00                      |  |
|       | BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR  | 127,200    | 125.00 | 15,900,000.00                     |  |
|       | KASIKORNBANK PCL-NVDR        | 381,400    | 145.00 | 55,303,000.00                     |  |
|       | KRUNG THAI BANK - NVDR       | 791,400    | 12.10  | 9,575,940.00                      |  |
|       | SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR  | 176,700    | 110.00 | 19,437,000.00                     |  |
|       | BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR | 315,500    | 21.80  | 6,877,900.00                      |  |
|       | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR      | 175,600    | 77.00  | 13,521,200.00                     |  |
|       | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR   | 154,600    | 70.50  | 10,899,300.00                     |  |
|       | SRISAWAD CORP PCL-NVDR       | 213,200    | 86.75  | 18,495,100.00                     |  |
|       | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR     | 472,300    | 56.50  | 26,684,950.00                     |  |
|       | LAND & HOUSES PUB - NVDR     | 1,835,600  | 8.55   | 15,694,380.00                     |  |
|       | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR  | 66,700     | 310.00 | 20,677,000.00                     |  |

|           |                              |            |           |                                     |  |
|-----------|------------------------------|------------|-----------|-------------------------------------|--|
|           | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   | 274,200    | 171.00    | 46,888,200.00                       |  |
|           | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR    | 515,900    | 56.75     | 29,277,325.00                       |  |
|           | TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR  | 118,000    | 32.50     | 3,835,000.00                        |  |
|           | TRUE CORP PCL-NVDR           | 3,793,576  | 3.26      | 12,367,057.76                       |  |
|           | B GRIMM POWER PCL-NVDR       | 167,500    | 45.75     | 7,663,125.00                        |  |
|           | ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR  | 90,600     | 187.00    | 16,942,200.00                       |  |
|           | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR     | 323,100    | 58.75     | 18,982,125.00                       |  |
|           | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR    | 145,900    | 74.25     | 10,833,075.00                       |  |
|           | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 689,800    | 33.50     | 23,108,300.00                       |  |
|           | RATCH GROUP PCL-NVDR         | 154,300    | 51.75     | 7,985,025.00                        |  |
|           | タイバーツ 小計                     | 31,128,705 |           | 1,064,959,130.46<br>(3,738,006,547) |  |
| フィリピンペソ   | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC  | 481,380    | 35.00     | 16,848,300.00                       |  |
|           | AYALA CORPORATION            | 64,145     | 731.00    | 46,889,995.00                       |  |
|           | GT CAPITAL HOLDINGS INC      | 21,594     | 511.00    | 11,034,534.00                       |  |
|           | JG SUMMIT HOLDINGS INC       | 623,049    | 58.65     | 36,541,823.85                       |  |
|           | SM INVESTMENTS CORP          | 56,225     | 970.00    | 54,538,250.00                       |  |
|           | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 211,940    | 126.50    | 26,810,410.00                       |  |
|           | JOLLIBEE FOODS CORP          | 85,240     | 176.90    | 15,078,956.00                       |  |
|           | PUREGOLD PRICE CLUB INC      | 183,600    | 40.45     | 7,426,620.00                        |  |
|           | UNIVERSAL ROBINA CORP        | 244,100    | 127.00    | 31,000,700.00                       |  |
|           | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 382,811    | 84.80     | 32,462,372.80                       |  |
|           | BDO UNIBANK INC              | 511,370    | 105.00    | 53,693,850.00                       |  |
|           | METROPOLITAN BANK & TRUST    | 402,156    | 46.50     | 18,700,254.00                       |  |
|           | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 3,662,500  | 3.74      | 13,697,750.00                       |  |
|           | AYALA LAND INC               | 1,761,020  | 34.90     | 61,459,598.00                       |  |
|           | MEGAWORLD CORP               | 1,793,000  | 3.38      | 6,060,340.00                        |  |
|           | SM PRIME HOLDINGS INC        | 2,411,100  | 35.30     | 85,111,830.00                       |  |
|           | GLOBE TELECOM INC            | 9,035      | 1,910.00  | 17,256,850.00                       |  |
|           | PLDT INC                     | 19,005     | 1,250.00  | 23,756,250.00                       |  |
|           | ABOITIZ POWER CORP           | 249,500    | 23.60     | 5,888,200.00                        |  |
|           | MANILA ELECTRIC COMPANY      | 50,740     | 280.00    | 14,207,200.00                       |  |
|           | フィリピンペソ 小計                   | 13,223,510 |           | 578,464,083.65<br>(1,295,759,547)   |  |
| インドネシアルピア | ADARO ENERGY TBK PT          | 3,549,400  | 1,225.00  | 4,348,015,000.00                    |  |
|           | UNITED TRACTORS TBK PT       | 328,100    | 21,100.00 | 6,922,910,000.00                    |  |
|           | ANEKA TAMBANG TBK            | 1,970,300  | 2,170.00  | 4,275,551,000.00                    |  |
|           | BARITO PACIFIC TBK PT        | 6,302,100  | 1,000.00  | 6,302,100,000.00                    |  |
|           | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK  | 597,800    | 11,500.00 | 6,874,700,000.00                    |  |
|           | INDOCEMENT TUNGKAL PRAKARSA  | 310,600    | 13,000.00 | 4,037,800,000.00                    |  |
|           | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT   | 2,589,200  | 2,260.00  | 5,851,592,000.00                    |  |
|           | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK  | 640,400    | 11,525.00 | 7,380,610,000.00                    |  |

|         |                               |            |           |                                       |  |
|---------|-------------------------------|------------|-----------|---------------------------------------|--|
|         | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT    | 4,514,400  | 5,450.00  | 24,603,480,000.00                     |  |
|         | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 1,481,700  | 6,775.00  | 10,038,517,500.00                     |  |
|         | GUDANG GARAM TBK PT           | 96,000     | 35,825.00 | 3,439,200,000.00                      |  |
|         | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T  | 533,700    | 9,250.00  | 4,936,725,000.00                      |  |
|         | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P  | 965,400    | 6,725.00  | 6,492,315,000.00                      |  |
|         | UNILEVER INDONESIA TBK PT     | 1,646,800  | 6,575.00  | 10,827,710,000.00                     |  |
|         | KALBE FARMA TBK PT            | 4,976,000  | 1,525.00  | 7,588,400,000.00                      |  |
|         | BANK CENTRAL ASIA TBK PT      | 2,268,300  | 32,200.00 | 73,039,260,000.00                     |  |
|         | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT   | 4,382,100  | 6,425.00  | 28,154,992,500.00                     |  |
|         | BANK NEGARA INDONESIA PERSER  | 1,705,200  | 5,950.00  | 10,145,940,000.00                     |  |
|         | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER  | 12,729,500 | 4,670.00  | 59,446,765,000.00                     |  |
|         | SARANA MENARA NUSANTARA PT    | 4,750,000  | 1,100.00  | 5,225,000,000.00                      |  |
|         | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK  | 11,709,200 | 3,370.00  | 39,460,004,000.00                     |  |
|         | PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT  | 2,383,500  | 1,360.00  | 3,241,560,000.00                      |  |
|         | インドネシアルピア 小計                  | 70,429,700 |           | 332,633,147,000.00<br>(2,528,011,917) |  |
| メキシコペソ  | CEMEX SAB-CPO                 | 3,528,568  | 13.44     | 47,423,953.92                         |  |
|         | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B  | 717,270    | 100.02    | 71,741,345.40                         |  |
|         | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV  | 29,305     | 270.66    | 7,931,691.30                          |  |
|         | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV  | 232,398    | 53.53     | 12,440,264.94                         |  |
|         | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER AI  | 96,600     | 54.00     | 5,216,400.00                          |  |
|         | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B  | 96,600     | 215.42    | 20,809,572.00                         |  |
|         | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B  | 48,960     | 357.59    | 17,507,606.40                         |  |
|         | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF  | 56,210     | 160.44    | 9,018,332.40                          |  |
|         | GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO    | 503,300    | 38.94     | 19,598,502.00                         |  |
|         | MEGACABLE HOLDINGS-CPO        | 83,700     | 73.59     | 6,159,483.00                          |  |
|         | WALMART DE MEXICO SAB DE CV   | 1,210,100  | 64.28     | 77,785,228.00                         |  |
|         | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV    | 89,966     | 101.73    | 9,152,241.18                          |  |
|         | BECLE SAB DE CV               | 104,800    | 46.19     | 4,840,712.00                          |  |
|         | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV     | 106,000    | 97.08     | 10,290,480.00                         |  |
|         | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD  | 429,600    | 157.86    | 67,816,656.00                         |  |
|         | GRUMA S.A.B. -B               | 46,275     | 235.33    | 10,889,895.75                         |  |
|         | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A     | 327,600    | 43.26     | 14,171,976.00                         |  |
|         | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A    | 382,900    | 34.34     | 13,148,786.00                         |  |
|         | GRUPO FINANCIERO BANORTE-0    | 604,900    | 112.41    | 67,996,809.00                         |  |
|         | GRUPO FINANCIERO INBURSA-0    | 550,200    | 18.28     | 10,057,656.00                         |  |
|         | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L  | 7,824,100  | 14.06     | 110,006,846.00                        |  |
|         | TELESITES SAB DE CV           | 244,000    | 20.06     | 4,894,640.00                          |  |
|         | INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N  | 120,100    | 77.84     | 9,348,584.00                          |  |
|         | メキシコペソ 小計                     | 17,433,452 |           | 628,247,661.29<br>(3,273,170,315)     |  |
| ブラジルリアル | COSAN SA                      | 56,500     | 90.89     | 5,135,285.00                          |  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS    | 840,700   | 22.53  | 18,940,971.00 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 1,096,500 | 22.82  | 25,022,130.00 |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA    | 151,600   | 19.46  | 2,950,136.00  |
| BRADSPAR SA -PREF            | 52,700    | 61.66  | 3,249,482.00  |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA  | 149,600   | 33.30  | 4,981,680.00  |
| GERDAU SA-PREF               | 250,700   | 26.77  | 6,711,239.00  |
| KLABIN SA - UNIT             | 169,200   | 28.77  | 4,867,884.00  |
| SUZANO SA                    | 166,322   | 73.66  | 12,251,278.52 |
| VALE SA                      | 841,030   | 93.15  | 78,341,944.50 |
| WEG SA                       | 198,244   | 70.52  | 13,980,166.88 |
| CCR SA                       | 257,000   | 12.30  | 3,161,100.00  |
| LOCALIZA RENT A CAR          | 134,313   | 55.13  | 7,404,675.69  |
| RUMO SA                      | 295,000   | 19.61  | 5,784,950.00  |
| ALPARGATAS SA - PREF         | 50,800    | 34.67  | 1,761,236.00  |
| B2W CIA DIGITAL              | 48,700    | 60.43  | 2,942,941.00  |
| LOJAS AMERICANAS SA-PREF     | 242,661   | 21.44  | 5,202,651.84  |
| LOJAS RENNER S.A.            | 196,620   | 40.91  | 8,043,724.20  |
| MAGAZINE LUIZA SA            | 686,600   | 20.37  | 13,986,042.00 |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA   | 172,000   | 21.29  | 3,661,880.00  |
| VIA VAREJO SA                | 274,300   | 11.44  | 3,137,992.00  |
| ATACADAO SA                  | 74,700    | 21.73  | 1,623,231.00  |
| RAIA DROGASIL SA             | 225,500   | 25.06  | 5,651,030.00  |
| AMBEV SA                     | 1,107,500 | 14.80  | 16,391,000.00 |
| BRF SA                       | 115,200   | 24.03  | 2,768,256.00  |
| JBS SA                       | 226,800   | 27.52  | 6,241,536.00  |
| NATURA &CO HOLDING SA        | 211,500   | 48.07  | 10,166,805.00 |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 228,000   | 14.78  | 3,369,840.00  |
| NOTRE DAME INTERMED PAR SA   | 120,900   | 83.00  | 10,034,700.00 |
| HYPERA SA                    | 104,800   | 31.70  | 3,322,160.00  |
| BANCO BRADESCO S.A.          | 285,841   | 22.61  | 6,462,865.01  |
| BANCO BRADESCO SA-PREF       | 1,011,358 | 26.04  | 26,335,762.32 |
| BANCO DO BRASIL S.A.         | 186,700   | 29.14  | 5,440,438.00  |
| BANCO INTER SA-UNITS         | 22,600    | 161.77 | 3,656,002.00  |
| BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT  | 92,500    | 38.98  | 3,605,650.00  |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 1,113,330 | 27.17  | 30,249,176.10 |
| ITAUSA SA                    | 1,039,607 | 10.05  | 10,448,050.35 |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO    | 473,175   | 53.79  | 25,452,083.25 |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT    | 55,400    | 91.80  | 5,085,720.00  |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES  | 148,900   | 23.74  | 3,534,886.00  |
| SUL AMERICA SA - UNITS       | 67,023    | 37.98  | 2,545,533.54  |
| TOTVS SA                     | 109,200   | 27.84  | 3,040,128.00  |
| TELEFONICA BRASIL S.A.       | 121,075   | 45.00  | 5,448,375.00  |

|       |                              |            |            |                                     |  |
|-------|------------------------------|------------|------------|-------------------------------------|--|
|       | TIM SA                       | 188,377    | 12.60      | 2,373,550.20                        |  |
|       | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 49,300     | 33.15      | 1,634,295.00                        |  |
|       | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 73,500     | 32.29      | 2,373,315.00                        |  |
|       | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 198,909    | 12.06      | 2,398,842.54                        |  |
|       | CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | 187,000    | 6.82       | 1,275,340.00                        |  |
|       | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP  | 70,700     | 40.61      | 2,871,127.00                        |  |
|       | CPFL ENERGIA SA              | 44,600     | 30.00      | 1,338,000.00                        |  |
|       | ENERGISA SA-UNITS            | 40,100     | 41.86      | 1,678,586.00                        |  |
|       | ENGIE BRASIL ENERGIA SA      | 42,050     | 40.31      | 1,695,035.50                        |  |
|       | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD  | 203,200    | 21.02      | 4,271,264.00                        |  |
|       | ブラジルリアル 小計                   | 14,570,435 |            | 444,301,972.44<br>(8,601,686,186)   |  |
| チリペソ  | EMPRESAS COPEC SA            | 93,709     | 8,795.00   | 824,170,655.00                      |  |
|       | EMPRESAS CMPC SA             | 237,271    | 2,265.00   | 537,418,815.00                      |  |
|       | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 24,706     | 38,065.00  | 940,433,890.00                      |  |
|       | FALABELLA SA                 | 162,654    | 3,179.00   | 517,077,066.00                      |  |
|       | CENCOSUD SA                  | 308,874    | 1,518.00   | 468,870,732.00                      |  |
|       | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA    | 37,740     | 6,671.00   | 251,763,540.00                      |  |
|       | EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B  | 100,495    | 1,866.20   | 187,543,769.00                      |  |
|       | BANCO DE CHILE               | 10,436,824 | 85.60      | 893,392,134.00                      |  |
|       | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 12,739     | 36,586.00  | 466,069,054.00                      |  |
|       | BANCO SANTANDER CHILE        | 15,407,613 | 46.52      | 716,762,156.00                      |  |
|       | CENCOSUD SHOPPING SA         | 94,600     | 1,417.00   | 134,048,200.00                      |  |
|       | COLBUN SA                    | 1,804,090  | 137.61     | 248,260,824.00                      |  |
|       | ENEL AMERICAS SA             | 8,457,223  | 118.90     | 1,005,563,814.00                    |  |
|       | ENEL CHILE SA                | 6,014,289  | 56.17      | 337,822,613.00                      |  |
|       | チリペソ 小計                      | 43,192,827 |            | 7,529,197,262.00<br>(1,128,626,669) |  |
| 韓国ウォン | GS HOLDINGS                  | 10,450     | 38,650.00  | 403,892,500.00                      |  |
|       | S-OIL CORP                   | 9,482      | 78,700.00  | 746,233,400.00                      |  |
|       | SK INNOVATION CO LTD         | 13,018     | 204,500.00 | 2,662,181,000.00                    |  |
|       | HANWHA SOLUTIONS CORP        | 25,949     | 45,000.00  | 1,167,705,000.00                    |  |
|       | HYUNDAI STEEL CO             | 22,295     | 42,450.00  | 946,422,750.00                      |  |
|       | KOREA ZINC CO LTD            | 1,964      | 402,500.00 | 790,510,000.00                      |  |
|       | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD   | 4,138      | 230,500.00 | 953,809,000.00                      |  |
|       | LG CHEM LTD                  | 10,396     | 784,000.00 | 8,150,464,000.00                    |  |
|       | LG CHEM LTD-PREFERENCE       | 1,778      | 359,000.00 | 638,302,000.00                      |  |
|       | LOTTE CHEMICAL CORP          | 3,636      | 303,500.00 | 1,103,526,000.00                    |  |
|       | POSCO                        | 16,903     | 306,000.00 | 5,172,318,000.00                    |  |
|       | POSCO CHEMICAL CO LTD        | 5,479      | 148,000.00 | 810,892,000.00                      |  |
|       | SK CHEMICALS CO LTD/NEW      | 1,700      | 267,000.00 | 453,900,000.00                      |  |
|       | CJ CORP                      | 3,215      | 91,200.00  | 293,208,000.00                      |  |

|                              |         |            |                   |  |
|------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 6,507   | 26,550.00  | 172,760,850.00    |  |
| DOOSAN BOBCAT INC            | 11,016  | 35,900.00  | 395,474,400.00    |  |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES      | 38,634  | 12,050.00  | 465,539,700.00    |  |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT   | 12,404  | 42,250.00  | 524,069,000.00    |  |
| HANWHA CORPORATION           | 10,143  | 29,150.00  | 295,668,450.00    |  |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST  | 15,811  | 43,000.00  | 679,873,000.00    |  |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL | 2,060   | 268,000.00 | 552,080,000.00    |  |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES   | 17,547  | 37,300.00  | 654,503,100.00    |  |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 10,044  | 117,500.00 | 1,180,170,000.00  |  |
| LG CORP                      | 20,501  | 85,900.00  | 1,761,035,900.00  |  |
| LOTTE CORP                   | 10,197  | 32,700.00  | 333,441,900.00    |  |
| SAMSUNG C&T CORP             | 18,666  | 118,500.00 | 2,211,921,000.00  |  |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD   | 38,530  | 13,300.00  | 512,449,000.00    |  |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES     | 108,001 | 6,840.00   | 738,726,840.00    |  |
| SK HOLDINGS CO LTD           | 8,328   | 244,000.00 | 2,032,032,000.00  |  |
| S-1 CORPORATION              | 3,622   | 81,800.00  | 296,279,600.00    |  |
| CJ LOGISTICS                 | 1,801   | 180,000.00 | 324,180,000.00    |  |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD        | 4,206   | 187,500.00 | 788,625,000.00    |  |
| KOREAN AIR LINES CO LTD      | 33,271  | 26,750.00  | 889,999,250.00    |  |
| PAN OCEAN CO LTD             | 57,176  | 6,600.00   | 377,361,600.00    |  |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 16,564  | 44,950.00  | 744,551,800.00    |  |
| HANON SYSTEMS                | 39,078  | 17,950.00  | 701,450,100.00    |  |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD         | 15,434  | 283,000.00 | 4,367,822,000.00  |  |
| HYUNDAI MOTOR CO             | 34,484  | 221,000.00 | 7,620,964,000.00  |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 7,866   | 98,300.00  | 773,227,800.00    |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF     | 5,330   | 100,000.00 | 533,000,000.00    |  |
| KIA MOTORS CORP              | 59,937  | 81,800.00  | 4,902,846,600.00  |  |
| COWAY CO LTD                 | 11,315  | 65,100.00  | 736,606,500.00    |  |
| FILA HOLDINGS CORP           | 11,149  | 44,300.00  | 493,900,700.00    |  |
| HLB INC                      | 9,459   | 41,700.00  | 394,440,300.00    |  |
| HLB INC-NEW                  | 9,459   | 41,700.00  | 394,440,300.00    |  |
| LG ELECTRONICS INC           | 24,827  | 146,500.00 | 3,637,155,500.00  |  |
| KANGWON LAND INC             | 23,051  | 26,300.00  | 606,241,300.00    |  |
| CHEIL WORLDWIDE INC          | 17,976  | 21,150.00  | 380,192,400.00    |  |
| KAKAO CORP                   | 13,033  | 492,000.00 | 6,412,236,000.00  |  |
| NAVER CORP                   | 28,018  | 387,000.00 | 10,842,966,000.00 |  |
| NCSOFT CORP                  | 3,793   | 936,000.00 | 3,550,248,000.00  |  |
| NETMARBLE CORP               | 4,825   | 124,000.00 | 598,300,000.00    |  |
| PEARL ABYSS CORP             | 1,102   | 310,500.00 | 342,171,000.00    |  |
| CJ ENM CO LTD                | 2,684   | 141,700.00 | 380,322,800.00    |  |
| HOTEL SHILLA CO LTD          | 6,730   | 86,200.00  | 580,126,000.00    |  |
| LOTTE SHOPPING CO            | 2,198   | 121,000.00 | 265,958,000.00    |  |

|                                 |         |              |                  |  |
|---------------------------------|---------|--------------|------------------|--|
| SHINSEGAE INC                   | 1,778   | 270,000.00   | 480,060,000.00   |  |
| BGF RETAIL CO LTD               | 1,349   | 162,500.00   | 219,212,500.00   |  |
| E-MART INC                      | 4,567   | 172,000.00   | 785,524,000.00   |  |
| GS RETAIL CO LTD                | 7,693   | 38,750.00    | 298,103,750.00   |  |
| CJ CHEILJEDANG CORP             | 1,754   | 429,000.00   | 752,466,000.00   |  |
| KT&G CORP                       | 26,089  | 80,300.00    | 2,094,946,700.00 |  |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA    | 6,322   | 129,000.00   | 815,538,000.00   |  |
| OTTOGI CORPORATION              | 337     | 576,000.00   | 194,112,000.00   |  |
| AMOREPACIFIC CORP               | 6,939   | 256,000.00   | 1,776,384,000.00 |  |
| AMOREPACIFIC GROUP              | 7,000   | 62,500.00    | 437,500,000.00   |  |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE      | 2,108   | 1,541,000.00 | 3,248,428,000.00 |  |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF      | 464     | 687,000.00   | 318,768,000.00   |  |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD     | 16,061  | 131,500.00   | 2,112,021,500.00 |  |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD-NEW | 289     | 131,500.00   | 38,003,500.00    |  |
| ALTEOGEN INC                    | 3,600   | 99,700.00    | 358,920,000.00   |  |
| ALTEOGEN INC-NEW                | 1,800   | 99,700.00    | 179,460,000.00   |  |
| CELLTRION INC                   | 21,569  | 300,000.00   | 6,470,700,000.00 |  |
| CELLTRION INC-NEW               | 389     | 300,000.00   | 116,700,000.00   |  |
| CELLTRION PHARM INC             | 3,496   | 149,300.00   | 521,952,800.00   |  |
| CELLTRION PHARM INC-NEW         | 69      | 149,300.00   | 10,301,700.00    |  |
| HANMI PHARM CO LTD              | 1,525   | 316,500.00   | 482,662,500.00   |  |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD        | 3,795   | 716,000.00   | 2,717,220,000.00 |  |
| SEEGENE INC                     | 3,700   | 135,100.00   | 499,870,000.00   |  |
| SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO    | 5,900   | 100,500.00   | 592,950,000.00   |  |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD    | 6,576   | 106,500.00   | 700,344,000.00   |  |
| YUHAN CORP                      | 13,058  | 61,000.00    | 796,538,000.00   |  |
| HANA FINANCIAL GROUP            | 69,478  | 40,950.00    | 2,845,124,100.00 |  |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA        | 54,119  | 8,900.00     | 481,659,100.00   |  |
| KB FINANCIAL GROUP INC          | 90,602  | 51,000.00    | 4,620,702,000.00 |  |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD     | 103,066 | 35,100.00    | 3,617,616,600.00 |  |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC       | 114,338 | 9,940.00     | 1,136,519,720.00 |  |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO    | 8,663   | 85,100.00    | 737,221,300.00   |  |
| MERITZ SECURITIES CO LTD        | 58,500  | 4,360.00     | 255,060,000.00   |  |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD       | 62,989  | 9,590.00     | 604,064,510.00   |  |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C    | 20,867  | 11,250.00    | 234,753,750.00   |  |
| SAMSUNG CARD CO                 | 4,545   | 33,600.00    | 152,712,000.00   |  |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD       | 14,954  | 38,500.00    | 575,729,000.00   |  |
| DB INSURANCE CO LTD             | 9,631   | 44,500.00    | 428,579,500.00   |  |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO    | 15,653  | 23,550.00    | 368,628,150.00   |  |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS       | 7,579   | 184,000.00   | 1,394,536,000.00 |  |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT    | 14,630  | 75,200.00    | 1,100,176,000.00 |  |
| DOUZONE BIZON CO LTD            | 4,200   | 100,500.00   | 422,100,000.00   |  |



|         |                              |           |            |                                        |  |
|---------|------------------------------|-----------|------------|----------------------------------------|--|
|         | SAMSUNG SDS CO LTD           | 7,977     | 184,500.00 | 1,471,756,500.00                       |  |
|         | KMW CO LTD                   | 6,037     | 66,100.00  | 399,045,700.00                         |  |
|         | LG DISPLAY CO LTD            | 50,564    | 22,200.00  | 1,122,520,800.00                       |  |
|         | LG INNOTEK CO LTD            | 3,321     | 203,500.00 | 675,823,500.00                         |  |
|         | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 13,353    | 186,500.00 | 2,490,334,500.00                       |  |
|         | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | 1,086,489 | 81,000.00  | 88,005,609,000.00                      |  |
|         | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | 185,040   | 72,900.00  | 13,489,416,000.00                      |  |
|         | SAMSUNG SDI CO LTD           | 12,610    | 635,000.00 | 8,007,350,000.00                       |  |
|         | LG UPLUS CORP                | 46,629    | 12,050.00  | 561,879,450.00                         |  |
|         | SK TELECOM                   | 8,797     | 249,000.00 | 2,190,453,000.00                       |  |
|         | KOREA ELECTRIC POWER CORP    | 56,027    | 22,800.00  | 1,277,415,600.00                       |  |
|         | KOREA GAS CORPORATION        | 6,488     | 32,050.00  | 207,940,400.00                         |  |
|         | SK HYNIX INC                 | 124,025   | 133,500.00 | 16,557,337,500.00                      |  |
|         | 韓国ウォン 小計                     | 3,316,578 |            | 271,189,471,970.00<br>(26,088,427,203) |  |
| ニュー台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP   | 241,150   | 95.40      | 23,005,710.00                          |  |
|         | ASIA CEMENT CORP             | 467,281   | 45.90      | 21,448,197.90                          |  |
|         | CHINA STEEL CORP             | 2,649,947 | 25.00      | 66,248,675.00                          |  |
|         | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE    | 780,430   | 85.10      | 66,414,593.00                          |  |
|         | FORMOSA PLASTICS CORP        | 893,600   | 98.90      | 88,377,040.00                          |  |
|         | NAN YA PLASTICS CORP         | 1,133,557 | 76.20      | 86,377,043.40                          |  |
|         | TAIWAN CEMENT                | 1,109,405 | 45.55      | 50,533,397.75                          |  |
|         | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP   | 28,000    | 966.00     | 27,048,000.00                          |  |
|         | FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 779,138   | 29.15      | 22,711,872.70                          |  |
|         | HIWIN TECHNOLOGIES CORP      | 66,827    | 395.50     | 26,430,078.50                          |  |
|         | EVERGREEN MARINE CORP LTD    | 509,883   | 43.70      | 22,281,887.10                          |  |
|         | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP  | 500,000   | 30.70      | 15,350,000.00                          |  |
|         | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 386,413   | 46.40      | 17,929,563.20                          |  |
|         | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD    | 39,728    | 473.00     | 18,791,344.00                          |  |
|         | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD   | 87,981    | 194.50     | 17,112,304.50                          |  |
|         | GIANT MANUFACTURING          | 62,000    | 282.50     | 17,515,000.00                          |  |
|         | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD  | 35,000    | 390.00     | 13,650,000.00                          |  |
|         | POU CHEN                     | 496,500   | 31.85      | 15,813,525.00                          |  |
|         | HOTAI MOTOR COMPANY LTD      | 72,000    | 579.00     | 41,688,000.00                          |  |
|         | PRESIDENT CHAIN STORE CORP   | 130,000   | 275.00     | 35,750,000.00                          |  |
|         | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 1,145,624 | 68.50      | 78,475,244.00                          |  |
|         | ONENESS BIOTECH CO LTD       | 39,000    | 253.50     | 9,886,500.00                           |  |
|         | CHANG HWA COMMERCIAL BANK    | 1,154,145 | 17.25      | 19,909,001.25                          |  |
|         | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 3,906,955 | 21.50      | 83,999,532.50                          |  |
|         | E.SUN FINANCIAL HOLDING CO   | 2,538,435 | 26.00      | 65,999,310.00                          |  |
|         | FIRST FINANCIAL HOLDING CO   | 2,346,360 | 21.90      | 51,385,284.00                          |  |
|         | HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 2,078,972 | 18.25      | 37,941,239.00                          |  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 2,480,754 | 31.40    | 77,895,675.60  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS   | 2,172,018 | 12.35    | 26,824,422.30  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING    | 2,423,875 | 13.20    | 31,995,150.00  |
| TAIWAN BUSINESS BANK         | 1,791,401 | 9.76     | 17,484,073.76  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 2,262,018 | 20.65    | 46,710,671.70  |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 735,000   | 40.70    | 29,914,500.00  |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD     | 275,217   | 184.50   | 50,777,536.50  |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO  | 2,186,213 | 22.15    | 48,424,617.95  |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO  | 1,747,366 | 46.50    | 81,252,519.00  |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL  | 2,798,255 | 10.20    | 28,542,201.00  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD  | 459,119   | 24.50    | 11,248,415.50  |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO   | 1,485,087 | 54.40    | 80,788,732.80  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING  | 2,867,852 | 8.71     | 24,978,990.92  |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 198,500   | 43.55    | 8,644,675.00   |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD   | 163,080   | 44.40    | 7,240,752.00   |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP       | 116,000   | 268.00   | 31,088,000.00  |
| ACER INC                     | 681,168   | 31.00    | 21,116,208.00  |
| ADVANTECH CO LTD             | 84,134    | 353.00   | 29,699,302.00  |
| ASUSTEK COMPUTER INC         | 165,774   | 366.00   | 60,673,284.00  |
| AU OPTRONICS CORP            | 1,995,000 | 20.50    | 40,897,500.00  |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD    | 172,000   | 206.50   | 35,518,000.00  |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD   | 134,766   | 99.00    | 13,341,834.00  |
| COMPAL ELECTRONICS           | 914,775   | 23.95    | 21,908,861.25  |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 433,220   | 285.50   | 123,684,310.00 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD    | 205,042   | 75.40    | 15,460,166.80  |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY   | 2,840,272 | 128.00   | 363,554,816.00 |
| INNOLUX CORP                 | 2,043,112 | 20.20    | 41,270,862.40  |
| INVENTEC CORP                | 710,429   | 26.95    | 19,146,061.55  |
| LARGAN PRECISION CO LTD      | 22,820    | 3,240.00 | 73,936,800.00  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP      | 469,160   | 61.60    | 28,900,256.00  |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO  | 175,000   | 163.00   | 28,525,000.00  |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 52,000    | 326.00   | 16,952,000.00  |
| PEGATRON CORP                | 426,976   | 74.20    | 31,681,619.20  |
| QUANTA COMPUTER INC          | 670,150   | 93.70    | 62,793,055.00  |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP  | 285,193   | 54.10    | 15,428,941.30  |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP    | 275,000   | 87.90    | 24,172,500.00  |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP       | 65,000    | 248.00   | 16,120,000.00  |
| WISTRON CORP                 | 760,865   | 33.75    | 25,679,193.75  |
| WIWYNN CORP                  | 18,000    | 829.00   | 14,922,000.00  |
| WPG HOLDINGS LTD             | 335,168   | 47.80    | 16,021,030.40  |
| YAGEO CORPORATION            | 82,952    | 552.00   | 45,789,504.00  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 130,000   | 126.00   | 16,380,000.00  |

|        |                              |            |           |                                      |  |
|--------|------------------------------|------------|-----------|--------------------------------------|--|
|        | CHUNGHWA TELECOM CO LTD      | 870,000    | 111.00    | 96,570,000.00                        |  |
|        | FAR EASTONE TELECOMM CO LTD  | 405,000    | 63.10     | 25,555,500.00                        |  |
|        | TAIWAN MOBILE CO LTD         | 398,400    | 97.50     | 38,844,000.00                        |  |
|        | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 762,294    | 107.00    | 81,565,458.00                        |  |
|        | ASMEDIA TECHNOLOGY INC       | 6,000      | 1,505.00  | 9,030,000.00                         |  |
|        | GLOBALWAFERS CO LTD          | 48,000     | 730.00    | 35,040,000.00                        |  |
|        | MEDIATEK INC                 | 342,236    | 894.00    | 305,958,984.00                       |  |
|        | NANYA TECHNOLOGY CORP        | 266,000    | 90.00     | 23,940,000.00                        |  |
|        | NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 130,000    | 528.00    | 68,640,000.00                        |  |
|        | PHISON ELECTRONICS CORP      | 34,000     | 465.50    | 15,827,000.00                        |  |
|        | POWERTECH TECHNOLOGY INC     | 179,300    | 102.50    | 18,378,250.00                        |  |
|        | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP   | 107,703    | 452.50    | 48,735,607.50                        |  |
|        | SILERGY CORP                 | 16,000     | 2,210.00  | 35,360,000.00                        |  |
|        | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 5,597,000  | 576.00    | 3,223,872,000.00                     |  |
|        | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 2,692,000  | 47.15     | 126,927,800.00                       |  |
|        | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI  | 235,000    | 105.50    | 24,792,500.00                        |  |
|        | WIN SEMICONDUCTORS CORP      | 85,000     | 384.00    | 32,640,000.00                        |  |
|        | WINBOND ELECTRONICS CORP     | 665,000    | 28.00     | 18,620,000.00                        |  |
|        | ニュー台湾ドル 小計                   | 74,826,995 |           | 7,079,753,481.98<br>(27,044,658,301) |  |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD    | 135,462    | 429.95    | 58,241,886.90                        |  |
|        | COAL INDIA LTD               | 338,932    | 132.30    | 44,840,703.60                        |  |
|        | HINDUSTAN PETROLEUM CORP     | 156,492    | 232.50    | 36,384,390.00                        |  |
|        | INDIAN OIL CORP LTD          | 516,993    | 94.55     | 48,881,688.15                        |  |
|        | OIL & NATURAL GAS CORP LTD   | 552,299    | 104.80    | 57,880,935.20                        |  |
|        | PETRONET LNG LTD             | 175,697    | 224.85    | 39,505,470.45                        |  |
|        | RELIANCE INDUSTRIES LTD      | 646,449    | 2,047.30  | 1,323,475,037.70                     |  |
|        | ACC LTD                      | 22,031     | 1,892.25  | 41,688,159.75                        |  |
|        | AMBUJA CEMENTS LTD           | 186,640    | 303.80    | 56,701,232.00                        |  |
|        | ASIAN PAINTS LTD             | 85,483     | 2,443.55  | 208,881,984.65                       |  |
|        | BERGER PAINTS INDIA LTD      | 52,248     | 741.05    | 38,718,380.40                        |  |
|        | GRASIM INDUSTRIES LTD        | 65,833     | 1,387.65  | 91,353,162.45                        |  |
|        | HINDALCO INDUSTRIES LTD      | 380,502    | 317.75    | 120,904,510.50                       |  |
|        | JSW STEEL LTD                | 184,120    | 437.35    | 80,524,882.00                        |  |
|        | PI INDUSTRIES LTD            | 20,025     | 2,305.05  | 46,158,626.25                        |  |
|        | PIDILITE INDUSTRIES LTD      | 35,328     | 1,794.60  | 63,399,628.80                        |  |
|        | SHREE CEMENT LTD             | 2,278      | 27,803.30 | 63,335,917.40                        |  |
|        | TATA STEEL LTD               | 153,441    | 702.80    | 107,838,334.80                       |  |
|        | ULTRATECH CEMENT LTD         | 25,868     | 6,858.65  | 177,419,558.20                       |  |
|        | UPL LTD                      | 104,963    | 608.85    | 63,906,722.55                        |  |
|        | VEDANTA LTD                  | 392,095    | 223.40    | 87,594,023.00                        |  |
|        | HAVELLS INDIA LTD            | 51,620     | 1,028.95  | 53,114,399.00                        |  |

|                              |         |           |                |
|------------------------------|---------|-----------|----------------|
| LARSEN & TOUBRO LTD          | 160,573 | 1,369.15  | 219,848,522.95 |
| SIEMENS LTD                  | 16,922  | 1,805.15  | 30,546,748.30  |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 106,443 | 706.85    | 75,239,234.55  |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD  | 59,098  | 558.75    | 33,021,007.50  |
| INTERGLOBE AVIATION LTD      | 22,647  | 1,734.25  | 39,275,559.75  |
| BAJAJ AUTO LTD               | 15,873  | 3,603.55  | 57,199,149.15  |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD    | 17,640  | 1,623.00  | 28,629,720.00  |
| BHARAT FORGE LTD             | 57,811  | 581.00    | 33,588,191.00  |
| EICHER MOTORS LTD            | 33,754  | 2,660.65  | 89,807,580.10  |
| HERO MOTOCORP LTD            | 26,827  | 3,033.85  | 81,389,093.95  |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD      | 188,154 | 811.40    | 152,668,155.60 |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | 31,475  | 7,066.20  | 222,408,645.00 |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD   | 292,292 | 201.55    | 58,911,452.60  |
| MRF LTD                      | 469     | 82,341.70 | 38,618,257.30  |
| TATA MOTORS LTD              | 369,721 | 294.45    | 108,864,348.45 |
| PAGE INDUSTRIES LTD          | 1,369   | 29,779.55 | 40,768,203.95  |
| TITAN CO LTD                 | 79,745  | 1,488.15  | 118,672,521.75 |
| JUBILANT FOODWORKS LTD       | 17,171  | 2,868.05  | 49,247,286.55  |
| INFO EDGE INDIA LTD          | 15,218  | 4,682.60  | 71,259,806.80  |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 185,528 | 205.20    | 38,070,345.60  |
| TRENT LTD                    | 36,111  | 785.05    | 28,348,940.55  |
| AVENUE SUPERMARTS LTD        | 38,140  | 2,855.60  | 108,912,584.00 |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD     | 23,460  | 3,537.75  | 82,995,615.00  |
| ITC LTD                      | 694,531 | 215.95    | 149,983,969.45 |
| NESTLE INDIA LTD             | 7,959   | 16,448.10 | 130,910,427.90 |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD   | 129,348 | 629.10    | 81,372,826.80  |
| UNITED SPIRITS LTD           | 63,364  | 551.10    | 34,919,900.40  |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA)    | 29,776  | 1,553.85  | 46,267,437.60  |
| DABUR INDIA LTD              | 137,958 | 529.05    | 72,986,679.90  |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 89,717  | 683.40    | 61,312,597.80  |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD       | 188,336 | 2,318.60  | 436,675,849.60 |
| MARICO LTD                   | 109,079 | 400.70    | 43,707,955.30  |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE  | 21,126  | 2,919.60  | 61,679,469.60  |
| AUROBINDO PHARMA LTD         | 61,318  | 855.85    | 52,479,010.30  |
| BIOCON LTD                   | 105,275 | 402.10    | 42,331,077.50  |
| CIPLA LTD                    | 108,367 | 792.95    | 85,929,612.65  |
| DIVI'S LABORATORIES LTD      | 31,990  | 3,481.15  | 111,361,988.50 |
| DR. REDDY'S LABORATORIES     | 25,853  | 4,350.50  | 112,473,476.50 |
| IPCA LABORATORIES LTD        | 15,981  | 1,840.40  | 29,411,432.40  |
| LUPIN LTD                    | 49,118  | 1,012.40  | 49,727,063.20  |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS     | 199,821 | 585.30    | 116,955,231.30 |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD  | 11,072  | 2,459.05  | 27,226,601.60  |

|                |                              |            |          |                                       |  |
|----------------|------------------------------|------------|----------|---------------------------------------|--|
|                | AXIS BANK LTD                | 518,989    | 706.40   | 366,613,829.60                        |  |
|                | BANDHAN BANK LTD             | 157,300    | 357.45   | 56,226,885.00                         |  |
|                | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 386,622    | 2,465.75 | 953,313,196.50                        |  |
|                | ICICI BANK LTD               | 1,164,497  | 567.50   | 660,852,047.50                        |  |
|                | KOTAK MAHINDRA BANK LTD      | 128,424    | 1,782.45 | 228,909,358.80                        |  |
|                | STATE BANK OF INDIA          | 395,733    | 359.85   | 142,404,520.05                        |  |
|                | YES BANK LTD                 | 1,972,090  | 14.65    | 28,891,118.50                         |  |
|                | BAJAJ FINANCE LTD            | 62,831     | 5,270.30 | 331,138,219.30                        |  |
|                | HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 11,141     | 2,848.80 | 31,738,480.80                         |  |
|                | MUTHOOT FINANCE LTD          | 23,900     | 1,219.25 | 29,140,075.00                         |  |
|                | PIRAMAL ENTERPRISES LTD      | 26,950     | 1,844.65 | 49,713,317.50                         |  |
|                | REC LTD                      | 213,247    | 135.20   | 28,830,994.40                         |  |
|                | SHRIRAM TRANSPORT FINANCE    | 48,883     | 1,401.80 | 68,524,189.40                         |  |
|                | BAJAJ FINSERV LTD            | 8,193      | 9,202.05 | 75,392,395.65                         |  |
|                | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD   | 180,528    | 676.50   | 122,127,192.00                        |  |
|                | ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 54,419     | 1,402.85 | 76,341,694.15                         |  |
|                | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 86,200     | 429.80   | 37,048,760.00                         |  |
|                | SBI LIFE INSURANCE CO LTD    | 96,968     | 880.70   | 85,399,717.60                         |  |
|                | DLF LTD                      | 138,319    | 284.15   | 39,303,343.85                         |  |
|                | HCL TECHNOLOGIES LTD         | 240,263    | 975.65   | 234,412,595.95                        |  |
|                | INFOSYS LTD                  | 772,547    | 1,353.75 | 1,045,835,501.25                      |  |
|                | LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | 10,300     | 3,972.20 | 40,913,660.00                         |  |
|                | TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | 212,355    | 3,121.10 | 662,781,190.50                        |  |
|                | TECH MAHINDRA LTD            | 141,723    | 992.15   | 140,610,474.45                        |  |
|                | WIPRO LTD                    | 246,615    | 411.00   | 101,358,765.00                        |  |
|                | BHARTI AIRTEL LTD            | 570,232    | 523.65   | 298,601,986.80                        |  |
|                | INDUS TOWERS LTD             | 155,003    | 248.10   | 38,456,244.30                         |  |
|                | ADANI GREEN ENERGY LTD       | 82,800     | 1,291.35 | 106,923,780.00                        |  |
|                | GAIL INDIA LTD               | 325,150    | 131.00   | 42,594,650.00                         |  |
|                | INDRAPRASTHA GAS LTD         | 63,062     | 515.00   | 32,476,930.00                         |  |
|                | NTPC LTD                     | 1,074,737  | 106.00   | 113,922,122.00                        |  |
|                | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 456,276    | 221.05   | 100,859,809.80                        |  |
|                | インドルピー 小計                    | 18,187,526 |          | 12,838,410,258.10<br>(19,385,999,489) |  |
| チェココルナ         | KOMERCNI BANKA AS            | 16,748     | 675.00   | 11,304,900.00                         |  |
|                | MONETA MONEY BANK AS         | 139,823    | 80.00    | 11,185,840.00                         |  |
|                | CEZ AS                       | 38,447     | 544.00   | 20,915,168.00                         |  |
|                | チェココルナ 小計                    | 195,018    |          | 43,405,908.00<br>(212,688,949)        |  |
| クウェートディ<br>ナール | AGILITY                      | 216,149    | 0.73     | 159,085.66                            |  |
|                | BOUBYAN BANK K.S.C           | 217,006    | 0.60     | 131,722.64                            |  |
|                | GULF BANK                    | 341,628    | 0.21     | 74,474.90                             |  |

|            |                              |           |           |                                    |  |
|------------|------------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|--|
|            | KUWAIT FINANCE HOUSE         | 1,026,997 | 0.75      | 776,409.73                         |  |
|            | NATIONAL BANK OF KUWAIT      | 1,507,326 | 0.80      | 1,216,412.08                       |  |
|            | NATIONAL BANK OF KUWAIT-NEW  | 75,366    | 0.80      | 60,820.36                          |  |
|            | MABANEE CO KPSC              | 110,401   | 0.73      | 80,703.13                          |  |
|            | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 491,210   | 0.63      | 312,409.56                         |  |
|            | クウェートディナール 小計                | 3,986,083 |           | 2,812,038.06<br>(1,011,799,414)    |  |
| コロンビアペソ    | ECOPETROL SA                 | 1,236,668 | 2,333.00  | 2,885,146,444.00                   |  |
|            | BANCOLOMBIA SA               | 56,939    | 30,000.00 | 1,708,170,000.00                   |  |
|            | BANCOLOMBIA SA-PREF          | 117,073   | 30,000.00 | 3,512,190,000.00                   |  |
|            | GRUPO DE INV SURAMERICANA    | 48,828    | 21,900.00 | 1,069,333,200.00                   |  |
|            | INTERCONEXION ELECTRICA SA   | 91,762    | 23,100.00 | 2,119,702,200.00                   |  |
|            | コロンビアペソ 小計                   | 1,551,270 |           | 11,294,541,844.00<br>(337,706,801) |  |
| ハンガリーフォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 95,098    | 2,184.00  | 207,694,032.00                     |  |
|            | RICHTER GEDEON NYRT          | 32,764    | 8,805.00  | 288,487,020.00                     |  |
|            | OTP BANK PLC                 | 50,415    | 13,670.00 | 689,173,050.00                     |  |
|            | ハンガリーフォリント 小計                | 178,277   |           | 1,185,354,102.00<br>(418,074,391)  |  |
| アラブディルハム   | ABU DHABI COMMERCIAL BANK    | 648,986   | 6.09      | 3,952,324.74                       |  |
|            | ABU DHABI ISLAMIC BANK       | 533,706   | 4.87      | 2,599,148.22                       |  |
|            | DUBAI ISLAMIC BANK           | 500,576   | 4.77      | 2,387,747.52                       |  |
|            | FIRST ABU DHABI BANK PJSC    | 673,195   | 14.56     | 9,801,719.20                       |  |
|            | ALDAR PROPERTIES PJSC        | 913,526   | 3.68      | 3,361,775.68                       |  |
|            | EMAAR MALLS PJSC             | 731,313   | 1.66      | 1,213,979.58                       |  |
|            | EMAAR PROPERTIES PJSC        | 956,316   | 3.46      | 3,308,853.36                       |  |
|            | EMIRATES TELECOM GROUP CO    | 465,196   | 21.38     | 9,945,890.48                       |  |
|            | アラブディルハム 小計                  | 5,422,814 |           | 36,571,438.78<br>(1,082,148,873)   |  |
| ポーランドズロチ   | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 67,022    | 62.82     | 4,210,322.04                       |  |
|            | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I  | 368,052   | 5.74      | 2,115,562.89                       |  |
|            | KGHM POLSKA MIEDZ SA         | 31,277    | 174.70    | 5,464,091.90                       |  |
|            | LPP SA                       | 260       | 7,825.00  | 2,034,500.00                       |  |
|            | CD PROJEKT SA                | 15,177    | 217.10    | 3,294,926.70                       |  |
|            | CYFROWY POLSAT SA            | 63,798    | 28.00     | 1,786,344.00                       |  |
|            | ALLEGRO.EU SA                | 81,700    | 54.50     | 4,452,650.00                       |  |
|            | DINO POLSKA SA               | 10,080    | 250.20    | 2,522,016.00                       |  |
|            | BANK PEKAO SA                | 48,250    | 69.64     | 3,360,130.00                       |  |
|            | PKO BANK POLSKI SA           | 210,574   | 32.59     | 6,862,606.66                       |  |
|            | SANTANDER BANK POLSKA SA     | 8,248     | 208.40    | 1,718,883.20                       |  |
|            | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 149,572   | 33.70     | 5,040,576.40                       |  |
|            | ORANGE POLSKA SA             | 110,607   | 6.31      | 698,483.20                         |  |

|          |                              |           |          |                                   |  |
|----------|------------------------------|-----------|----------|-----------------------------------|--|
|          | PGE SA                       | 194,020   | 6.31     | 1,224,266.20                      |  |
|          | ポーランドズロチ 小計                  | 1,358,637 |          | 44,785,359.19<br>(1,245,480,839)  |  |
| 南アフリカランド | EXXARO RESOURCES LTD         | 53,022    | 170.06   | 9,016,921.32                      |  |
|          | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 27,534    | 258.63   | 7,121,118.42                      |  |
|          | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD  | 12,668    | 2,109.79 | 26,726,819.72                     |  |
|          | ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 92,065    | 297.73   | 27,410,512.45                     |  |
|          | GOLD FIELDS LTD              | 207,590   | 134.61   | 27,943,689.90                     |  |
|          | HARMONY GOLD MINING CO LTD   | 107,409   | 60.52    | 6,500,392.68                      |  |
|          | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 183,372   | 259.03   | 47,498,849.16                     |  |
|          | KUMBA IRON ORE LTD           | 13,805    | 566.22   | 7,816,667.10                      |  |
|          | NORTHAM PLATINUM LTD         | 78,627    | 234.61   | 18,446,680.47                     |  |
|          | SASOL LTD                    | 132,236   | 212.15   | 28,053,867.40                     |  |
|          | SIBANYE STILLWATER LTD       | 615,967   | 65.76    | 40,505,989.92                     |  |
|          | BIDVEST GROUP LTD            | 67,039    | 159.54   | 10,695,402.06                     |  |
|          | MULTICHOICE GROUP LTD        | 100,361   | 125.23   | 12,568,208.03                     |  |
|          | MR PRICE GROUP LTD           | 53,931    | 184.87   | 9,970,223.97                      |  |
|          | NASPERS LTD-N SHS            | 99,024    | 3,471.43 | 343,754,884.32                    |  |
|          | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 207,846   | 47.88    | 9,951,666.48                      |  |
|          | BID CORP LTD                 | 81,010    | 280.32   | 22,708,723.20                     |  |
|          | CLICKS GROUP LTD             | 52,538    | 235.07   | 12,350,107.66                     |  |
|          | SHOPRITE HOLDINGS LTD        | 121,567   | 153.06   | 18,607,045.02                     |  |
|          | SPAR GROUP LIMITED/THE       | 43,448    | 194.05   | 8,431,084.40                      |  |
|          | TIGER BRANDS LTD             | 38,449    | 206.00   | 7,920,494.00                      |  |
|          | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 84,675    | 139.60   | 11,820,630.00                     |  |
|          | ABSA GROUP LTD               | 154,274   | 122.21   | 18,853,825.54                     |  |
|          | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD    | 14,766    | 1,357.83 | 20,049,717.78                     |  |
|          | NEDBANK GROUP LTD            | 81,532    | 126.73   | 10,332,550.36                     |  |
|          | STANDARD BANK GROUP LTD      | 292,961   | 122.73   | 35,955,103.53                     |  |
|          | FIRSTRAND LTD                | 1,104,813 | 50.25    | 55,516,853.25                     |  |
|          | REINET INVESTMENTS SCA       | 33,819    | 288.29   | 9,749,679.51                      |  |
|          | REMGRO LTD                   | 113,187   | 101.79   | 11,521,304.73                     |  |
|          | DISCOVERY LTD                | 99,383    | 134.51   | 13,368,007.33                     |  |
|          | OLD MUTUAL LTD               | 985,060   | 11.98    | 11,801,018.80                     |  |
|          | RAND MERCHANT INVESTMENT HOL | 139,332   | 29.47    | 4,106,114.04                      |  |
|          | SANLAM LTD                   | 421,574   | 58.84    | 24,805,414.16                     |  |
|          | NEPI ROCKCASTLE PLC          | 82,474    | 90.47    | 7,461,422.78                      |  |
|          | MTN GROUP LTD                | 395,759   | 85.08    | 33,671,175.72                     |  |
|          | VODACOM GROUP LTD            | 139,488   | 128.60   | 17,938,156.80                     |  |
|          | 南アフリカランド 小計                  | 6,532,605 |          | 990,950,322.01<br>(7,224,027,847) |  |
| オフショア元   | CHINA MERCHANTS ENERGY -A    | 57,700    | 5.16     | 297,732.00                        |  |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 242,225 | 4.22   | 1,022,189.50 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-A    | 86,528  | 17.78  | 1,538,467.84 |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A | 26,000  | 6.33   | 164,580.00   |
| OFFSHORE OIL ENGINEERING-A   | 42,000  | 4.49   | 188,580.00   |
| PETROCHINA CO LTD-A          | 308,400 | 4.27   | 1,316,868.00 |
| SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 79,200  | 10.55  | 835,560.00   |
| SHANXI COKING COAL ENERGY-A  | 38,870  | 4.82   | 187,353.40   |
| SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A | 28,400  | 5.96   | 169,264.00   |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A | 39,000  | 7.25   | 282,750.00   |
| YANTAI JEREH OILFIELD-A      | 9,100   | 34.64  | 315,224.00   |
| YANZHOU COAL MINING CO-A     | 21,055  | 12.08  | 254,344.40   |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 124,400 | 3.70   | 460,280.00   |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A  | 49,000  | 50.73  | 2,485,770.00 |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO-A    | 484,796 | 8.03   | 3,892,911.88 |
| BBMG CORPORATION-A           | 79,100  | 2.90   | 229,390.00   |
| BEIJING ORIENTAL YUHONG-A    | 21,300  | 45.18  | 962,334.00   |
| CHIFENG JILONG GOLD MINING-A | 56,700  | 15.40  | 873,180.00   |
| CHINA JUSHI CO LTD -A        | 33,200  | 18.00  | 597,600.00   |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A    | 673,501 | 5.19   | 3,495,470.19 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 34,500  | 17.45  | 602,025.00   |
| GANFENG LITHIUM CO LTD-A     | 10,308  | 90.37  | 931,533.96   |
| GEM CO LTD-A                 | 39,400  | 8.41   | 331,354.00   |
| GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A | 28,700  | 5.08   | 145,796.00   |
| GUANGDONG HONGDA BLASTING -A | 9,000   | 30.03  | 270,270.00   |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 11,700  | 70.65  | 826,605.00   |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A  | 96,900  | 26.94  | 2,610,486.00 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO -A   | 35,148  | 13.85  | 486,799.80   |
| HESTEEL CO LTD-A             | 100,800 | 2.31   | 232,848.00   |
| HUAXIN CEMENT CO LTD-A       | 12,900  | 22.23  | 286,767.00   |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A  | 40,200  | 6.73   | 270,546.00   |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A  | 433,400 | 1.54   | 667,436.00   |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 80,316  | 5.17   | 415,233.72   |
| JIANGSU SHAGANG CO LTD -A    | 48,700  | 9.15   | 445,605.00   |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A | 2,900   | 111.60 | 323,640.00   |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A      | 19,700  | 21.62  | 425,914.00   |
| KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A   | 59,800  | 21.40  | 1,279,720.00 |
| LOMON BILLIONS GROUP CO -A   | 19,300  | 27.26  | 526,118.00   |
| PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 81,700  | 2.18   | 178,106.00   |
| RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A | 84,181  | 25.53  | 2,149,140.93 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 34,524  | 21.80  | 752,623.20   |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A   | 15,500  | 33.57  | 520,335.00   |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A  | 113,700 | 3.45   | 392,265.00   |



|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A | 9,200   | 40.36  | 371,312.00   |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A | 24,600  | 14.78  | 363,588.00   |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 8,600   | 86.90  | 747,340.00   |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A   | 54,100  | 4.47   | 241,827.00   |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 11,600  | 68.46  | 794,136.00   |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A | 1,000   | 23.55  | 23,550.00    |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A  | 58,100  | 3.52   | 204,512.00   |
| SKSHU PAINT CO LTD-A         | 6,900   | 193.10 | 1,332,390.00 |
| TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A | 12,800  | 15.65  | 200,320.00   |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A       | 17,600  | 19.08  | 335,808.00   |
| TONGLING NONFERROUS METALS-A | 100,100 | 2.66   | 266,266.00   |
| TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A    | 30,906  | 7.29   | 225,304.74   |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A  | 39,800  | 101.36 | 4,034,128.00 |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 4,900   | 70.40  | 344,960.00   |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A     | 13,400  | 17.07  | 228,738.00   |
| YINTAI GOLD CO LTD-A         | 26,460  | 9.13   | 241,579.80   |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A | 6,400   | 107.60 | 688,640.00   |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 10,250  | 61.65  | 631,912.50   |
| ZHEJIANG JUHUA CO-A          | 26,100  | 8.60   | 224,460.00   |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A | 30,900  | 14.62  | 451,758.00   |
| ZHONGJIN GOLD CORP-A         | 98,400  | 8.45   | 831,480.00   |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A  | 281,300 | 9.36   | 2,632,968.00 |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL-A   | 10,900  | 17.60  | 191,840.00   |
| AECC AVIATION POWER CO-A     | 36,700  | 44.55  | 1,634,985.00 |
| AVIC AVIATION HIGH-TECHNOL-A | 16,500  | 25.60  | 422,400.00   |
| AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A  | 34,300  | 9.62   | 329,966.00   |
| AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A | 20,600  | 60.48  | 1,245,888.00 |
| AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A | 26,300  | 24.10  | 633,830.00   |
| AVICOPTER PLC-A              | 5,500   | 46.72  | 256,960.00   |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 16,100  | 41.80  | 672,980.00   |
| CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A | 25,900  | 7.35   | 190,365.00   |
| CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A | 13,900  | 15.21  | 211,419.00   |
| CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A | 43,700  | 7.42   | 324,254.00   |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A    | 291,100 | 5.79   | 1,685,469.00 |
| CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A | 359,104 | 4.06   | 1,457,962.24 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A  | 533,680 | 5.15   | 2,748,452.00 |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 33,008  | 288.79 | 9,532,380.32 |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 26,100  | 12.70  | 331,470.00   |
| EAST GROUP CO LTD-A          | 1,000   | 6.37   | 6,370.00     |
| EVE ENERGY CO LTD-A          | 35,088  | 69.76  | 2,447,738.88 |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A | 36,143  | 8.27   | 298,902.61   |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A    | 10,800  | 36.77  | 397,116.00   |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A | 7,800   | 151.32 | 1,180,296.00 |
| HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A | 6,400   | 44.06  | 281,984.00   |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A   | 7,100   | 45.97  | 326,387.00   |
| INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A | 16,100  | 10.00  | 161,000.00   |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 12,432  | 83.68  | 1,040,309.76 |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A | 29,200  | 11.00  | 321,200.00   |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 169,634 | 3.07   | 520,776.38   |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A     | 75,200  | 30.81  | 2,316,912.00 |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 293,400 | 4.09   | 1,200,006.00 |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 111,916 | 33.99  | 3,804,024.84 |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A | 84,500  | 3.01   | 254,345.00   |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 77,300  | 5.60   | 432,880.00   |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 33,901  | 80.46  | 2,727,674.46 |
| SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A  | 14,800  | 11.90  | 176,120.00   |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 20,000  | 63.33  | 1,266,600.00 |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A  | 14,700  | 19.75  | 290,325.00   |
| SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A | 25,400  | 9.23   | 234,442.00   |
| TBEA CO LTD-A                | 35,200  | 11.23  | 395,296.00   |
| TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A | 26,700  | 20.58  | 549,486.00   |
| WEICHAI POWER CO LTD-A       | 201,351 | 18.81  | 3,787,412.31 |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A   | 74,400  | 6.98   | 519,312.00   |
| XIAMEN C & D INC-A           | 26,900  | 8.43   | 226,767.00   |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A | 32,800  | 13.56  | 444,768.00   |
| YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A | 18,200  | 59.20  | 1,077,440.00 |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A | 4,620   | 93.15  | 430,353.00   |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A | 34,113  | 20.40  | 695,905.20   |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A | 15,000  | 23.65  | 354,750.00   |
| ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A   | 21,000  | 14.05  | 295,050.00   |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A  | 143,900 | 11.85  | 1,705,215.00 |
| BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A | 30,000  | 7.99   | 239,700.00   |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 8,800   | 77.62  | 683,056.00   |
| AIR CHINA LTD-A              | 142,600 | 8.50   | 1,212,100.00 |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A  | 114,300 | 5.47   | 625,221.00   |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A  | 88,800  | 5.25   | 466,200.00   |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 205,800 | 6.64   | 1,366,512.00 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 83,300  | 10.96  | 912,968.00   |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A      | 249,689 | 6.82   | 1,702,878.98 |
| GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A | 19,688  | 13.31  | 262,047.28   |
| S F HOLDING CO LTD-A         | 69,700  | 82.15  | 5,725,855.00 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 9,100   | 58.26  | 530,166.00   |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 80,900  | 4.69   | 379,421.00   |
| SHENZHEN AIRPORT CO-A        | 19,500  | 8.60   | 167,700.00   |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| SINOTRANS LIMITED-A          | 41,600  | 4.30   | 178,880.00   |
| SPRING AIRLINES CO LTD-A     | 8,700   | 58.83  | 511,821.00   |
| STO EXPRESS CO LTD-A         | 37,900  | 9.28   | 351,712.00   |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A   | 75,200  | 11.20  | 842,240.00   |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A       | 18,460  | 15.08  | 278,376.80   |
| BYD CO LTD -A                | 33,900  | 162.74 | 5,516,886.00 |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | 2,600   | 183.30 | 476,580.00   |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A  | 37,000  | 14.08  | 520,960.00   |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A   | 73,700  | 10.84  | 798,908.00   |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 18,938  | 41.70  | 789,714.60   |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A    | 34,900  | 27.76  | 968,824.00   |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A  | 29,900  | 25.50  | 762,450.00   |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A  | 47,400  | 20.95  | 993,030.00   |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A  | 12,360  | 18.08  | 223,468.80   |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A  | 10,000  | 30.67  | 306,700.00   |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A        | 97,044  | 20.18  | 1,958,347.92 |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 11,400  | 44.79  | 510,606.00   |
| WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A  | 7,900   | 23.31  | 184,149.00   |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A    | 12,500  | 116.10 | 1,451,250.00 |
| GUANGDONG XINBAO ELECTRICA-A | 22,500  | 35.73  | 803,925.00   |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A    | 88,929  | 29.20  | 2,596,726.80 |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A  | 9,000   | 35.82  | 322,380.00   |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A | 12,400  | 78.39  | 972,036.00   |
| JOYOUNG CO LTD -A            | 4,600   | 29.40  | 135,240.00   |
| MIDEA GROUP CO LTD-A         | 59,600  | 81.68  | 4,868,128.00 |
| NAVINFO CO LTD-A             | 18,600  | 14.29  | 265,794.00   |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A      | 3,717   | 154.19 | 573,124.23   |
| SHENZHEN MTC CO LTD -A       | 1,000   | 5.32   | 5,320.00     |
| SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A | 8,700   | 35.08  | 305,196.00   |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A  | 128,600 | 9.77   | 1,256,422.00 |
| XIAMEN INTRETECH INC-A       | 1,200   | 63.65  | 76,380.00    |
| ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A  | 17,100  | 10.00  | 171,000.00   |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A     | 5,200   | 69.23  | 359,996.00   |
| OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A | 25,100  | 27.52  | 690,752.00   |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 6,400   | 50.38  | 322,432.00   |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A  | 78,000  | 8.90   | 694,200.00   |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 24,843  | 20.35  | 505,555.05   |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 27,900  | 11.69  | 326,151.00   |
| BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A | 31,200  | 23.32  | 727,584.00   |
| CHINA FILM CO LTD-A          | 14,700  | 14.45  | 212,415.00   |
| CHINA SOUTH PUBLISHING -A    | 17,000  | 10.72  | 182,240.00   |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 280,502 | 10.00  | 2,805,020.00 |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A  | 700     | 342.77   | 239,939.00    |
| GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A | 12,800  | 14.39    | 184,192.00    |
| LEO GROUP CO LTD-A           | 173,000 | 3.02     | 522,460.00    |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 25,280  | 56.55    | 1,429,584.00  |
| NANJI E-COMMERCE CO LTD-A    | 23,400  | 9.21     | 215,514.00    |
| ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A | 32,600  | 9.68     | 315,568.00    |
| PERFECT WORLD CO LTD-A       | 18,300  | 19.76    | 361,608.00    |
| WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A | 20,000  | 22.11    | 442,200.00    |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A  | 126,520 | 7.62     | 964,082.40    |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A | 27,599  | 295.04   | 8,142,808.96  |
| LIAONING CHENG DA CO LTD-A   | 14,500  | 20.89    | 302,905.00    |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A | 30,800  | 10.72    | 330,176.00    |
| SUNING.COM CO LTD-A          | 79,780  | 7.10     | 566,438.00    |
| WANGFUJING GROUP CO LTD-A    | 1,000   | 30.44    | 30,440.00     |
| WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A  | 48,200  | 4.85     | 233,770.00    |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 11,404  | 81.37    | 927,943.48    |
| LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A  | 3,780   | 67.10    | 253,638.00    |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 5,040   | 84.95    | 428,148.00    |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A | 91,000  | 6.82     | 620,620.00    |
| ANGEL YEAST CO LTD-A         | 7,800   | 52.30    | 407,940.00    |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 3,600   | 199.06   | 716,616.00    |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 5,625   | 59.22    | 333,112.50    |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 40,300  | 8.63     | 347,789.00    |
| BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A   | 7,000   | 46.48    | 325,360.00    |
| BEIJING YANJING BREWERY CO-A | 26,800  | 7.25     | 194,300.00    |
| CHACHA FOOD CO LTD-A         | 2,000   | 50.49    | 100,980.00    |
| CHONGQING BREWERY CO-A       | 4,600   | 100.69   | 463,174.00    |
| CHONGQING FULING ZHACAI-A    | 7,500   | 41.35    | 310,125.00    |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 40,286  | 146.51   | 5,902,301.86  |
| FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A | 5,900   | 195.55   | 1,153,745.00  |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A  | 9,800   | 27.10    | 265,580.00    |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A    | 25,019  | 75.74    | 1,894,939.06  |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE-A   | 16,900  | 16.10    | 272,090.00    |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 38,400  | 41.01    | 1,574,784.00  |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A  | 82,100  | 39.10    | 3,210,110.00  |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 11,890  | 47.40    | 563,586.00    |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A    | 19,681  | 157.75   | 3,104,677.75  |
| JIANGXI ZHENGBANG TECH -A    | 23,200  | 15.93    | 369,576.00    |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A       | 8,800   | 139.26   | 1,225,488.00  |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 7,600   | 45.80    | 348,080.00    |
| JUEWEI FOOD CO LTD-A         | 5,500   | 73.70    | 405,350.00    |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A     | 17,078  | 1,989.00 | 33,968,142.00 |

|                              |        |        |               |
|------------------------------|--------|--------|---------------|
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A      | 19,500 | 214.89 | 4,190,355.00  |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A    | 46,660 | 100.96 | 4,710,793.60  |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A      | 59,400 | 20.17  | 1,198,098.00  |
| QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A  | 1,000  | 34.80  | 34,800.00     |
| SANQUAN FOOD CO LTD-A        | 1,000  | 22.66  | 22,660.00     |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A | 12,605 | 99.10  | 1,249,155.50  |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 12,300 | 318.00 | 3,911,400.00  |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A    | 4,600  | 67.01  | 308,246.00    |
| TOLY BREAD CO LTD-A          | 5,200  | 48.22  | 250,744.00    |
| TONGWEI CO LTD-A             | 71,800 | 30.12  | 2,162,616.00  |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A    | 6,600  | 78.95  | 521,070.00    |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A | 89,540 | 17.13  | 1,533,820.20  |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A     | 55,300 | 260.80 | 14,422,240.00 |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 23,700 | 75.12  | 1,780,344.00  |
| YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A | 12,500 | 17.96  | 224,500.00    |
| BY-HEALTH CO LTD-A           | 15,000 | 26.90  | 403,500.00    |
| C&S PAPER CO LTD-A           | 8,799  | 24.43  | 214,959.57    |
| PROYA COSMETICS CO LTD-A     | 4,500  | 155.25 | 698,625.00    |
| SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A  | 6,400  | 47.35  | 303,040.00    |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 53,652 | 59.72  | 3,204,097.44  |
| AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A | 2,700  | 105.44 | 284,688.00    |
| CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A | 3,600  | 41.25  | 148,500.00    |
| CHINA NATIONAL MEDICINES-A   | 7,200  | 33.20  | 239,040.00    |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 4,400  | 121.98 | 536,712.00    |
| GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A | 7,700  | 79.95  | 615,615.00    |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A    | 16,640 | 38.20  | 635,648.00    |
| INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A | 7,400  | 158.20 | 1,170,680.00  |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A   | 7,600  | 71.32  | 542,032.00    |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A  | 9,500  | 26.04  | 247,380.00    |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A    | 17,800 | 17.85  | 317,730.00    |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A    | 16,960 | 28.49  | 483,190.40    |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 35,560 | 14.55  | 517,398.00    |
| OVCTEK CHINA INC-A           | 5,700  | 79.90  | 455,430.00    |
| SHANDONG PHARMACEUTICAL - A  | 1,000  | 36.94  | 36,940.00     |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A   | 18,300 | 19.09  | 349,347.00    |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 12,800 | 376.00 | 4,812,800.00  |
| TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A | 3,000  | 228.31 | 684,930.00    |
| WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A  | 20,020 | 15.62  | 312,712.40    |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO-A   | 15,000 | 26.14  | 392,100.00    |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A | 2,200  | 271.48 | 597,256.00    |
| BEIJING Tiantan Biological-A | 11,880 | 32.26  | 383,248.80    |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A | 3,800  | 105.70 | 401,660.00    |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| BGI GENOMICS CO LTD-A        | 3,800   | 116.16 | 441,408.00   |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A  | 5,200   | 397.95 | 2,069,340.00 |
| CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A | 6,900   | 35.72  | 246,468.00   |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 9,300   | 24.41  | 227,013.00   |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 21,098  | 176.85 | 3,731,181.30 |
| DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A  | 12,100  | 27.65  | 334,565.00   |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A        | 6,200   | 36.80  | 228,160.00   |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A  | 13,400  | 27.88  | 373,592.00   |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 7,089   | 129.27 | 916,395.03   |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 17,290  | 38.32  | 662,552.80   |
| HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A   | 7,800   | 20.10  | 156,780.00   |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A | 29,900  | 31.55  | 943,345.00   |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A | 65,336  | 86.52  | 5,652,870.72 |
| JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A | 11,100  | 15.77  | 175,047.00   |
| JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A | 10,700  | 20.28  | 216,996.00   |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A | 18,400  | 12.91  | 237,544.00   |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A | 5,800   | 41.14  | 238,612.00   |
| MACCURA BIOTECH CO LTD-A     | 1,000   | 40.85  | 40,850.00    |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A | 7,410   | 39.80  | 294,918.00   |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A | 10,780  | 23.04  | 248,371.20   |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A | 19,200  | 37.66  | 723,072.00   |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A | 57,900  | 7.58   | 438,882.00   |
| SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A | 9,900   | 17.55  | 173,745.00   |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 9,641   | 135.55 | 1,306,837.55 |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A    | 8,200   | 38.52  | 315,864.00   |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A | 11,500  | 23.60  | 271,400.00   |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 13,600  | 22.37  | 304,232.00   |
| TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A | 19,300  | 12.51  | 241,443.00   |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A    | 14,680  | 45.64  | 669,995.20   |
| WUXI APPTec CO LTD-A         | 26,176  | 123.32 | 3,228,024.32 |
| YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A | 11,700  | 21.18  | 247,806.00   |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 18,900  | 123.98 | 2,343,222.00 |
| ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A  | 9,200   | 263.31 | 2,422,452.00 |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A | 13,860  | 25.15  | 348,579.00   |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A        | 20,400  | 37.39  | 762,756.00   |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A | 5,000   | 54.35  | 271,750.00   |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 928,800 | 3.40   | 3,157,920.00 |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A    | 346,600 | 4.76   | 1,649,816.00 |
| BANK OF CHENGDU CO LTD-A     | 34,393  | 11.38  | 391,392.34   |
| BANK OF CHINA LTD-A          | 333,900 | 3.30   | 1,101,870.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A  | 506,033 | 4.66   | 2,358,113.78 |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A    | 48,700  | 16.54  | 805,498.00   |

|                              |         |        |               |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A     | 109,620 | 6.30   | 690,606.00    |
| BANK OF NANJING CO LTD -A    | 169,500 | 9.96   | 1,688,220.00  |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A     | 80,011  | 39.10  | 3,128,430.10  |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A    | 220,069 | 8.64   | 1,901,396.16  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A    | 91,200  | 7.15   | 652,080.00    |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A   | 563,010 | 4.08   | 2,297,080.80  |
| CHINA MERCHANTS BANK-A       | 333,399 | 52.20  | 17,403,427.80 |
| CHINA MINSHENG BANKING-A     | 430,928 | 5.21   | 2,245,134.88  |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 241,200 | 4.10   | 988,920.00    |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A | 1,000   | 4.34   | 4,340.00      |
| HUAXIA BANK CO LTD-A         | 198,750 | 6.43   | 1,277,962.50  |
| IND & COMM BK OF CHINA-A     | 646,128 | 5.41   | 3,495,552.48  |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A    | 273,374 | 22.56  | 6,167,317.44  |
| JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A | 26,000  | 7.90   | 205,400.00    |
| PING AN BANK CO LTD-A        | 252,461 | 20.53  | 5,183,024.33  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 592,600 | 5.77   | 3,419,302.00  |
| QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A | 30,300  | 4.50   | 136,350.00    |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 327,937 | 10.68  | 3,502,367.16  |
| AVIC CAPITAL CO LTD -A       | 85,300  | 4.07   | 347,171.00    |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 34,125  | 11.74  | 400,627.50    |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 52,500  | 7.17   | 376,425.00    |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 70,200  | 10.59  | 743,418.00    |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 58,000  | 11.08  | 642,640.00    |
| CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A | 32,692  | 52.36  | 1,711,753.12  |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 86,900  | 19.85  | 1,724,965.00  |
| CITIC SECURITIES CO-A        | 141,845 | 24.04  | 3,409,953.80  |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A       | 39,600  | 32.62  | 1,291,752.00  |
| DONGXING SECURITIES CO LT-A  | 26,200  | 11.20  | 293,440.00    |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A  | 104,097 | 27.07  | 2,817,905.79  |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A   | 37,200  | 17.97  | 668,484.00    |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 97,100  | 7.93   | 770,003.00    |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A  | 78,300  | 9.15   | 716,445.00    |
| GF SECURITIES CO LTD-A       | 101,100 | 15.71  | 1,588,281.00  |
| GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A | 60,500  | 14.68  | 888,140.00    |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A  | 51,600  | 16.85  | 869,460.00    |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A   | 39,000  | 12.05  | 469,950.00    |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 109,200 | 16.38  | 1,788,696.00  |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A  | 31,900  | 7.90   | 252,010.00    |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 133,879 | 11.92  | 1,595,837.68  |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 5,130   | 122.70 | 629,451.00    |
| HUAAN SECURITIES CO LTD-A    | 34,400  | 6.60   | 227,040.00    |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A   | 108,940 | 17.14  | 1,867,231.60  |

|                              |         |       |               |
|------------------------------|---------|-------|---------------|
| HUAXI SECURITIES CO LTD-A    | 24,900  | 10.18 | 253,482.00    |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A   | 63,600  | 8.69  | 552,684.00    |
| NANJING SECURITIES CO LTD-A  | 31,300  | 10.36 | 324,268.00    |
| NORTHEAST SECURITIES CO LT-A | 22,200  | 8.75  | 194,250.00    |
| OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A | 32,901  | 2.91  | 95,741.91     |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A   | 56,800  | 9.85  | 559,480.00    |
| PACIFIC SECURITIES CO/THE-A  | 64,800  | 3.34  | 216,432.00    |
| SDIC CAPITAL CO LTD-A        | 33,500  | 12.36 | 414,060.00    |
| SEALAND SECURITIES CO LTD -A | 40,000  | 4.62  | 184,800.00    |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A   | 26,900  | 7.19  | 193,411.00    |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A  | 339,514 | 4.71  | 1,599,110.94  |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD-A | 28,700  | 13.53 | 388,311.00    |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A  | 28,500  | 9.84  | 280,440.00    |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 53,700  | 4.76  | 255,612.00    |
| TIANFENG SECURITIES CO LTD-A | 115,900 | 5.22  | 604,998.00    |
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A  | 33,200  | 8.95  | 297,140.00    |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 74,000  | 13.55 | 1,002,700.00  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A    | 42,700  | 31.77 | 1,356,579.00  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 154,300 | 37.16 | 5,733,788.00  |
| HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A | 47,000  | 4.15  | 195,050.00    |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 31,386  | 48.11 | 1,509,980.46  |
| PICC HOLDING CO-A            | 81,000  | 5.96  | 482,760.00    |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 131,722 | 79.01 | 10,407,355.22 |
| CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A | 37,050  | 6.09  | 225,634.50    |
| CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A | 21,688  | 16.67 | 361,538.96    |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 75,223  | 12.61 | 948,562.03    |
| CHINA VANKE CO LTD -A        | 137,656 | 30.76 | 4,234,298.56  |
| FINANCIAL STREET HOLDINGS-A  | 28,300  | 7.46  | 211,118.00    |
| GEMDALE CORP-A               | 42,900  | 12.17 | 522,093.00    |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A | 77,200  | 5.54  | 427,688.00    |
| JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A | 35,200  | 7.10  | 249,920.00    |
| JINKE PROPERTIES GROUP CO -A | 50,700  | 6.91  | 350,337.00    |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 156,300 | 14.32 | 2,238,216.00  |
| RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A  | 41,300  | 6.47  | 267,211.00    |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A     | 21,500  | 45.54 | 979,110.00    |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A  | 45,200  | 18.58 | 839,816.00    |
| SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A   | 14,800  | 16.40 | 242,720.00    |
| XINHU ZHONGBAO CO LTD-A      | 81,700  | 3.05  | 249,185.00    |
| YANGO GROUP CO LTD-A         | 38,500  | 6.18  | 237,930.00    |
| YOUNGOR GROUP CO-A           | 106,400 | 8.18  | 870,352.00    |
| ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A | 35,800  | 3.12  | 111,696.00    |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 51,100  | 13.87 | 708,757.00    |



|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| BEIJING E-HUALU INFO TECH-A  | 17,160  | 24.50  | 420,420.00   |
| BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 8,400   | 31.52  | 264,768.00   |
| BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A  | 14,700  | 17.71  | 260,337.00   |
| BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A | 26,700  | 19.50  | 520,650.00   |
| CHINA NATIONAL SOFTWARE -A   | 4,700   | 52.13  | 245,011.00   |
| CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A | 14,100  | 16.02  | 225,882.00   |
| DHC SOFTWARE CO LTD -A       | 29,500  | 7.56   | 223,020.00   |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A   | 10,049  | 82.78  | 831,856.22   |
| IFLYTEK CO LTD - A           | 21,000  | 44.91  | 943,110.00   |
| LAKALA PAYMENT CO LTD-A      | 1,000   | 29.07  | 29,070.00    |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A   | 3,200   | 225.24 | 720,768.00   |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 8,000   | 54.76  | 438,080.00   |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 3,300   | 119.40 | 394,020.00   |
| WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A | 23,200  | 6.48   | 150,336.00   |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A  | 47,115  | 33.82  | 1,593,429.30 |
| ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A  | 6,400   | 21.75  | 139,200.00   |
| ADDSINO CO LTD -A            | 15,000  | 18.79  | 281,850.00   |
| AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A  | 10,000  | 65.73  | 657,300.00   |
| BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A | 17,600  | 44.39  | 781,264.00   |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 452,400 | 6.26   | 2,832,024.00 |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 16,597  | 36.48  | 605,458.56   |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 27,800  | 14.84  | 412,552.00   |
| FIBERHOME TELECOM TECH CO-A  | 11,100  | 18.32  | 203,352.00   |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 88,700  | 13.86  | 1,229,382.00 |
| GOERTEK INC -A               | 47,300  | 25.21  | 1,192,433.00 |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO -A  | 22,900  | 10.36  | 237,244.00   |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A | 21,800  | 10.14  | 221,052.00   |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 8,400   | 120.22 | 1,009,848.00 |
| HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A | 18,000  | 12.04  | 216,720.00   |
| HUAGONG TECH CO LTD-A        | 33,500  | 21.42  | 717,570.00   |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A | 12,300  | 28.14  | 346,122.00   |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A     | 63,100  | 24.30  | 1,533,330.00 |
| LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A | 24,200  | 6.92   | 167,464.00   |
| LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A | 54,200  | 8.19   | 443,898.00   |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 79,812  | 32.40  | 2,585,908.80 |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 1,900   | 566.00 | 1,075,400.00 |
| NINESTAR CORP-A              | 10,100  | 25.30  | 255,530.00   |
| OFILM GROUP CO LTD-A         | 25,700  | 8.32   | 213,824.00   |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A | 21,600  | 22.12  | 477,792.00   |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A    | 4,480   | 90.00  | 403,200.00   |
| SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A  | 29,600  | 19.54  | 578,384.00   |
| SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A | 9,200   | 27.02  | 248,584.00   |

|                              |         |        |              |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A  | 15,300  | 17.99  | 275,247.00   |
| TIANJIN712 COMMUNICATION &-A | 9,000   | 34.21  | 307,890.00   |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A    | 19,400  | 14.27  | 276,838.00   |
| UNISPLENDOR CORP LTD-A       | 38,248  | 19.51  | 746,218.48   |
| UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A | 13,800  | 17.31  | 238,878.00   |
| VISIONOX TECHNOLOGY INC-A    | 13,000  | 9.89   | 128,570.00   |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 25,000  | 98.21  | 2,455,250.00 |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 15,130  | 34.88  | 527,734.40   |
| WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A  | 20,000  | 7.59   | 151,800.00   |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A | 16,400  | 16.54  | 271,256.00   |
| WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A | 8,400   | 72.00  | 604,800.00   |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 7,050   | 63.98  | 451,059.00   |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A  | 28,500  | 22.94  | 653,790.00   |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A   | 5,700   | 34.41  | 196,137.00   |
| ZTE CORP-A                   | 44,200  | 29.05  | 1,284,010.00 |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 360,064 | 20.78  | 7,482,129.92 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A    | 64,400  | 3.48   | 224,112.00   |
| HUANENG POWER INTL INC-A     | 157,200 | 4.53   | 712,116.00   |
| LUENMEI QUANTUM CO LTD-A     | 15,000  | 10.89  | 163,350.00   |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 64,500  | 9.73   | 627,585.00   |
| SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A | 24,800  | 8.38   | 207,824.00   |
| SHENERGY COMPANY LIMITED-A   | 46,600  | 5.90   | 274,940.00   |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A | 37,560  | 11.13  | 418,042.80   |
| SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A | 41,800  | 11.91  | 497,838.00   |
| GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A | 48,300  | 3.42   | 165,186.00   |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A | 4,340   | 166.96 | 724,606.40   |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 13,700  | 74.92  | 1,026,404.00 |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 12,500  | 23.33  | 291,625.00   |
| INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A  | 10,100  | 52.96  | 534,896.00   |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 29,000  | 25.67  | 744,430.00   |
| JCET GROUP CO LTD-A          | 47,200  | 33.17  | 1,565,624.00 |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 50,434  | 76.79  | 3,872,826.86 |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A  | 8,100   | 134.10 | 1,086,210.00 |
| SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A | 65,200  | 23.50  | 1,532,200.00 |
| SG MICRO CORP-A              | 2,700   | 205.60 | 555,120.00   |
| SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A | 7,400   | 107.55 | 795,870.00   |
| SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A | 8,600   | 97.88  | 841,768.00   |
| TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A | 26,500  | 28.49  | 754,985.00   |
| TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A | 51,100  | 11.38  | 581,518.00   |
| TONGFU MICROELECTRONIC CO-A  | 29,100  | 19.20  | 558,720.00   |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 5,700   | 100.01 | 570,057.00   |
| WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A  | 10,100  | 245.70 | 2,481,570.00 |

|                |                              |            |        |                                   |  |
|----------------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
|                | WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A    | 58,800     | 8.46   | 497,448.00                        |  |
|                | ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 29,700     | 31.68  | 940,896.00                        |  |
|                | オフショア元 小計                    | 27,099,686 |        | 511,106,616.94<br>(8,530,369,436) |  |
| サウジアラビア<br>リアル | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 54,323     | 17.02  | 924,577.46                        |  |
|                | SAUDI ARABIAN OIL CO         | 500,443    | 34.90  | 17,465,460.70                     |  |
|                | ADVANCED PETROCHEMICALS CO   | 24,298     | 67.90  | 1,649,834.20                      |  |
|                | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 82,000     | 15.18  | 1,244,760.00                      |  |
|                | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO      | 48,947     | 96.00  | 4,698,912.00                      |  |
|                | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 77,416     | 20.04  | 1,551,416.64                      |  |
|                | SAUDI ARABIAN MINING CO      | 96,228     | 52.10  | 5,013,478.80                      |  |
|                | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP  | 205,324    | 108.00 | 22,174,992.00                     |  |
|                | SAUDI CEMENT                 | 16,059     | 64.80  | 1,040,623.20                      |  |
|                | SAUDI IND INVESTMENT GROUP   | 49,895     | 29.50  | 1,471,902.50                      |  |
|                | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 175,108    | 15.42  | 2,700,165.36                      |  |
|                | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 58,032     | 67.90  | 3,940,372.80                      |  |
|                | SAUDI AIRLINES CATERING CO   | 10,865     | 76.30  | 828,999.50                        |  |
|                | JARIR MARKETING CO           | 12,646     | 173.00 | 2,187,758.00                      |  |
|                | ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS   | 8,000      | 129.00 | 1,032,000.00                      |  |
|                | ALMARAI CO                   | 57,048     | 52.10  | 2,972,200.80                      |  |
|                | SAVOLA                       | 52,366     | 38.60  | 2,021,327.60                      |  |
|                | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 10,808     | 118.20 | 1,277,505.60                      |  |
|                | AL RAJHI BANK                | 280,402    | 93.50  | 26,217,587.00                     |  |
|                | ALINMA BANK                  | 230,293    | 17.56  | 4,043,945.08                      |  |
|                | ARAB NATIONAL BANK           | 124,746    | 20.62  | 2,572,262.52                      |  |
|                | BANK AL-JAZIRA               | 114,405    | 14.96  | 1,711,498.80                      |  |
|                | BANK ALBILAD                 | 87,410     | 33.25  | 2,906,382.50                      |  |
|                | BANQUE SAUDI FRANSI          | 128,952    | 31.25  | 4,029,750.00                      |  |
|                | NATIONAL COMMERCIAL BANK     | 335,913    | 48.60  | 16,325,371.80                     |  |
|                | RIYAD BANK                   | 293,089    | 21.60  | 6,330,722.40                      |  |
|                | SAMBA FINANCIAL GROUP        | 226,365    | 35.20  | 7,968,048.00                      |  |
|                | SAUDI BRITISH BANK           | 201,932    | 25.10  | 5,068,493.20                      |  |
|                | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE  | 13,218     | 115.20 | 1,522,713.60                      |  |
|                | CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | 14,550     | 78.30  | 1,139,265.00                      |  |
|                | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 117,066    | 9.29   | 1,087,543.14                      |  |
|                | EMAAR ECONOMIC CITY          | 89,567     | 11.00  | 985,237.00                        |  |
|                | ETIHAD ETISALAT CO           | 87,547     | 29.65  | 2,595,768.55                      |  |
|                | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 88,113     | 14.56  | 1,282,925.28                      |  |
|                | SAUDI TELECOM CO             | 137,152    | 116.60 | 15,991,923.20                     |  |
|                | SAUDI ELECTRICITY CO         | 178,825    | 21.30  | 3,808,972.50                      |  |
|                | サウジアラビアリアル 小計                | 4,289,351  |        | 179,784,696.73<br>(5,226,341,133) |  |

|            |                              |               |        |                 |                   |
|------------|------------------------------|---------------|--------|-----------------|-------------------|
| トルコリラ      | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 29,380        | 92.10  | 2,705,898.00    |                   |
|            | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 294,834       | 14.35  | 4,230,867.90    |                   |
|            | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI    | 166,850       | 15.29  | 2,551,136.50    |                   |
|            | KOC HOLDING AS               | 155,842       | 20.32  | 3,166,709.44    |                   |
|            | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 272,686       | 7.38   | 2,012,422.68    |                   |
|            | TURK HAVA YOLLARI AO         | 132,085       | 13.01  | 1,718,425.85    |                   |
|            | FORD OTOMOTIV SANAYI AS      | 14,221        | 207.20 | 2,946,591.20    |                   |
|            | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS    | 96,899        | 69.00  | 6,686,031.00    |                   |
|            | AKBANK T.A.S.                | 562,940       | 4.91   | 2,764,035.40    |                   |
|            | TURKIYE GARANTI BANKASI      | 460,073       | 7.20   | 3,312,525.60    |                   |
|            | TURKIYE IS BANKASI-C         | 268,383       | 4.95   | 1,328,495.85    |                   |
|            | YAPI VE KREDI BANKASI        | 515,884       | 2.23   | 1,150,421.32    |                   |
|            | HACI OMER SABANCI HOLDING    | 221,002       | 8.75   | 1,933,767.50    |                   |
|            | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS  | 252,686       | 15.15  | 3,828,192.90    |                   |
| トルコリラ 小計   |                              | 3,443,765     |        | 40,335,521.14   | (556,630,191)     |
| ユーロ        | FF GROUP                     | 5,889         | 4.80   | 28,267.20       |                   |
|            | OPAP SA                      | 48,759        | 11.23  | 547,563.57      |                   |
|            | JUMBO SA                     | 22,412        | 15.04  | 337,076.48      |                   |
|            | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 52,724        | 13.44  | 708,610.56      |                   |
| ユーロ 小計     |                              | 129,784       |        | 1,621,517.81    | (208,608,266)     |
| カタールリアル    | QATAR FUEL QSC               | 112,465       | 17.12  | 1,925,400.80    |                   |
|            | QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT) | 488,719       | 3.12   | 1,526,758.15    |                   |
|            | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 1,036,433     | 1.85   | 1,917,401.05    |                   |
|            | INDUSTRIES QATAR             | 364,461       | 11.85  | 4,318,862.85    |                   |
|            | COMMERCIAL BANK PSQC         | 434,616       | 4.52   | 1,966,202.78    |                   |
|            | MASRAF AL RAYAN              | 789,908       | 4.16   | 3,287,597.09    |                   |
|            | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC  | 191,996       | 8.63   | 1,656,925.48    |                   |
|            | QATAR ISLAMIC BANK           | 254,198       | 16.15  | 4,105,297.70    |                   |
|            | QATAR NATIONAL BANK          | 1,030,574     | 17.40  | 17,931,987.60   |                   |
|            | BARWA REAL ESTATE CO         | 648,638       | 3.15   | 2,047,101.52    |                   |
|            | OOREDOO QPSC                 | 167,287       | 6.85   | 1,145,915.95    |                   |
|            | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 112,139       | 17.03  | 1,909,727.17    |                   |
| カタールリアル 小計 |                              | 5,631,434     |        | 43,739,178.14   | (1,296,429,240)   |
| 合 計        |                              | 1,461,729,269 |        | 196,269,499,593 | (196,269,499,593) |

(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 | 692,300 | 16,379,818.00                 |    |
| メキシコペソ合計   |      |                             | 692,300 | 16,379,818.00<br>(85,338,851) |    |
| 南アフリカランド   | 投資証券 | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD  | 798,950 | 10,434,287.00                 |    |
| 南アフリカランド合計 |      |                             | 798,950 | 10,434,287.00<br>(76,065,952) |    |
| 合計         |      |                             |         | 161,404,803<br>(161,404,803)  |    |

(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<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|----------|--------------|----------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 株式 69銘柄  | 100.00%      | —              | 15.39%                  |
| イギリスポンド    | 株式 1銘柄   | 100.00%      | —              | 0.06%                   |
| 香港ドル       | 株式 201銘柄 | 100.00%      | —              | 21.71%                  |
| マレーシアリングット | 株式 38銘柄  | 100.00%      | —              | 1.45%                   |
| タイバーツ      | 株式 43銘柄  | 100.00%      | —              | 1.90%                   |
| フィリピンペソ    | 株式 20銘柄  | 100.00%      | —              | 0.66%                   |
| インドネシアルピア  | 株式 22銘柄  | 100.00%      | —              | 1.29%                   |
| メキシコペソ     | 株式 23銘柄  | 97.46%       | —              | 1.67%                   |
|            | 投資証券 1銘柄 | —            | 2.54%          | 0.04%                   |
| ブラジルリアル    | 株式 53銘柄  | 100.00%      | —              | 4.38%                   |
| チリペソ       | 株式 14銘柄  | 100.00%      | —              | 0.57%                   |
| 韓国ウォン      | 株式 111銘柄 | 100.00%      | —              | 13.28%                  |
| ニュー台湾ドル    | 株式 87銘柄  | 100.00%      | —              | 13.77%                  |
| インドルピー     | 株式 96銘柄  | 100.00%      | —              | 9.87%                   |
| チェココルナ     | 株式 3銘柄   | 100.00%      | —              | 0.11%                   |
| クウェートディナール | 株式 8銘柄   | 100.00%      | —              | 0.52%                   |
| コロンビアペソ    | 株式 5銘柄   | 100.00%      | —              | 0.17%                   |
| ハンガリーフォリント | 株式 3銘柄   | 100.00%      | —              | 0.21%                   |
| アラブディルハム   | 株式 8銘柄   | 100.00%      | —              | 0.55%                   |
| ポーランドズロチ   | 株式 14銘柄  | 100.00%      | —              | 0.63%                   |
| 南アフリカランド   | 株式 36銘柄  | 98.96%       | —              | 3.68%                   |
|            | 投資証券 1銘柄 | —            | 1.04%          | 0.04%                   |

|            |    |       |         |   |       |
|------------|----|-------|---------|---|-------|
| オフショア元     | 株式 | 465銘柄 | 100.00% | — | 4.34% |
| サウジアラビアリアル | 株式 | 36銘柄  | 100.00% | — | 2.66% |
| トルコリラ      | 株式 | 14銘柄  | 100.00% | — | 0.28% |
| ユーロ        | 株式 | 4銘柄   | 100.00% | — | 0.11% |
| カタールリアル    | 株式 | 12銘柄  | 100.00% | — | 0.66% |

## 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。

## 国内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 3年 3月25日現在]

|             |                 |
|-------------|-----------------|
| 資産の部        |                 |
| 流動資産        |                 |
| コール・ローン     | 4,395,790,617   |
| 国債証券        | 123,713,903,490 |
| 地方債証券       | 7,685,595,120   |
| 特殊債券        | 9,403,243,313   |
| 社債券         | 8,198,171,500   |
| 派生商品評価勘定    | 1,676,700       |
| 未収入金        | 142,200         |
| 未収利息        | 110,409,186     |
| 前払費用        | 43,685,546      |
| 差入委託証拠金     | 2,250,000       |
| 流動資産合計      | 153,554,867,672 |
| 資産合計        | 153,554,867,672 |
| 負債の部        |                 |
| 流動負債        |                 |
| 前受金         | 1,920,000       |
| 未払金         | 3,223,291,369   |
| 未払解約金       | 57,001,771      |
| 未払利息        | 762             |
| 流動負債合計      | 3,282,213,902   |
| 負債合計        | 3,282,213,902   |
| 純資産の部       |                 |
| 元本等         |                 |
| 元本          | 153,713,789,372 |
| 剰余金         |                 |
| 剰余金又は欠損金（△） | △3,441,135,602  |
| 元本等合計       | 150,272,653,770 |
| 純資産合計       | 150,272,653,770 |
| 負債純資産合計     | 153,554,867,672 |

### 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 3年 3月25日現在]  |
|--------------------------------------------|------------------|
| 1. 期首                                      | 令和 2年 3月26日      |
| 期首元本額                                      | 11,365,228,834円  |
| 期中追加設定元本額                                  | 504,528,806,599円 |
| 期中一部解約元本額                                  | 362,180,246,061円 |
| 元本の内訳※                                     |                  |
| ファンド・マネジャー（国内債券）                           | 41,579,749円      |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）                  | 9,701,405,852円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）                 | 170,343,058円     |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）             | 4,657,584,843円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）                  | 7,533,837,147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）    | 20,155,888,888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）   | 7,838,296,860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）          | 22,836,966,973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）    | 1,873,532,743円   |
| MUKAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）            | 38,751,551,795円  |
| MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定） | 39,778,715,081円  |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）  | 374,086,383円     |
| 合計                                         | 153,713,789,372円 |
| 2. 元本の欠損                                   |                  |
| 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。                | 3,441,135,602円   |
| 3. 受益権の総数                                  | 153,713,789,372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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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。<br>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。<br>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。<br>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 3年 3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<br>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。<br>（２）デリバティブ取引<br>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。<br>（３）上記以外の金融商品<br>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 3年 3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 | △265,886,810       |



|       |              |
|-------|--------------|
| 地方債証券 | △32,285,090  |
| 特殊債券  | △33,341,069  |
| 社債券   | 8,553,400    |
| 合計    | △322,959,569 |

(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 3年 3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     | 452,340,000 | —     | 454,020,000 | 1,680,000 |
| 合計   |        | 452,340,000 | —     | 454,020,000 | 1,680,000 |

（注）時価の算定方法

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

（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 3年 3月25日現在〕 |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.9776円         |
| (1万口当たり純資産額) | (9,776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４１１回利付国債（２年） | 160,000,000   | 160,364,800   |    |
|      | 第４１３回利付国債（２年） | 900,000,000   | 902,394,000   |    |
|      | 第４１４回利付国債（２年） | 800,000,000   | 802,280,000   |    |
|      | 第４１５回利付国債（２年） | 250,000,000   | 250,777,500   |    |
|      | 第４１７回利付国債（２年） | 430,000,000   | 431,535,100   |    |
|      | 第４１８回利付国債（２年） | 400,000,000   | 401,508,000   |    |
|      | 第４１９回利付国債（２年） | 400,000,000   | 401,584,000   |    |
|      | 第４２０回利付国債（２年） | 730,000,000   | 733,036,800   |    |
|      | 第４２１回利付国債（２年） | 800,000,000   | 803,488,000   |    |
|      | 第４２２回利付国債（２年） | 370,000,000   | 371,683,500   |    |
|      | 第１３２回利付国債（５年） | 1,300,000,000 | 1,303,536,000 |    |
|      | 第１３３回利付国債（５年） | 280,000,000   | 280,938,000   |    |
|      | 第１３４回利付国債（５年） | 400,000,000   | 401,600,000   |    |
|      | 第１３５回利付国債（５年） | 1,500,000,000 | 1,506,855,000 |    |
|      | 第１３６回利付国債（５年） | 1,610,000,000 | 1,618,291,500 |    |
|      | 第１３７回利付国債（５年） | 1,900,000,000 | 1,910,906,000 |    |
|      | 第１３８回利付国債（５年） | 2,000,000,000 | 2,012,620,000 |    |
|      | 第１３９回利付国債（５年） | 500,000,000   | 503,440,000   |    |
|      | 第１４０回利付国債（５年） | 1,890,000,000 | 1,904,118,300 |    |
|      | 第１４１回利付国債（５年） | 1,220,000,000 | 1,229,613,600 |    |
|      | 第１４２回利付国債（５年） | 2,213,000,000 | 2,231,677,720 |    |
|      | 第１４３回利付国債（５年） | 1,090,000,000 | 1,099,592,000 |    |
|      | 第１４４回利付国債（５年） | 1,210,000,000 | 1,221,071,500 |    |
|      | 第１４５回利付国債（５年） | 1,740,000,000 | 1,756,860,600 |    |
|      | 第１４６回利付国債（５年） | 1,400,000,000 | 1,413,314,000 |    |
|      | 第１回利付国債（４０年）  | 50,000,000    | 72,586,500    |    |
|      | 第２回利付国債（４０年）  | 40,000,000    | 56,416,000    |    |
|      | 第３回利付国債（４０年）  | 80,000,000    | 113,423,200   |    |
|      | 第４回利付国債（４０年）  | 250,000,000   | 356,630,000   |    |
|      | 第５回利付国債（４０年）  | 330,000,000   | 456,066,600   |    |
|      | 第６回利付国債（４０年）  | 241,000,000   | 328,596,270   |    |
|      | 第７回利付国債（４０年）  | 300,000,000   | 394,119,000   |    |
|      | 第８回利付国債（４０年）  | 370,000,000   | 455,481,100   |    |
|      | 第９回利付国債（４０年）  | 570,000,000   | 526,377,900   |    |
|      | 第１０回利付国債（４０年） | 510,000,000   | 551,197,800   |    |
|      | 第１１回利付国債（４０年） | 400,000,000   | 419,764,000   |    |
|      | 第１２回利付国債（４０年） | 481,000,000   | 456,238,120   |    |
|      | 第１３回利付国債（４０年） | 450,000,000   | 426,352,500   |    |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第323回利付国債（10年） | 700,000,000   | 708,834,000   |  |
| 第324回利付国債（10年） | 500,000,000   | 505,690,000   |  |
| 第325回利付国債（10年） | 1,500,000,000 | 1,520,565,000 |  |
| 第326回利付国債（10年） | 200,000,000   | 202,872,000   |  |
| 第327回利付国債（10年） | 300,000,000   | 304,830,000   |  |
| 第328回利付国債（10年） | 900,000,000   | 912,969,000   |  |
| 第329回利付国債（10年） | 400,000,000   | 408,292,000   |  |
| 第330回利付国債（10年） | 200,000,000   | 204,616,000   |  |
| 第331回利付国債（10年） | 300,000,000   | 305,427,000   |  |
| 第332回利付国債（10年） | 100,000,000   | 101,991,000   |  |
| 第333回利付国債（10年） | 1,400,000,000 | 1,430,394,000 |  |
| 第335回利付国債（10年） | 370,000,000   | 378,032,700   |  |
| 第336回利付国債（10年） | 600,000,000   | 613,962,000   |  |
| 第338回利付国債（10年） | 400,000,000   | 408,324,000   |  |
| 第339回利付国債（10年） | 1,230,000,000 | 1,256,961,600 |  |
| 第340回利付国債（10年） | 750,000,000   | 767,422,500   |  |
| 第341回利付国債（10年） | 300,000,000   | 305,784,000   |  |
| 第342回利付国債（10年） | 510,000,000   | 514,977,600   |  |
| 第343回利付国債（10年） | 1,750,000,000 | 1,767,010,000 |  |
| 第344回利付国債（10年） | 960,000,000   | 969,523,200   |  |
| 第345回利付国債（10年） | 1,510,000,000 | 1,525,220,800 |  |
| 第346回利付国債（10年） | 1,250,000,000 | 1,262,762,500 |  |
| 第347回利付国債（10年） | 1,050,000,000 | 1,060,846,500 |  |
| 第348回利付国債（10年） | 1,130,000,000 | 1,141,774,600 |  |
| 第349回利付国債（10年） | 1,280,000,000 | 1,293,414,400 |  |
| 第350回利付国債（10年） | 1,620,000,000 | 1,637,026,200 |  |
| 第351回利付国債（10年） | 620,000,000   | 626,069,800   |  |
| 第352回利付国債（10年） | 1,380,000,000 | 1,392,930,600 |  |
| 第353回利付国債（10年） | 1,003,000,000 | 1,011,926,700 |  |
| 第354回利付国債（10年） | 1,210,000,000 | 1,219,655,800 |  |
| 第355回利付国債（10年） | 1,070,000,000 | 1,077,918,000 |  |
| 第356回利付国債（10年） | 1,250,000,000 | 1,258,462,500 |  |
| 第357回利付国債（10年） | 930,000,000   | 935,663,700   |  |
| 第358回利付国債（10年） | 860,000,000   | 864,231,200   |  |
| 第359回利付国債（10年） | 1,160,000,000 | 1,164,790,800 |  |
| 第360回利付国債（10年） | 1,340,000,000 | 1,343,778,800 |  |
| 第361回利付国債（10年） | 1,130,000,000 | 1,132,180,900 |  |
| 第5回利付国債（30年）   | 50,000,000    | 60,612,000    |  |
| 第7回利付国債（30年）   | 50,000,000    | 61,959,500    |  |
| 第10回利付国債（30年）  | 50,000,000    | 55,526,000    |  |
| 第12回利付国債（30年）  | 100,000,000   | 123,600,000   |  |
| 第14回利付国債（30年）  | 190,000,000   | 243,359,600   |  |

|               |             |             |  |
|---------------|-------------|-------------|--|
| 第１５回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 129,740,000 |  |
| 第１６回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 130,121,000 |  |
| 第１７回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 129,154,000 |  |
| 第１８回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 128,130,000 |  |
| 第２０回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 131,641,000 |  |
| 第２１回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 129,045,000 |  |
| 第２２回利付国債（３０年） | 160,000,000 | 211,686,400 |  |
| 第２３回利付国債（３０年） | 200,000,000 | 265,266,000 |  |
| 第２４回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 133,052,000 |  |
| 第２５回利付国債（３０年） | 410,000,000 | 534,426,800 |  |
| 第２６回利付国債（３０年） | 300,000,000 | 396,390,000 |  |
| 第２７回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 134,352,000 |  |
| 第２８回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 135,006,000 |  |
| 第２９回利付国債（３０年） | 370,000,000 | 495,400,400 |  |
| 第３０回利付国債（３０年） | 300,000,000 | 398,298,000 |  |
| 第３１回利付国債（３０年） | 100,000,000 | 131,438,000 |  |
| 第３２回利付国債（３０年） | 330,000,000 | 441,404,700 |  |
| 第３３回利付国債（３０年） | 400,000,000 | 515,236,000 |  |
| 第３４回利付国債（３０年） | 520,000,000 | 691,917,200 |  |
| 第３５回利付国債（３０年） | 480,000,000 | 623,064,000 |  |
| 第３６回利付国債（３０年） | 460,000,000 | 598,998,200 |  |
| 第３７回利付国債（３０年） | 590,000,000 | 759,105,800 |  |
| 第３８回利付国債（３０年） | 340,000,000 | 431,820,400 |  |
| 第３９回利付国債（３０年） | 310,000,000 | 400,854,800 |  |
| 第４０回利付国債（３０年） | 331,000,000 | 421,389,480 |  |
| 第４１回利付国債（３０年） | 270,000,000 | 338,566,500 |  |
| 第４２回利付国債（３０年） | 310,000,000 | 389,090,300 |  |
| 第４３回利付国債（３０年） | 430,000,000 | 540,226,200 |  |
| 第４４回利付国債（３０年） | 260,000,000 | 326,952,600 |  |
| 第４５回利付国債（３０年） | 370,000,000 | 449,461,200 |  |
| 第４６回利付国債（３０年） | 360,000,000 | 437,562,000 |  |
| 第４７回利付国債（３０年） | 510,000,000 | 631,946,100 |  |
| 第４８回利付国債（３０年） | 356,000,000 | 425,434,240 |  |
| 第４９回利付国債（３０年） | 400,000,000 | 478,196,000 |  |
| 第５０回利付国債（３０年） | 380,000,000 | 401,306,600 |  |
| 第５１回利付国債（３０年） | 390,000,000 | 365,960,400 |  |
| 第５２回利付国債（３０年） | 470,000,000 | 462,677,400 |  |
| 第５３回利付国債（３０年） | 430,000,000 | 433,379,800 |  |
| 第５４回利付国債（３０年） | 320,000,000 | 337,801,600 |  |
| 第５５回利付国債（３０年） | 470,000,000 | 495,798,300 |  |
| 第５６回利付国債（３０年） | 300,000,000 | 316,242,000 |  |
| 第５７回利付国債（３０年） | 420,000,000 | 442,411,200 |  |

|                |             |             |  |
|----------------|-------------|-------------|--|
| 第５８回利付国債（３０年）  | 640,000,000 | 673,632,000 |  |
| 第５９回利付国債（３０年）  | 300,000,000 | 308,103,000 |  |
| 第６０回利付国債（３０年）  | 290,000,000 | 312,370,600 |  |
| 第６１回利付国債（３０年）  | 428,000,000 | 439,217,880 |  |
| 第６２回利付国債（３０年）  | 420,000,000 | 408,954,000 |  |
| 第６３回利付国債（３０年）  | 330,000,000 | 312,176,700 |  |
| 第６４回利付国債（３０年）  | 420,000,000 | 396,664,800 |  |
| 第６５回利付国債（３０年）  | 330,000,000 | 311,150,400 |  |
| 第６６回利付国債（３０年）  | 480,000,000 | 451,833,600 |  |
| 第６７回利付国債（３０年）  | 450,000,000 | 446,665,500 |  |
| 第６８回利付国債（３０年）  | 220,000,000 | 218,086,000 |  |
| 第６９回利付国債（３０年）  | 430,000,000 | 437,537,900 |  |
| 第５６回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 102,623,000 |  |
| 第５９回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 103,176,000 |  |
| 第６３回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 104,315,000 |  |
| 第６４回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 105,053,000 |  |
| 第６５回利付国債（２０年）  | 270,000,000 | 285,014,700 |  |
| 第６６回利付国債（２０年）  | 430,000,000 | 452,729,800 |  |
| 第６８回利付国債（２０年）  | 200,000,000 | 213,892,000 |  |
| 第７０回利付国債（２０年）  | 50,000,000  | 54,092,500  |  |
| 第７２回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 107,775,000 |  |
| 第７５回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 108,864,000 |  |
| 第７７回利付国債（２０年）  | 150,000,000 | 162,696,000 |  |
| 第７８回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 108,553,000 |  |
| 第８０回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 109,404,000 |  |
| 第８１回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 109,515,000 |  |
| 第８３回利付国債（２０年）  | 200,000,000 | 220,940,000 |  |
| 第８４回利付国債（２０年）  | 200,000,000 | 219,990,000 |  |
| 第８６回利付国債（２０年）  | 140,000,000 | 156,788,800 |  |
| 第８９回利付国債（２０年）  | 200,000,000 | 224,032,000 |  |
| 第９０回利付国債（２０年）  | 300,000,000 | 337,701,000 |  |
| 第９２回利付国債（２０年）  | 300,000,000 | 337,593,000 |  |
| 第９３回利付国債（２０年）  | 50,000,000  | 56,219,000  |  |
| 第９４回利付国債（２０年）  | 60,000,000  | 67,822,800  |  |
| 第９５回利付国債（２０年）  | 400,000,000 | 459,228,000 |  |
| 第９６回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 113,555,000 |  |
| 第９７回利付国債（２０年）  | 100,000,000 | 114,719,000 |  |
| 第９８回利付国債（２０年）  | 200,000,000 | 228,136,000 |  |
| 第９９回利付国債（２０年）  | 300,000,000 | 343,716,000 |  |
| 第１００回利付国債（２０年） | 50,000,000  | 57,884,000  |  |
| 第１０１回利付国債（２０年） | 200,000,000 | 234,338,000 |  |
| 第１０２回利付国債（２０年） | 200,000,000 | 235,326,000 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第103回利付国債（20年） | 200,000,000   | 233,876,000   |  |
| 第105回利付国債（20年） | 90,000,000    | 104,346,900   |  |
| 第106回利付国債（20年） | 140,000,000   | 163,367,400   |  |
| 第107回利付国債（20年） | 100,000,000   | 116,382,000   |  |
| 第108回利付国債（20年） | 300,000,000   | 344,499,000   |  |
| 第109回利付国債（20年） | 300,000,000   | 345,504,000   |  |
| 第110回利付国債（20年） | 100,000,000   | 116,765,000   |  |
| 第111回利付国債（20年） | 40,000,000    | 47,208,400    |  |
| 第112回利付国債（20年） | 500,000,000   | 585,990,000   |  |
| 第113回利付国債（20年） | 620,000,000   | 729,268,800   |  |
| 第114回利付国債（20年） | 100,000,000   | 118,089,000   |  |
| 第115回利付国債（20年） | 100,000,000   | 118,961,000   |  |
| 第116回利付国債（20年） | 150,000,000   | 179,002,500   |  |
| 第117回利付国債（20年） | 700,000,000   | 829,073,000   |  |
| 第118回利付国債（20年） | 350,000,000   | 412,741,000   |  |
| 第119回利付国債（20年） | 100,000,000   | 116,088,000   |  |
| 第120回利付国債（20年） | 250,000,000   | 285,622,500   |  |
| 第121回利付国債（20年） | 230,000,000   | 269,796,900   |  |
| 第122回利付国債（20年） | 160,000,000   | 186,176,000   |  |
| 第123回利付国債（20年） | 180,000,000   | 215,233,200   |  |
| 第124回利付国債（20年） | 400,000,000   | 474,428,000   |  |
| 第125回利付国債（20年） | 510,000,000   | 616,778,700   |  |
| 第126回利付国債（20年） | 110,000,000   | 130,852,700   |  |
| 第127回利付国債（20年） | 40,000,000    | 47,186,800    |  |
| 第128回利付国債（20年） | 390,000,000   | 461,358,300   |  |
| 第129回利付国債（20年） | 90,000,000    | 105,554,700   |  |
| 第130回利付国債（20年） | 430,000,000   | 505,602,600   |  |
| 第131回利付国債（20年） | 200,000,000   | 233,090,000   |  |
| 第132回利付国債（20年） | 190,000,000   | 221,939,000   |  |
| 第133回利付国債（20年） | 422,000,000   | 497,415,620   |  |
| 第134回利付国債（20年） | 560,000,000   | 661,987,200   |  |
| 第135回利付国債（20年） | 100,000,000   | 117,128,000   |  |
| 第136回利付国債（20年） | 100,000,000   | 116,044,000   |  |
| 第137回利付国債（20年） | 330,000,000   | 387,370,500   |  |
| 第138回利付国債（20年） | 70,000,000    | 80,619,700    |  |
| 第139回利付国債（20年） | 240,000,000   | 279,067,200   |  |
| 第140回利付国債（20年） | 400,000,000   | 470,548,000   |  |
| 第142回利付国債（20年） | 1,150,000,000 | 1,368,845,000 |  |
| 第143回利付国債（20年） | 310,000,000   | 362,486,100   |  |
| 第144回利付国債（20年） | 220,000,000   | 254,661,000   |  |
| 第145回利付国債（20年） | 864,000,000   | 1,023,053,760 |  |
| 第146回利付国債（20年） | 400,000,000   | 474,544,000   |  |

|         |                   |                 |                 |  |
|---------|-------------------|-----------------|-----------------|--|
|         | 第１４７回利付国債（２０年）    | 950,000,000     | 1,117,266,500   |  |
|         | 第１４８回利付国債（２０年）    | 490,000,000     | 570,972,500     |  |
|         | 第１４９回利付国債（２０年）    | 830,000,000     | 968,502,100     |  |
|         | 第１５０回利付国債（２０年）    | 740,000,000     | 854,936,800     |  |
|         | 第１５１回利付国債（２０年）    | 500,000,000     | 564,960,000     |  |
|         | 第１５２回利付国債（２０年）    | 640,000,000     | 723,609,600     |  |
|         | 第１５３回利付国債（２０年）    | 670,000,000     | 767,230,400     |  |
|         | 第１５４回利付国債（２０年）    | 570,000,000     | 645,257,100     |  |
|         | 第１５５回利付国債（２０年）    | 980,000,000     | 1,081,390,800   |  |
|         | 第１５６回利付国債（２０年）    | 592,000,000     | 601,347,680     |  |
|         | 第１５７回利付国債（２０年）    | 420,000,000     | 413,578,200     |  |
|         | 第１５８回利付国債（２０年）    | 750,000,000     | 771,622,500     |  |
|         | 第１５９回利付国債（２０年）    | 460,000,000     | 479,655,800     |  |
|         | 第１６０回利付国債（２０年）    | 420,000,000     | 444,267,600     |  |
|         | 第１６１回利付国債（２０年）    | 580,000,000     | 603,664,000     |  |
|         | 第１６２回利付国債（２０年）    | 740,000,000     | 769,437,200     |  |
|         | 第１６３回利付国債（２０年）    | 570,000,000     | 592,059,000     |  |
|         | 第１６４回利付国債（２０年）    | 844,000,000     | 862,213,520     |  |
|         | 第１６５回利付国債（２０年）    | 480,000,000     | 489,710,400     |  |
|         | 第１６６回利付国債（２０年）    | 520,000,000     | 547,284,400     |  |
|         | 第１６７回利付国債（２０年）    | 550,000,000     | 559,570,000     |  |
|         | 第１６８回利付国債（２０年）    | 570,000,000     | 569,042,400     |  |
|         | 第１６９回利付国債（２０年）    | 540,000,000     | 529,021,800     |  |
|         | 第１７０回利付国債（２０年）    | 790,000,000     | 772,406,700     |  |
|         | 第１７１回利付国債（２０年）    | 450,000,000     | 439,092,000     |  |
|         | 第１７２回利付国債（２０年）    | 520,000,000     | 515,902,400     |  |
|         | 第１７３回利付国債（２０年）    | 610,000,000     | 604,595,400     |  |
|         | 第１７４回利付国債（２０年）    | 700,000,000     | 693,105,000     |  |
|         | 第１７５回利付国債（２０年）    | 380,000,000     | 383,093,200     |  |
| 国債証券 合計 |                   | 115,945,000,000 | 123,713,903,490 |  |
| 地方債証券   | 第６回東京都公募公債（２０年）   | 100,000,000     | 107,856,000     |  |
|         | 第７回東京都公募公債（２０年）   | 100,000,000     | 109,571,000     |  |
|         | 第８回東京都公募公債（３０年）   | 80,000,000      | 103,610,400     |  |
|         | 第１１回東京都公募公債（２０年）  | 100,000,000     | 112,780,000     |  |
|         | 第３１回東京都公募公債（５年）   | 100,000,000     | 99,918,000      |  |
|         | 第７１５回東京都公募公債      | 200,000,000     | 202,538,000     |  |
|         | 第７３２回東京都公募公債      | 200,000,000     | 203,978,000     |  |
|         | 第７９２回東京都公募公債      | 100,000,000     | 99,485,000      |  |
|         | 第１回神奈川県公募公債（３０年）  | 100,000,000     | 130,427,000     |  |
|         | 第２６回神奈川県公募公債（２０年） | 20,000,000      | 23,040,400      |  |
|         | 第２２０回神奈川県公募公債     | 100,000,000     | 100,273,000     |  |
|         | 第１１回大阪府公募公債（２０年）  | 100,000,000     | 117,289,000     |  |

|                        |             |             |  |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第378回大阪府公募公債           | 200,000,000 | 203,502,000 |  |
| 第388回大阪府公募公債           | 200,000,000 | 203,472,000 |  |
| 第394回大阪府公募公債           | 200,000,000 | 203,586,000 |  |
| 第415回大阪府公募公債           | 108,000,000 | 108,352,080 |  |
| 第421回大阪府公募公債           | 100,000,000 | 100,516,000 |  |
| 第451回大阪府公募公債           | 127,000,000 | 126,094,490 |  |
| 平成24年度第10回京都府公募公債      | 100,000,000 | 101,274,000 |  |
| 平成29年度第10回京都府公募公債（5年）  | 100,000,000 | 99,999,000  |  |
| 第2回兵庫県公募公債（30年）        | 100,000,000 | 133,553,000 |  |
| 第5回兵庫県公募公債（15年）        | 100,000,000 | 108,616,000 |  |
| 第9回兵庫県公募公債（20年）        | 200,000,000 | 236,098,000 |  |
| 平成28年度第3回兵庫県公募公債       | 100,000,000 | 100,085,000 |  |
| 第11回静岡県公募公債（20年）       | 300,000,000 | 347,712,000 |  |
| 平成27年度第10回静岡県公募公債      | 100,000,000 | 101,954,000 |  |
| 平成29年度第14回静岡県公募公債（5年）  | 10,000,000  | 10,001,900  |  |
| 平成20年度第2回愛知県公募公債（20年）  | 100,000,000 | 117,049,000 |  |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）  | 200,000,000 | 235,542,000 |  |
| 平成23年度第13回愛知県公募公債      | 200,000,000 | 216,330,000 |  |
| 平成24年度第13回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 101,249,000 |  |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債（15年） | 100,000,000 | 108,215,000 |  |
| 平成27年度第5回愛知県公募公債       | 100,000,000 | 102,162,000 |  |
| 平成28年度第16回愛知県公募公債      | 100,000,000 | 101,078,000 |  |
| 平成24年度第5回広島県公募公債       | 100,000,000 | 101,488,000 |  |
| 平成29年度第7回広島県公募公債       | 100,000,000 | 100,799,000 |  |
| 平成26年度第8回埼玉県公募公債       | 100,000,000 | 101,189,000 |  |
| 平成29年度第7回埼玉県公募公債（5年）   | 200,000,000 | 199,968,000 |  |
| 平成27年度第7回千葉県公募公債       | 100,000,000 | 101,858,000 |  |
| 第116回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 101,286,000 |  |
| 第126回共同発行市場公募地方債       | 210,000,000 | 214,097,100 |  |
| 第140回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 101,755,000 |  |
| 第202回共同発行市場公募地方債       | 200,000,000 | 199,876,000 |  |
| 平成28年度第2回島根県公募公債（20年）  | 100,000,000 | 101,691,000 |  |
| 平成27年度第1回新潟市公募公債       | 10,000,000  | 10,208,300  |  |
| 第1回名古屋市長公募公債（30年）      | 100,000,000 | 130,045,000 |  |
| 第7回京都市公募公債（20年）        | 200,000,000 | 234,100,000 |  |
| 平成20年度第24回神戸市公募公債（20年） | 100,000,000 | 115,292,000 |  |
| 平成27年度第3回横浜市公募公債       | 100,000,000 | 102,193,000 |  |
| 平成23年度第3回札幌市公募公債       | 100,000,000 | 117,855,000 |  |
| 平成26年度第5回札幌市公募公債       | 100,000,000 | 107,070,000 |  |
| 第9回川崎市公募公債（20年）        | 100,000,000 | 118,144,000 |  |
| 第50回川崎市公募公債（5年）        | 15,000,000  | 14,996,250  |  |
| 平成25年度第3回北九州市公募公債      | 200,000,000 | 203,754,000 |  |



|          |                               |               |               |  |
|----------|-------------------------------|---------------|---------------|--|
|          | 平成26年度第6回福岡市公募公債（20年）         | 100,000,000   | 113,955,000   |  |
|          | 平成30年度第3回千葉市公募公債              | 10,000,000    | 10,124,200    |  |
|          | 平成24年度第1回相模原市公募公債             | 200,000,000   | 202,364,000   |  |
|          | 平成24年度第1回徳島県公募公債              | 100,000,000   | 101,297,000   |  |
|          | 平成24年度第2回岡山県公募公債              | 100,000,000   | 101,306,000   |  |
|          | 第132回福岡北九州高速道路債券              | 100,000,000   | 101,678,000   |  |
| 地方債証券 合計 |                               | 7,190,000,000 | 7,685,595,120 |  |
| 特殊債券     | 第3回政府保証新関西国際空港債券              | 100,000,000   | 102,030,000   |  |
|          | 第19回政府保証日本政策投資銀行              | 100,000,000   | 101,326,000   |  |
|          | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）   | 100,000,000   | 111,960,000   |  |
|          | 第9回道路債券（財投機関債）                | 100,000,000   | 128,901,000   |  |
|          | 第27回道路債券（財投機関債）               | 150,000,000   | 160,701,000   |  |
|          | 第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）  | 100,000,000   | 116,622,000   |  |
|          | 第42回道路債券（財投機関債）               | 210,000,000   | 228,270,000   |  |
|          | 第50回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券     | 200,000,000   | 207,432,000   |  |
|          | 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    | 58,777,500    |  |
|          | 第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券     | 100,000,000   | 116,269,000   |  |
|          | 第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 400,000,000   | 405,128,000   |  |
|          | 第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 100,000,000   | 102,021,000   |  |
|          | 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000   | 116,793,000   |  |
|          | 第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債） | 100,000,000   | 110,224,000   |  |
|          | 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000   | 125,591,000   |  |
|          | 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   | 405,456,000   |  |
|          | 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 200,000,000   | 203,112,000   |  |
|          | 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   | 113,695,000   |  |
|          | 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   | 211,691,920   |  |
|          | 第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 200,000,000   | 203,928,000   |  |
|          | 第197回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 9,000,000     | 9,179,640     |  |
|          | 第225回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000   | 101,839,000   |  |
|          | 第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000   | 101,762,000   |  |
|          | 第256回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券    | 100,000,000   | 101,851,000   |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 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 | 106,903,120 |  |
| 第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000 | 100,614,000 |  |
| 第8回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）  | 100,000,000 | 116,925,000 |  |
| 第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債） | 100,000,000 | 115,606,000 |  |
| 第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）       | 100,000,000 | 115,330,000 |  |
| 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 | 116,051,000 |  |
| 第41回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 101,246,000 |  |
| 第42回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 200,000,000 | 202,622,000 |  |
| F54回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 100,000,000 | 104,647,000 |  |
| 第60回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 102,019,000 |  |
| 第62回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 101,921,000 |  |
| 第70回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 101,722,000 |  |
| 第74回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 113,000,000 | 115,636,290 |  |
| 第78回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 13,000,000  | 13,221,130  |  |
| F89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）      | 100,000,000 | 109,457,000 |  |
| 第99回政府保証地方公共団体金融機構債券         | 100,000,000 | 100,700,000 |  |
| F122回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）     | 200,000,000 | 216,056,000 |  |
| F149回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）     | 100,000,000 | 105,274,000 |  |
| 第17回政府保証民間都市開発債券             | 200,000,000 | 201,280,000 |  |
| 第54回福祉医療機構債券（財投機関債）          | 100,000,000 | 100,717,000 |  |
| 第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券        | 63,498,000  | 63,477,680  |  |
| 第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券       | 35,220,000  | 35,571,495  |  |
| 第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 41,322,000  | 44,269,085  |  |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券           | 23,540,000  | 24,029,632  |  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 24,873,000  | 26,307,425  |  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 78,813,000  | 83,598,525  |  |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 43,790,000  | 45,691,799  |  |
| 第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）    | 80,000,000  | 94,807,200  |  |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 119,844,000 | 124,678,506 |  |
| 第80回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 88,164,000  | 91,811,344  |  |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 46,111,000  | 47,981,262  |  |
| 第84回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）    | 100,000,000 | 107,835,000 |  |
| 第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 114,502,000 | 116,627,157 |  |
| 第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 132,800,000 | 137,373,632 |  |
| 第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 100,000,000 | 107,881,000 |  |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 68,960,000  | 71,305,329  |  |

|         |                              |               |               |  |
|---------|------------------------------|---------------|---------------|--|
|         | 第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 242,898,000   | 244,469,550   |  |
|         | 第１２０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 82,632,000    | 83,145,971    |  |
|         | 第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 168,828,000   | 170,019,925   |  |
|         | 第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 88,285,000    | 88,673,454    |  |
|         | 第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 89,084,000    | 89,836,759    |  |
|         | 第１５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 190,682,000   | 190,573,311   |  |
|         | 第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券        | 99,822,000    | 100,005,672   |  |
|         | 第２５６回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）   | 100,000,000   | 100,002,000   |  |
|         | い第８０６号商工債券                   | 100,000,000   | 100,073,000   |  |
|         | い第８１７号商工債券                   | 10,000,000    | 10,027,000    |  |
|         | い第８２３号商工債券                   | 200,000,000   | 200,628,000   |  |
|         | い第８３２号商工債券                   | 100,000,000   | 99,931,000    |  |
|         | い第８２５号農林債券                   | 100,000,000   | 100,059,000   |  |
|         | 第３３６回信金中金債                   | 100,000,000   | 100,100,000   |  |
|         | 第１１号商工債券（１０年）                | 100,000,000   | 102,019,000   |  |
|         | 第２４０号商工債券（３年）                | 100,000,000   | 99,944,000    |  |
|         | 第２４８号商工債券（３年）                | 100,000,000   | 100,037,000   |  |
|         | 第２５回西日本高速道路                  | 100,000,000   | 101,750,000   |  |
|         | 第７２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債） | 100,000,000   | 106,195,000   |  |
| 特殊債券 合計 |                              | 8,993,668,000 | 9,403,243,313 |  |
| 社債券     | 第１４回フランス相互信用連合銀行             | 100,000,000   | 100,171,000   |  |
|         | 第１９回フランス相互信用連合銀行             | 100,000,000   | 103,019,000   |  |
|         | 第２９回フランス相互信用連合銀行             | 100,000,000   | 99,735,000    |  |
|         | 第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー        | 100,000,000   | 99,911,000    |  |
|         | 第４回フランス預金供託公庫                | 100,000,000   | 101,855,000   |  |
|         | 第２１回新関西国際空港                  | 100,000,000   | 105,816,000   |  |
|         | 第１回国際石油開発帝石                  | 100,000,000   | 100,149,000   |  |
|         | 第１５回アサヒグループホールディングス          | 100,000,000   | 99,964,000    |  |
|         | 第１６回アサヒグループホールディングス          | 100,000,000   | 99,975,000    |  |
|         | 第３回 キューピー                    | 100,000,000   | 99,976,000    |  |
|         | 第１３回日本たばこ産業                  | 100,000,000   | 100,363,000   |  |
|         | 第９回ヒューリック                    | 100,000,000   | 99,109,000    |  |
|         | 第１４回セブン&アイ・ホールディングス          | 100,000,000   | 100,378,000   |  |
|         | 第９回クラレ                       | 100,000,000   | 100,232,000   |  |
|         | 第４２回王子ホールディングス               | 100,000,000   | 100,025,000   |  |
|         | 第１５回Ｚホールディングス                | 200,000,000   | 199,926,000   |  |
|         | 第１３回ブリヂストン                   | 100,000,000   | 100,150,000   |  |
|         | 第４回新日本製鐵                     | 100,000,000   | 99,722,000    |  |
|         | 第３１回ジェイ エフ イー ホールディングス       | 100,000,000   | 98,820,000    |  |
|         | 第７回ジェイテクト                    | 100,000,000   | 99,345,000    |  |
|         | 第４２回川崎重工業                    | 100,000,000   | 102,002,000   |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第18回JA三井リース           | 100,000,000 | 99,852,000  |  |
| 第64回日産自動車             | 100,000,000 | 101,060,000 |  |
| 第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）  | 100,000,000 | 100,074,000 |  |
| 第1回明治安田生命2018基金       | 200,000,000 | 200,312,000 |  |
| 第1回明治安田生命2019基金       | 100,000,000 | 100,022,000 |  |
| 第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ  | 100,000,000 | 101,007,000 |  |
| 第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ | 100,000,000 | 99,985,000  |  |
| 第8回みずほコーポレート銀行（劣後特約付） | 100,000,000 | 100,844,000 |  |
| 第57回三菱東京UFJ銀行         | 100,000,000 | 103,402,000 |  |
| 第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス   | 100,000,000 | 100,354,000 |  |
| 第42回ホンダファイナンス         | 100,000,000 | 99,852,000  |  |
| 第65回ホンダファイナンス         | 100,000,000 | 100,113,000 |  |
| 第39回リコーリース            | 200,000,000 | 199,646,000 |  |
| 第79回アコム               | 100,000,000 | 99,732,000  |  |
| 第80回アコム               | 100,000,000 | 99,588,000  |  |
| 第87回日立キャピタル           | 100,000,000 | 99,893,000  |  |
| 第16回三井住友ファイナンス&リース    | 200,000,000 | 200,908,000 |  |
| 第30回三井住友ファイナンス&リース    | 200,000,000 | 199,634,000 |  |
| 第147回東日本旅客鉄道          | 100,000,000 | 100,220,000 |  |
| 第17回東海旅客鉄道            | 100,000,000 | 107,471,000 |  |
| 第53回東海旅客鉄道            | 100,000,000 | 114,491,000 |  |
| 第73回東海旅客鉄道            | 100,000,000 | 107,062,000 |  |
| 第58回阪急阪神ホールディングス      | 100,000,000 | 99,829,000  |  |
| 第64回名古屋鉄道             | 100,000,000 | 99,975,000  |  |
| 第27回KDDI              | 200,000,000 | 199,598,000 |  |
| 第5回ソフトバンク             | 400,000,000 | 399,796,000 |  |
| 第500回中部電力             | 300,000,000 | 307,725,000 |  |
| 第503回中部電力             | 10,000,000  | 10,198,500  |  |
| 第500回関西電力             | 100,000,000 | 101,508,000 |  |
| 第506回関西電力             | 200,000,000 | 201,490,000 |  |
| 第510回関西電力             | 100,000,000 | 101,558,000 |  |
| 第322回北陸電力             | 100,000,000 | 101,048,000 |  |
| 第475回東北電力             | 100,000,000 | 102,530,000 |  |
| 第437回九州電力             | 100,000,000 | 102,591,000 |  |
| 第449回九州電力             | 200,000,000 | 202,640,000 |  |
| 第484回九州電力             | 100,000,000 | 100,462,000 |  |
| 第325回北海道電力            | 100,000,000 | 108,229,000 |  |
| 第360回北海道電力            | 100,000,000 | 100,746,000 |  |
| 第13回東京電力パワーグリッド       | 100,000,000 | 101,173,000 |  |
| 第14回東京電力パワーグリッド       | 100,000,000 | 100,681,000 |  |
| 第30回東京電力パワーグリッド       | 300,000,000 | 303,972,000 |  |
| 第38回東京電力パワーグリッド       | 300,000,000 | 303,711,000 |  |

|        |          |                 |                 |  |
|--------|----------|-----------------|-----------------|--|
|        | 第２３回東京ガス | 100,000,000     | 102,162,000     |  |
|        | 第１３回広島ガス | 100,000,000     | 100,384,000     |  |
| 社債券 合計 |          | 8,110,000,000   | 8,198,171,500   |  |
|        | 合計       | 140,238,668,000 | 149,000,913,423 |  |

## 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。

## ヘッジ付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 3年 3月25日現在] |                 |
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 1,367,039,483   |
| コール・ローン         | 2,805,146,374   |
| 国債証券            | 258,980,727,601 |
| 派生商品評価勘定        | 540,321,493     |
| 未収入金            | 770,419,434     |
| 未収利息            | 1,655,607,900   |
| 前払費用            | 172,210,011     |
| 流動資産合計          | 266,291,472,296 |
| 資産合計            | 266,291,472,296 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 3,106,993,703   |
| 未払金             | 3,232,251,589   |
| 未払解約金           | 457,262,457     |
| 未払利息            | 486             |
| 流動負債合計          | 6,796,508,235   |
| 負債合計            | 6,796,508,235   |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 189,589,551,791 |
| 剰余金             |                 |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 69,905,412,270  |
| 元本等合計           | 259,494,964,061 |
| 純資産合計           | 259,494,964,061 |
| 負債純資産合計         | 266,291,472,296 |

### 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<br>「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 3年 3月25日現在]  |
|-------------------------------------------|------------------|
| 1. 期首                                     | 令和 2年 3月26日      |
| 期首元本額                                     | 157,300,804,828円 |
| 期中追加設定元本額                                 | 83,966,408,459円  |
| 期中一部解約元本額                                 | 51,677,661,496円  |
| 元本の内訳※                                    |                  |
| eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）               | 181,254,337円     |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）                 | 4,742,837,220円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）                 | 4,775,290,234円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）                | 149,479,261円     |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）            | 2,282,622,922円   |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）                 | 2,654,021,826円   |
| eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）                     | 67,713,101円      |
| MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）     | 106,729,072,014円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）             | 10,689,718,195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）   | 10,047,413,462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）  | 3,889,739,221円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）     | 1,590,416,086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）         | 9,567,651,419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）   | 658,960,657円     |
| MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）      | 10,331,394,735円  |
| MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）       | 7,547,730,442円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）       | 1,001,038,772円   |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付） | 190,185,574円     |

|                                         | [令和 3年 3月25日現在]  |
|-----------------------------------------|------------------|
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）        | 2,184,840,850円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 312,015,642円     |
| MUKAM バランスファンド2020-04（適格機関投資家限定）        | 2,263,008,691円   |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）        | 2,184,344,382円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定） | 311,241,135円     |
| MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）        | 2,173,330,088円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定） | 311,484,137円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 312,660,303円     |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）        | 2,118,938,164円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 321,148,921円     |
| 合計                                      | 189,589,551,791円 |
| 2. 受益権の総数                               | 189,589,551,791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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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 | <p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、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。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

| 区分               | 自 令和 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3月25日                                                                                                                                                                           |
|------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種類   | [令和 3年 3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 | △7,421,653,155     |
| 合計   | △7,421,653,155     |

(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 3年 3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     | 722,985,320     | —     | 723,985,500     | 1,000,180      |
|           | カナダドル      | 31,075,092      | —     | 31,168,800      | 93,708         |
|           | イギリスポンド    | 28,355,562      | —     | 28,321,400      | △34,162        |
|           | イスラエルシェケル  | 62,449,390      | —     | 62,453,000      | 3,610          |
|           | ユーロ        | 488,982,920     | —     | 488,870,000     | △112,920       |
|           | 売建         |                 |       |                 |                |
|           | アメリカドル     | 112,577,401,614 | —     | 115,343,701,600 | △2,766,299,986 |
|           | カナダドル      | 4,967,013,614   | —     | 5,109,085,800   | △142,072,186   |
|           | オーストラリアドル  | 6,205,812,462   | —     | 6,171,981,600   | 33,830,862     |
|           | イギリスポンド    | 17,317,899,440  | —     | 17,392,320,800  | △74,421,360    |
|           | シンガポールドル   | 1,112,906,704   | —     | 1,126,658,400   | △13,751,696    |
|           | マレーシアリンギット | 1,255,486,560   | —     | 1,248,935,700   | 6,550,860      |
|           | スウェーデンクローネ | 873,950,890     | —     | 865,892,500     | 8,058,390      |
|           | ノルウェークローネ  | 614,412,664     | —     | 625,631,200     | △11,218,536    |
|           | デンマーククローネ  | 1,235,840,796   | —     | 1,231,760,000   | 4,080,796      |
|           | メキシコペソ     | 2,006,652,760   | —     | 2,065,960,000   | △59,307,240    |
|           | イスラエルシェケル  | 1,139,686,430   | —     | 1,159,324,900   | △19,638,470    |
|           | ポーランドズロチ   | 1,683,070,080   | —     | 1,639,644,000   | 43,426,080     |
|           | ユーロ        | 107,768,037,660 | —     | 107,344,897,800 | 423,139,860    |
|           | 合計         | 260,092,019,958 | —     | 262,660,593,000 | △2,566,672,210 |

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

|              |                 |
|--------------|-----------------|
|              | [令和 3年 3月25日現在] |
| 1口当たり純資産額    | 1.3687円         |
| (1万口当たり純資産額) | (13,687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<br>ドル | 国債証券 | 0.125 T-NOTE 220430 | 7,000,000.00  | 7,003,281.25  |    |
|            |      | 0.125 T-NOTE 230131 | 7,000,000.00  | 6,998,085.93  |    |
|            |      | 0.125 T-NOTE 230515 | 5,500,000.00  | 5,495,058.59  |    |
|            |      | 0.125 T-NOTE 230815 | 9,500,000.00  | 9,484,785.15  |    |
|            |      | 0.125 T-NOTE 240115 | 9,300,000.00  | 9,264,035.14  |    |
|            |      | 0.125 T-NOTE 240215 | 8,800,000.00  | 8,761,843.74  |    |
|            |      | 0.25 T-NOTE 231115  | 3,000,000.00  | 3,001,523.43  |    |
|            |      | 0.25 T-NOTE 250930  | 6,200,000.00  | 6,072,125.00  |    |
|            |      | 0.375 T-NOTE 251231 | 9,000,000.00  | 8,829,140.62  |    |
|            |      | 0.375 T-NOTE 260131 | 5,000,000.00  | 4,898,437.50  |    |
|            |      | 0.5 T-NOTE 270630   | 8,000,000.00  | 7,686,250.00  |    |
|            |      | 0.5 T-NOTE 270831   | 8,550,000.00  | 8,187,960.93  |    |
|            |      | 0.625 T-NOTE 271231 | 9,680,000.00  | 9,287,506.24  |    |
|            |      | 0.625 T-NOTE 300515 | 7,600,000.00  | 6,996,750.00  |    |
|            |      | 0.625 T-NOTE 300815 | 13,200,000.00 | 12,100,687.50 |    |
|            |      | 0.875 T-NOTE 301115 | 9,500,000.00  | 8,888,437.50  |    |
|            |      | 1.125 T-BOND 400515 | 8,400,000.00  | 6,977,906.25  |    |
|            |      | 1.375 T-NOTE 221015 | 8,000,000.00  | 8,155,312.49  |    |
|            |      | 1.375 T-NOTE 230215 | 5,800,000.00  | 5,935,710.93  |    |
|            |      | 1.375 T-NOTE 230630 | 4,100,000.00  | 4,211,468.75  |    |
|            |      | 1.375 T-NOTE 230831 | 7,700,000.00  | 7,921,375.00  |    |
|            |      | 1.375 T-NOTE 230930 | 7,000,000.00  | 7,206,718.75  |    |
|            |      | 1.5 T-NOTE 220815   | 5,500,000.00  | 5,607,207.02  |    |
|            |      | 1.5 T-NOTE 220915   | 6,000,000.00  | 6,122,578.12  |    |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 1.5 T-NOTE 230115   | 5,000,000.00  | 5,123,242.18  |  |
| 1.5 T-NOTE 230228   | 6,300,000.00  | 6,465,128.90  |  |
| 1.5 T-NOTE 230331   | 6,700,000.00  | 6,882,679.68  |  |
| 1.5 T-NOTE 241031   | 6,000,000.00  | 6,222,187.50  |  |
| 1.5 T-NOTE 260815   | 8,300,000.00  | 8,549,000.00  |  |
| 1.5 T-NOTE 270131   | 6,500,000.00  | 6,668,085.93  |  |
| 1.5 T-NOTE 300215   | 7,000,000.00  | 6,989,062.50  |  |
| 1.625 T-NOTE 220815 | 8,400,000.00  | 8,577,515.62  |  |
| 1.625 T-NOTE 221115 | 8,350,000.00  | 8,554,509.76  |  |
| 1.625 T-NOTE 221215 | 6,800,000.00  | 6,976,109.37  |  |
| 1.625 T-NOTE 230430 | 7,850,000.00  | 8,090,406.25  |  |
| 1.625 T-NOTE 230531 | 4,900,000.00  | 5,055,039.06  |  |
| 1.625 T-NOTE 231031 | 6,700,000.00  | 6,944,968.75  |  |
| 1.625 T-NOTE 260215 | 7,100,000.00  | 7,380,117.18  |  |
| 1.625 T-NOTE 260515 | 9,200,000.00  | 9,550,750.00  |  |
| 1.625 T-NOTE 260930 | 4,500,000.00  | 4,660,664.06  |  |
| 1.625 T-NOTE 261031 | 7,400,000.00  | 7,659,000.00  |  |
| 1.625 T-NOTE 261130 | 5,200,000.00  | 5,379,156.25  |  |
| 1.625 T-NOTE 290815 | 7,200,000.00  | 7,299,562.50  |  |
| 1.75 T-NOTE 220228  | 1,750,000.00  | 1,777,343.75  |  |
| 1.75 T-NOTE 220331  | 4,400,000.00  | 4,474,765.62  |  |
| 1.75 T-NOTE 220430  | 3,100,000.00  | 3,157,519.52  |  |
| 1.75 T-NOTE 220531  | 3,800,000.00  | 3,874,218.75  |  |
| 1.75 T-NOTE 220615  | 3,000,000.00  | 3,060,820.31  |  |
| 1.75 T-NOTE 220715  | 4,000,000.00  | 4,086,093.74  |  |
| 1.75 T-NOTE 220930  | 4,900,000.00  | 5,021,351.56  |  |
| 1.75 T-NOTE 230515  | 10,000,000.00 | 10,338,281.25 |  |
| 1.75 T-NOTE 240630  | 9,000,000.00  | 9,402,187.50  |  |
| 1.75 T-NOTE 240731  | 8,000,000.00  | 8,361,875.00  |  |
| 1.75 T-NOTE 261231  | 6,800,000.00  | 7,079,437.50  |  |
| 1.875 T-NOTE 220228 | 4,000,000.00  | 4,067,187.50  |  |
| 1.875 T-NOTE 220531 | 3,700,000.00  | 3,778,046.87  |  |
| 1.875 T-NOTE 220831 | 3,750,000.00  | 3,844,628.90  |  |
| 1.875 T-NOTE 220930 | 10,000,000.00 | 10,267,187.50 |  |
| 1.875 T-NOTE 221031 | 6,300,000.00  | 6,477,187.50  |  |
| 2 T-BOND 500215     | 6,150,000.00  | 5,743,042.96  |  |
| 2 T-NOTE 221130     | 10,000,000.00 | 10,314,843.75 |  |
| 2 T-NOTE 230215     | 8,900,000.00  | 9,210,804.68  |  |
| 2 T-NOTE 240430     | 5,700,000.00  | 5,993,015.62  |  |
| 2 T-NOTE 240531     | 5,500,000.00  | 5,786,601.56  |  |
| 2 T-NOTE 250215     | 10,500,000.00 | 11,093,906.25 |  |
| 2 T-NOTE 250815     | 12,150,000.00 | 12,857,167.96 |  |
|                     |               |               |  |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 2 T-NOTE 261115     | 8,300,000.00  | 8,761,687.50  |
| 2.125 T-NOTE 220630 | 6,350,000.00  | 6,512,718.75  |
| 2.125 T-NOTE 221231 | 8,500,000.00  | 8,798,828.12  |
| 2.125 T-NOTE 231130 | 7,700,000.00  | 8,090,414.06  |
| 2.125 T-NOTE 240229 | 8,700,000.00  | 9,166,265.62  |
| 2.125 T-NOTE 241130 | 6,300,000.00  | 6,678,984.37  |
| 2.125 T-NOTE 250515 | 12,000,000.00 | 12,747,187.50 |
| 2.25 T-BOND 460815  | 5,730,000.00  | 5,669,566.40  |
| 2.25 T-NOTE 231231  | 8,800,000.00  | 9,284,000.00  |
| 2.25 T-NOTE 240430  | 6,500,000.00  | 6,884,921.87  |
| 2.25 T-NOTE 241031  | 4,900,000.00  | 5,214,289.05  |
| 2.25 T-NOTE 241115  | 9,500,000.00  | 10,110,820.31 |
| 2.25 T-NOTE 241231  | 5,100,000.00  | 5,434,289.06  |
| 2.25 T-NOTE 251115  | 9,500,000.00  | 10,160,546.87 |
| 2.25 T-NOTE 260331  | 7,000,000.00  | 7,488,906.25  |
| 2.25 T-NOTE 270215  | 6,700,000.00  | 7,166,382.81  |
| 2.25 T-NOTE 270815  | 11,300,000.00 | 12,062,750.00 |
| 2.25 T-NOTE 271115  | 9,900,000.00  | 10,558,195.30 |
| 2.375 T-BOND 491115 | 5,430,000.00  | 5,503,814.06  |
| 2.375 T-NOTE 240229 | 3,600,000.00  | 3,819,375.00  |
| 2.375 T-NOTE 240815 | 9,200,000.00  | 9,810,218.75  |
| 2.375 T-NOTE 270515 | 10,500,000.00 | 11,298,164.06 |
| 2.375 T-NOTE 290515 | 8,800,000.00  | 9,442,812.49  |
| 2.5 T-BOND 450215   | 5,050,000.00  | 5,251,605.46  |
| 2.5 T-BOND 460215   | 5,100,000.00  | 5,298,023.43  |
| 2.5 T-BOND 460515   | 5,250,000.00  | 5,454,667.96  |
| 2.5 T-NOTE 230815   | 9,050,000.00  | 9,551,992.18  |
| 2.5 T-NOTE 240515   | 4,700,000.00  | 5,018,351.56  |
| 2.5 T-NOTE 250131   | 6,000,000.00  | 6,453,750.00  |
| 2.625 T-NOTE 230630 | 5,600,000.00  | 5,910,625.00  |
| 2.625 T-NOTE 250331 | 4,500,000.00  | 4,867,031.25  |
| 2.625 T-NOTE 260131 | 4,600,000.00  | 5,003,937.50  |
| 2.625 T-NOTE 290215 | 8,800,000.00  | 9,609,875.00  |
| 2.75 T-BOND 420815  | 2,450,000.00  | 2,674,902.34  |
| 2.75 T-BOND 421115  | 5,020,000.00  | 5,471,800.00  |
| 2.75 T-BOND 470815  | 4,950,000.00  | 5,392,792.96  |
| 2.75 T-BOND 471115  | 4,500,000.00  | 4,902,187.50  |
| 2.75 T-NOTE 230531  | 3,000,000.00  | 3,168,515.62  |
| 2.75 T-NOTE 231115  | 8,800,000.00  | 9,387,125.00  |
| 2.75 T-NOTE 240215  | 6,800,000.00  | 7,285,562.50  |
| 2.75 T-NOTE 250630  | 7,900,000.00  | 8,603,593.75  |
| 2.75 T-NOTE 250831  | 7,500,000.00  | 8,177,343.75  |
| 2.75 T-NOTE 280215  | 11,400,000.00 | 12,534,656.25 |

|                     |               |               |  |
|---------------------|---------------|---------------|--|
| 2.875 T-BOND 430515 | 5,450,000.00  | 6,063,550.77  |  |
| 2.875 T-BOND 450815 | 4,050,000.00  | 4,505,625.00  |  |
| 2.875 T-BOND 461115 | 3,760,000.00  | 4,185,937.50  |  |
| 2.875 T-BOND 490515 | 6,300,000.00  | 7,054,523.42  |  |
| 2.875 T-NOTE 230930 | 6,000,000.00  | 6,402,187.50  |  |
| 2.875 T-NOTE 231031 | 8,500,000.00  | 9,084,375.00  |  |
| 2.875 T-NOTE 250430 | 4,900,000.00  | 5,353,250.00  |  |
| 2.875 T-NOTE 250731 | 11,900,000.00 | 13,033,289.06 |  |
| 2.875 T-NOTE 251130 | 5,400,000.00  | 5,930,296.87  |  |
| 2.875 T-NOTE 280515 | 9,400,000.00  | 10,420,781.25 |  |
| 2.875 T-NOTE 280815 | 9,850,000.00  | 10,928,113.27 |  |
| 3 T-BOND 420515     | 4,420,000.00  | 5,017,735.93  |  |
| 3 T-BOND 441115     | 3,850,000.00  | 4,368,847.65  |  |
| 3 T-BOND 450515     | 4,300,000.00  | 4,881,507.81  |  |
| 3 T-BOND 451115     | 2,910,000.00  | 3,308,760.93  |  |
| 3 T-BOND 470215     | 4,460,000.00  | 5,083,703.12  |  |
| 3 T-BOND 480215     | 5,700,000.00  | 6,510,914.06  |  |
| 3 T-BOND 480815     | 5,600,000.00  | 6,405,875.00  |  |
| 3 T-BOND 490215     | 6,180,000.00  | 7,082,859.36  |  |
| 3 T-NOTE 250930     | 10,500,000.00 | 11,571,328.12 |  |
| 3.125 T-BOND 411115 | 2,500,000.00  | 2,894,921.87  |  |
| 3.125 T-BOND 420215 | 3,350,000.00  | 3,881,550.78  |  |
| 3.125 T-BOND 430215 | 3,600,000.00  | 4,165,875.00  |  |
| 3.125 T-BOND 440815 | 3,950,000.00  | 4,575,828.12  |  |
| 3.125 T-BOND 480515 | 5,390,000.00  | 6,304,194.51  |  |
| 3.125 T-NOTE 281115 | 10,600,000.00 | 11,960,609.37 |  |
| 3.375 T-BOND 440515 | 4,150,000.00  | 4,997,507.80  |  |
| 3.375 T-BOND 481115 | 6,000,000.00  | 7,344,375.00  |  |
| 3.5 T-BOND 390215   | 1,700,000.00  | 2,068,156.25  |  |
| 3.625 T-BOND 430815 | 4,150,000.00  | 5,178,097.65  |  |
| 3.625 T-BOND 440215 | 4,200,000.00  | 5,251,640.62  |  |
| 3.75 T-BOND 410815  | 1,650,000.00  | 2,085,058.59  |  |
| 3.75 T-BOND 431115  | 4,410,000.00  | 5,609,657.81  |  |
| 3.875 T-BOND 400815 | 2,900,000.00  | 3,713,132.80  |  |
| 4.25 T-BOND 390515  | 1,800,000.00  | 2,399,625.00  |  |
| 4.25 T-BOND 401115  | 4,350,000.00  | 5,841,574.21  |  |
| 4.375 T-BOND 380215 | 1,390,000.00  | 1,863,903.12  |  |
| 4.375 T-BOND 391115 | 2,100,000.00  | 2,848,781.25  |  |
| 4.375 T-BOND 400515 | 2,450,000.00  | 3,333,722.65  |  |
| 4.375 T-BOND 410515 | 2,230,000.00  | 3,050,047.65  |  |
| 4.5 T-BOND 360215   | 1,400,000.00  | 1,875,453.12  |  |
| 4.5 T-BOND 380515   | 1,300,000.00  | 1,768,304.68  |  |
|                     |               |               |  |

|           |      |                          |                |                                       |  |
|-----------|------|--------------------------|----------------|---------------------------------------|--|
|           |      | 4.5 T-BOND 390815        | 1,850,000.00   | 2,542,593.75                          |  |
|           |      | 4.625 T-BOND 400215      | 2,230,000.00   | 3,121,303.12                          |  |
|           |      | 4.75 T-BOND 410215       | 2,400,000.00   | 3,429,937.50                          |  |
|           |      | 5 T-BOND 370515          | 1,050,000.00   | 1,492,722.65                          |  |
|           |      | 5.375 T-BOND 310215      | 2,200,000.00   | 2,973,265.62                          |  |
|           |      | 6 T-BOND 260215          | 4,800,000.00   | 6,002,250.00                          |  |
|           |      | 6.125 T-BOND 271115      | 3,300,000.00   | 4,347,234.37                          |  |
|           |      | 6.25 T-BOND 230815       | 6,500,000.00   | 7,441,738.27                          |  |
|           |      | 6.25 T-BOND 300515       | 2,750,000.00   | 3,873,847.65                          |  |
| アメリカドル合計  |      |                          | 981,490,000.00 | 1,044,302,736.48<br>(113,703,681,947) |  |
| カナダドル     | 国債証券 | 0.5 CAN GOVT 220301      | 1,200,000.00   | 1,204,656.00                          |  |
|           |      | 1 CAN GOVT 220901        | 6,000,000.00   | 6,072,960.00                          |  |
|           |      | 1 CAN GOVT 270601        | 1,500,000.00   | 1,494,990.00                          |  |
|           |      | 1.25 CAN GOVT 250301     | 3,850,000.00   | 3,938,357.50                          |  |
|           |      | 1.25 CAN GOVT 300601     | 5,250,000.00   | 5,184,217.50                          |  |
|           |      | 1.5 CAN GOVT 230601      | 3,250,000.00   | 3,337,717.50                          |  |
|           |      | 1.5 CAN GOVT 260601      | 2,850,000.00   | 2,926,978.50                          |  |
|           |      | 1.75 CAN GOVT 230301     | 4,000,000.00   | 4,118,720.00                          |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 230901        | 4,500,000.00   | 4,683,870.00                          |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 280601        | 1,500,000.00   | 1,586,190.00                          |  |
|           |      | 2 CAN GOVT 511201        | 2,670,000.00   | 2,702,013.30                          |  |
|           |      | 2.25 CAN GOVT 240301     | 1,200,000.00   | 1,264,032.00                          |  |
|           |      | 2.25 CAN GOVT 250601     | 3,200,000.00   | 3,400,128.00                          |  |
|           |      | 2.25 CAN GOVT 290601     | 2,100,000.00   | 2,258,151.00                          |  |
|           |      | 2.5 CAN GOVT 240601      | 2,200,000.00   | 2,340,228.00                          |  |
|           |      | 2.75 CAN GOVT 481201     | 950,000.00     | 1,114,701.50                          |  |
|           |      | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 950,000.00     | 1,172,053.00                          |  |
|           |      | 3.5 CAN GOVT 451201      | 1,820,000.00   | 2,383,472.00                          |  |
|           |      | 4 CAN GOVT 410601        | 1,490,000.00   | 2,030,169.70                          |  |
|           |      | 5 CAN GOVT 370601        | 720,000.00     | 1,050,134.40                          |  |
|           |      | 5.75 CAN GOVT 290601     | 1,450,000.00   | 1,950,119.50                          |  |
|           |      | 5.75 CAN GOVT 330601     | 1,320,000.00   | 1,920,217.20                          |  |
| カナダドル合計   |      |                          | 53,970,000.00  | 58,134,076.60<br>(5,033,829,692)      |  |
| オーストラリアドル | 国債証券 | 0.5 AUST GOVT 260921     | 3,700,000.00   | 3,642,439.91                          |  |
|           |      | 1 AUST GOVT 301221       | 5,300,000.00   | 5,011,110.35                          |  |
|           |      | 1.5 AUST GOVT 310621     | 4,500,000.00   | 4,435,231.68                          |  |
|           |      | 1.75 AUST GOVT 510621    | 1,750,000.00   | 1,434,779.65                          |  |
|           |      | 2.25 AUST GOVT 221121    | 3,300,000.00   | 3,419,260.35                          |  |
|           |      | 2.25 AUST GOVT 280521    | 2,000,000.00   | 2,150,758.20                          |  |
|           |      | 2.5 AUST GOVT 300521     | 4,220,000.00   | 4,579,112.29                          |  |
|           |      | 2.75 AUST GOVT 240421    | 4,900,000.00   | 5,298,111.28                          |  |

|             |      |                       |               |                                  |  |
|-------------|------|-----------------------|---------------|----------------------------------|--|
|             |      | 2.75 AUST GOVT 291121 | 3,550,000.00  | 3,932,076.20                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 350621 | 1,800,000.00  | 1,963,494.00                     |  |
|             |      | 2.75 AUST GOVT 410521 | 1,240,000.00  | 1,307,684.65                     |  |
|             |      | 3 AUST GOVT 470321    | 1,680,000.00  | 1,824,405.24                     |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 250421 | 5,800,000.00  | 6,467,307.40                     |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 290421 | 4,500,000.00  | 5,166,416.70                     |  |
|             |      | 3.25 AUST GOVT 390621 | 900,000.00    | 1,027,265.31                     |  |
|             |      | 3.75 AUST GOVT 370421 | 1,600,000.00  | 1,947,197.92                     |  |
|             |      | 4.25 AUST GOVT 260421 | 5,050,000.00  | 5,954,435.81                     |  |
|             |      | 4.5 AUST GOVT 330421  | 3,800,000.00  | 4,922,616.90                     |  |
|             |      | 4.75 AUST GOVT 270421 | 2,800,000.00  | 3,437,760.20                     |  |
|             |      | 5.5 AUST GOVT 230421  | 2,600,000.00  | 2,891,598.06                     |  |
|             |      | 5.75 AUST GOVT 220715 | 2,900,000.00  | 3,115,391.41                     |  |
| オーストラリアドル合計 |      |                       | 67,890,000.00 | 73,928,453.51<br>(6,113,143,820) |  |
| イギリス<br>ポンド | 国債証券 | 0.125 GILT 240131     | 3,500,000.00  | 3,498,680.18                     |  |
|             |      | 0.375 GILT 301022     | 2,300,000.00  | 2,212,059.96                     |  |
|             |      | 0.625 GILT 250607     | 3,450,000.00  | 3,509,660.85                     |  |
|             |      | 0.625 GILT 501022     | 2,430,000.00  | 2,039,712.34                     |  |
|             |      | 0.75 GILT 230722      | 2,650,000.00  | 2,692,732.84                     |  |
|             |      | 0.875 GILT 291022     | 2,100,000.00  | 2,130,731.40                     |  |
|             |      | 1 GILT 240422         | 3,400,000.00  | 3,493,442.20                     |  |
|             |      | 1.25 GILT 270722      | 2,500,000.00  | 2,622,676.50                     |  |
|             |      | 1.5 GILT 260722       | 2,600,000.00  | 2,757,448.98                     |  |
|             |      | 1.5 GILT 470722       | 2,700,000.00  | 2,833,706.16                     |  |
|             |      | 1.625 GILT 281022     | 900,000.00    | 969,888.60                       |  |
|             |      | 1.625 GILT 711022     | 940,000.00    | 1,131,384.00                     |  |
|             |      | 1.75 GILT 220907      | 5,350,000.00  | 5,486,462.45                     |  |
|             |      | 1.75 GILT 370907      | 2,800,000.00  | 3,049,543.84                     |  |
|             |      | 1.75 GILT 490122      | 1,490,000.00  | 1,655,660.58                     |  |
|             |      | 1.75 GILT 570722      | 2,700,000.00  | 3,123,084.60                     |  |
|             |      | 2.25 GILT 230907      | 2,700,000.00  | 2,845,274.58                     |  |
|             |      | 2.5 GILT 650722       | 1,990,000.00  | 2,906,673.60                     |  |
|             |      | 2.75 GILT 240907      | 1,950,000.00  | 2,126,070.96                     |  |
|             |      | 3.25 GILT 440122      | 2,760,000.00  | 3,846,592.12                     |  |
|             |      | 3.5 GILT 450122       | 2,670,000.00  | 3,897,425.70                     |  |
|             |      | 3.5 GILT 680722       | 1,980,000.00  | 3,677,473.80                     |  |
|             |      | 3.75 GILT 520722      | 1,780,000.00  | 2,931,446.40                     |  |
|             |      | 4 GILT 220307         | 1,650,000.00  | 1,713,402.24                     |  |
|             |      | 4 GILT 600122         | 1,710,000.00  | 3,206,010.60                     |  |
|             |      | 4.25 GILT 271207      | 2,830,000.00  | 3,534,994.60                     |  |
|             |      | 4.25 GILT 320607      | 3,830,000.00  | 5,203,338.42                     |  |

|                    |      |                          |               |                                    |               |
|--------------------|------|--------------------------|---------------|------------------------------------|---------------|
|                    |      | 4.25 GILT 360307         | 2,000,000.00  | 2,878,453.40                       |               |
|                    |      | 4.25 GILT 390907         | 1,680,000.00  | 2,540,963.37                       |               |
|                    |      | 4.25 GILT 401207         | 1,820,000.00  | 2,793,708.72                       |               |
|                    |      | 4.25 GILT 461207         | 2,140,000.00  | 3,534,520.30                       |               |
|                    |      | 4.25 GILT 491207         | 1,900,000.00  | 3,266,404.00                       |               |
|                    |      | 4.25 GILT 551207         | 2,310,000.00  | 4,286,389.80                       |               |
|                    |      | 4.5 GILT 340907          | 2,600,000.00  | 3,745,581.58                       |               |
|                    |      | 4.5 GILT 421207          | 2,300,000.00  | 3,728,898.00                       |               |
|                    |      | 4.75 GILT 301207         | 2,700,000.00  | 3,706,989.84                       |               |
|                    |      | 4.75 GILT 381207         | 1,780,000.00  | 2,813,848.20                       |               |
|                    |      | 5 GILT 250307            | 2,830,000.00  | 3,366,374.42                       |               |
|                    |      | 6 GILT 281207            | 1,170,000.00  | 1,644,050.30                       |               |
| イギリスポンド合計          |      |                          | 92,890,000.00 | 117,401,760.43<br>(17,501,080,427) |               |
| シンガ<br>ポールド<br>ル   | 国債証券 | 1.75 SINGAPORGOVT 220401 | 650,000.00    | 658,580.00                         |               |
|                    |      | 2.25 SINGAPORGOVT 360801 | 1,550,000.00  | 1,623,005.00                       |               |
|                    |      | 2.375 SINGAPORGOV 250601 | 1,000,000.00  | 1,063,500.00                       |               |
|                    |      | 2.625 SINGAPORGOV 280501 | 1,000,000.00  | 1,086,000.00                       |               |
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 230701 | 1,400,000.00  | 1,466,920.00                       |               |
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 420401 | 1,050,000.00  | 1,192,800.00                       |               |
|                    |      | 2.75 SINGAPORGOVT 460301 | 1,100,000.00  | 1,260,600.00                       |               |
|                    |      | 2.875 SINGAPORGOV 290701 | 350,000.00    | 387,450.00                         |               |
|                    |      | 2.875SINGAPORGOVT 300901 | 800,000.00    | 892,332.00                         |               |
|                    |      | 3 SINGAPORGOVT 240901    | 500,000.00    | 537,800.00                         |               |
|                    |      | 3.125SINGAPORGOVT 220901 | 1,200,000.00  | 1,245,000.00                       |               |
|                    |      | 3.375 SINGAPORGOV 330901 | 600,000.00    | 705,300.00                         |               |
|                    |      | 3.5 SINGAPORGOVT 270301  | 1,120,000.00  | 1,268,400.00                       |               |
| シンガポールドル合計         |      |                          | 12,320,000.00 | 13,387,687.00<br>(1,083,063,878)   |               |
| マレーシ<br>アリン<br>ギット | 国債証券 | 3.48 MALAYSIAGOVT 230315 | 4,000,000.00  | 4,105,340.40                       |               |
|                    |      | 3.502MALAYSIAGOVT 270531 | 4,500,000.00  | 4,618,774.80                       |               |
|                    |      | 3.8 MALAYSIAGOVT 230817  | 4,000,000.00  | 4,147,668.00                       |               |
|                    |      | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 4,000,000.00  | 3,970,174.80                       |               |
|                    |      | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 4,000,000.00  | 3,940,703.08                       |               |
|                    |      | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 5,000,000.00  | 5,197,869.50                       |               |
|                    |      | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 4,000,000.00  | 4,214,603.20                       |               |
|                    |      | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3,000,000.00  | 3,158,913.60                       |               |
|                    |      | 4.181 MALAYSIAGOV 240715 | 3,000,000.00  | 3,165,304.20                       |               |
|                    |      | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 4,500,000.00  | 4,729,471.65                       |               |
|                    |      | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 2,000,000.00  | 2,096,274.40                       |               |
|                    |      | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 2,500,000.00  | 2,660,083.75                       |               |
|                    |      |                          |               |                                    | 44,500,000.00 |



|               |      |                          |               |                 |                 |
|---------------|------|--------------------------|---------------|-----------------|-----------------|
| マレーシアリングgit合計 |      |                          |               | (1,211,316,425) |                 |
| スウェーデン<br>クロネ | 国債証券 | 0.75 SWD GOVT 280512     | 6,300,000.00  | 6,582,000.60    |                 |
|               |      | 0.75 SWD GOVT 291112     | 7,700,000.00  | 8,036,413.00    |                 |
|               |      | 1 SWD GOVT 261112        | 10,150,000.00 | 10,739,309.00   |                 |
|               |      | 1.5 SWD GOVT 231113      | 11,800,000.00 | 12,360,488.20   |                 |
|               |      | 2.5 SWD GOVT 250512      | 7,200,000.00  | 8,007,720.48    |                 |
|               |      | 3.5 SWD GOVT 220601      | 11,550,000.00 | 12,075,224.70   |                 |
|               |      | 3.5 SWD GOVT 390330      | 6,700,000.00  | 9,885,521.03    |                 |
| スウェーデンクロネ合計   |      |                          | 61,400,000.00 | 67,686,677.01   | (856,236,464)   |
| ノルウェー<br>クロネ  | 国債証券 | 1.25 NORWE GOVT 310917   | 3,800,000.00  | 3,727,990.00    |                 |
|               |      | 1.375 NORWE GOVT 300819  | 4,900,000.00  | 4,898,677.00    |                 |
|               |      | 1.5 NORWE GOVT 260219    | 2,850,000.00  | 2,918,645.67    |                 |
|               |      | 1.75 NORWE GOVT 250313   | 8,300,000.00  | 8,579,170.50    |                 |
|               |      | 1.75 NORWE GOVT 270217   | 4,250,000.00  | 4,402,043.75    |                 |
|               |      | 1.75 NORWE GOVT 290906   | 6,200,000.00  | 6,414,458.00    |                 |
|               |      | 2 NORWE GOVT 230524      | 7,250,000.00  | 7,478,885.40    |                 |
|               |      | 2 NORWE GOVT 280426      | 5,050,000.00  | 5,316,201.66    |                 |
|               |      | 3 NORWE GOVT 240314      | 4,950,000.00  | 5,280,709.50    |                 |
| ノルウェークロネ合計    |      |                          | 47,550,000.00 | 49,016,781.48   | (621,532,789)   |
| デンマーク<br>クロネ  | 国債証券 | 0.25 DMK GOVT 521115     | 3,550,000.00  | 3,415,100.00    |                 |
|               |      | 0.5 DMK GOVT 271115      | 10,200,000.00 | 10,801,341.00   |                 |
|               |      | 0.5 DMK GOVT 291115      | 10,700,000.00 | 11,368,750.00   |                 |
|               |      | 1.5 DMK GOVT 231115      | 8,100,000.00  | 8,548,181.10    |                 |
|               |      | 1.75 DMK GOVT 251115     | 10,200,000.00 | 11,285,535.00   |                 |
|               |      | 4.5 DMK GOVT 391115      | 14,350,000.00 | 25,764,172.24   |                 |
| デンマーククロネ合計    |      |                          | 57,100,000.00 | 71,183,079.34   | (1,231,467,272) |
| メキシコ<br>ペソ    | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 241205  | 44,750,000.00 | 51,387,767.50   |                 |
|               |      | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 9,000,000.00  | 11,056,478.40   |                 |
|               |      | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 38,350,000.00 | 38,145,211.00   |                 |
|               |      | 6.5 MEXICAN BONOS 220609 | 35,000,000.00 | 35,749,647.50   |                 |
|               |      | 6.75 MEXICAN BONO 230309 | 20,000,000.00 | 20,724,768.00   |                 |
|               |      | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 35,750,000.00 | 38,150,923.52   |                 |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 20,000,000.00 | 21,256,172.00   |                 |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 10,800,000.00 | 11,186,231.76   |                 |
|               |      | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 24,100,000.00 | 23,972,677.29   |                 |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 231207   | 21,500,000.00 | 23,043,485.00   |                 |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 240905   | 15,000,000.00 | 16,170,030.00   |                 |
|               |      | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 22,000,000.00 | 22,206,360.00   |                 |
|               |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 33,400,000.00 | 37,414,215.74   |                 |

|               |      |                          |                |                                   |  |
|---------------|------|--------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
|               |      | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 | 22,200,000.00  | 24,118,379.70                     |  |
| メキシコペソ合計      |      |                          | 351,850,000.00 | 374,582,347.41<br>(1,951,574,030) |  |
| イスラエル<br>シェケル | 国債証券 | 1.5 ISRAEL FIXED 231130  | 4,000,000.00   | 4,154,200.00                      |  |
|               |      | 1.75 ISRAEL FIXED 250831 | 3,800,000.00   | 4,057,070.00                      |  |
|               |      | 2.25 ISRAEL FIXED 280928 | 4,000,000.00   | 4,441,800.00                      |  |
|               |      | 4.25 ISRAEL FIXED 230331 | 4,500,000.00   | 4,868,325.00                      |  |
|               |      | 5.5 ISRAEL FIXED 420131  | 5,850,000.00   | 9,487,237.50                      |  |
|               |      | 6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 6,000,000.00   | 8,025,600.00                      |  |
| イスラエルシェケル合計   |      |                          | 28,150,000.00  | 35,034,232.50<br>(1,151,575,222)  |  |
| ポーランド<br>ズロチ  | 国債証券 | 0.75 POLAND 250425       | 6,000,000.00   | 6,045,979.20                      |  |
|               |      | 1.25 POLAND 301025       | 2,700,000.00   | 2,638,363.93                      |  |
|               |      | 2.25 POLAND 241025       | 4,000,000.00   | 4,256,113.60                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 230125        | 4,800,000.00   | 5,019,108.48                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 240425        | 3,000,000.00   | 3,200,460.30                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 260725        | 5,000,000.00   | 5,437,652.00                      |  |
|               |      | 2.5 POLAND 270725        | 3,600,000.00   | 3,932,758.08                      |  |
|               |      | 2.75 POLAND 280425       | 3,700,000.00   | 4,089,980.00                      |  |
|               |      | 2.75 POLAND 291025       | 5,000,000.00   | 5,564,000.00                      |  |
|               |      | 3.25 POLAND 250725       | 3,550,000.00   | 3,947,839.27                      |  |
|               |      | 4 POLAND 231025          | 4,150,000.00   | 4,560,020.00                      |  |
|               |      | 5.75 POLAND 220923       | 2,500,000.00   | 2,714,000.00                      |  |
|               |      | 5.75 POLAND 290425       | 1,400,000.00   | 1,880,410.00                      |  |
|               |      | POLAND 220725            | 5,000,000.00   | 4,996,864.35                      |  |
| ポーランドズロチ合計    |      |                          | 54,400,000.00  | 58,283,549.21<br>(1,620,865,503)  |  |
| ユーロ           | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 230715    | 1,400,000.00   | 1,421,709.38                      |  |
|               |      | 0 BUND 260815            | 3,150,000.00   | 3,267,589.50                      |  |
|               |      | 0 BUND 290815            | 3,950,000.00   | 4,109,556.30                      |  |
|               |      | 0 BUND 300815            | 4,050,000.00   | 4,203,239.85                      |  |
|               |      | 0 BUND 350515            | 1,150,000.00   | 1,167,942.30                      |  |
|               |      | 0 BUND 500815            | 2,600,000.00   | 2,445,770.60                      |  |
|               |      | 0 FINNISH GOVT 220415    | 500,000.00     | 503,597.25                        |  |
|               |      | 0 FINNISH GOVT 230915    | 650,000.00     | 661,357.77                        |  |
|               |      | 0 NETH GOVT 520115       | 920,000.00     | 844,182.99                        |  |
|               |      | 0 O.A.T 220525           | 1,300,000.00   | 1,310,290.41                      |  |
|               |      | 0 O.A.T 230325           | 4,400,000.00   | 4,461,248.00                      |  |
|               |      | 0 O.A.T 240325           | 5,000,000.00   | 5,100,935.00                      |  |
|               |      | 0 O.A.T 250325           | 5,200,000.00   | 5,328,928.80                      |  |
|               |      | 0 OBL 220408             | 3,700,000.00   | 3,726,455.00                      |  |
|               |      | 0 OBL 231013             | 3,500,000.00   | 3,568,387.55                      |  |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 0 OBL 240405             | 2,300,000.00 | 2,353,399.10 |  |
| 0 OBL 241018             | 5,000,000.00 | 5,134,480.00 |  |
| 0 SPAIN GOVT 230430      | 4,100,000.00 | 4,145,305.00 |  |
| 0.1 BEL GOVT 300622      | 1,470,000.00 | 1,507,236.41 |  |
| 0.125 FINNISH GOV 360415 | 670,000.00   | 667,125.70   |  |
| 0.125 FINNISH GOV 520415 | 300,000.00   | 271,875.00   |  |
| 0.2 BEL GOVT 231022      | 1,900,000.00 | 1,944,742.91 |  |
| 0.25 BUND 270215         | 4,200,000.00 | 4,427,606.40 |  |
| 0.25 BUND 280815         | 3,600,000.00 | 3,818,448.00 |  |
| 0.25 BUND 290215         | 4,200,000.00 | 4,458,644.40 |  |
| 0.25 NETH GOVT 250715    | 2,250,000.00 | 2,340,202.50 |  |
| 0.25 O.A.T 261125        | 4,750,000.00 | 4,952,689.15 |  |
| 0.35 ITALY GOVT 250201   | 3,200,000.00 | 3,266,563.84 |  |
| 0.35 SPAIN GOVT 230730   | 3,700,000.00 | 3,776,386.50 |  |
| 0.4 BEL GOVT 400622      | 900,000.00   | 890,110.08   |  |
| 0.4 IRISH GOVT 350515    | 800,000.00   | 821,908.40   |  |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 270420  | 1,240,000.00 | 1,316,925.88 |  |
| 0.5 AUSTRIA GOVT 290220  | 3,100,000.00 | 3,304,277.60 |  |
| 0.5 BEL GOVT 241022      | 1,800,000.00 | 1,875,592.80 |  |
| 0.5 BUND 250215          | 4,150,000.00 | 4,355,039.05 |  |
| 0.5 BUND 260215          | 3,400,000.00 | 3,604,340.00 |  |
| 0.5 BUND 270815          | 4,640,000.00 | 4,979,935.68 |  |
| 0.5 BUND 280215          | 3,300,000.00 | 3,552,951.60 |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 260415  | 700,000.00   | 739,102.00   |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 270915  | 800,000.00   | 850,907.20   |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 280915  | 700,000.00   | 746,488.40   |  |
| 0.5 FINNISH GOVT 290915  | 800,000.00   | 854,068.00   |  |
| 0.5 NETH GOVT 260715     | 2,400,000.00 | 2,544,412.80 |  |
| 0.5 NETH GOVT 400115     | 950,000.00   | 1,020,042.74 |  |
| 0.5 O.A.T 250525         | 9,100,000.00 | 9,527,973.00 |  |
| 0.5 O.A.T 260525         | 5,300,000.00 | 5,586,512.70 |  |
| 0.5 O.A.T 290525         | 7,180,000.00 | 7,626,746.78 |  |
| 0.5 O.A.T 720525         | 1,050,000.00 | 874,475.49   |  |
| 0.5 SPAIN GOVT 300430    | 3,150,000.00 | 3,248,167.86 |  |
| 0.65 ITALY GOVT 231015   | 3,400,000.00 | 3,488,417.00 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 1,350,000.00 | 1,449,053.55 |  |
| 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 1,450,000.00 | 1,568,520.10 |  |
| 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 450,000.00   | 491,809.50   |  |
| 0.75 NETH GOVT 270715    | 2,500,000.00 | 2,705,236.50 |  |
| 0.75 NETH GOVT 280715    | 5,130,000.00 | 5,589,630.55 |  |
| 0.75 O.A.T 280525        | 6,700,000.00 | 7,237,125.60 |  |
| 0.75 O.A.T 281125        | 6,830,000.00 | 7,390,920.58 |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 0.75 O.A.T 520525        | 2,350,000.00 | 2,345,247.81 |
| 0.8 BEL GOVT 250622      | 3,100,000.00 | 3,290,287.61 |
| 0.8 BEL GOVT 270622      | 3,200,000.00 | 3,454,620.80 |
| 0.8 BEL GOVT 280622      | 2,100,000.00 | 2,280,627.30 |
| 0.875 FINNISH GOV 250915 | 900,000.00   | 961,468.29   |
| 0.9 BEL GOVT 290622      | 2,300,000.00 | 2,522,911.40 |
| 0.9 IRISH GOVT 280515    | 1,200,000.00 | 1,307,583.60 |
| 0.95 ITALY GOVT 230301   | 3,000,000.00 | 3,078,792.00 |
| 0.95 ITALY GOVT 230315   | 4,900,000.00 | 5,030,746.70 |
| 1 BEL GOVT 260622        | 1,300,000.00 | 1,407,233.88 |
| 1 BEL GOVT 310622        | 1,500,000.00 | 1,669,788.00 |
| 1 BUND 240815            | 3,600,000.00 | 3,818,440.80 |
| 1 BUND 250815            | 5,400,000.00 | 5,817,148.38 |
| 1 IRISH GOVT 260515      | 2,100,000.00 | 2,265,490.92 |
| 1 O.A.T 251125           | 2,600,000.00 | 2,794,391.60 |
| 1 O.A.T 270525           | 4,800,000.00 | 5,234,304.00 |
| 1.1 IRISH GOVT 290515    | 1,170,000.00 | 1,298,170.69 |
| 1.125 FINNISH GOV 340415 | 900,000.00   | 1,028,939.85 |
| 1.2 AUSTRIA GOVT 251020  | 1,300,000.00 | 1,409,844.80 |
| 1.2 SPAIN GOVT 401031    | 1,830,000.00 | 1,924,952.11 |
| 1.25 BEL GOVT 330422     | 1,320,000.00 | 1,514,753.85 |
| 1.25 BUND 480815         | 3,100,000.00 | 3,995,776.00 |
| 1.25 ITALY GOVT 261201   | 3,750,000.00 | 4,004,351.25 |
| 1.25 O.A.T 340525        | 4,510,000.00 | 5,165,947.93 |
| 1.25 O.A.T 360525        | 5,100,000.00 | 5,856,483.00 |
| 1.25 SPAIN GOVT 301031   | 3,300,000.00 | 3,624,720.00 |
| 1.3 IRISH GOVT 330515    | 1,100,000.00 | 1,262,328.43 |
| 1.3 SPAIN GOVT 261031    | 2,900,000.00 | 3,156,697.85 |
| 1.35 IRISH GOVT 310318   | 280,000.00   | 320,533.08   |
| 1.35 ITALY GOVT 220415   | 850,000.00   | 866,175.41   |
| 1.375 FINNISH GOV 470415 | 580,000.00   | 726,873.40   |
| 1.4 SPAIN GOVT 280730    | 3,800,000.00 | 4,202,720.20 |
| 1.45 BEL GOVT 370622     | 250,000.00   | 295,140.75   |
| 1.45 ITALY GOVT 220915   | 1,950,000.00 | 2,004,424.50 |
| 1.45 ITALY GOVT 241115   | 1,800,000.00 | 1,909,530.00 |
| 1.45 ITALY GOVT 250515   | 3,300,000.00 | 3,518,139.90 |
| 1.45 ITALY GOVT 360301   | 1,750,000.00 | 1,858,078.25 |
| 1.45 SPAIN GOVT 271031   | 3,300,000.00 | 3,644,896.20 |
| 1.45 SPAIN GOVT 290430   | 3,240,000.00 | 3,607,448.40 |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 900,000.00   | 1,141,615.80 |
| 1.5 AUSTRIA GOVT 861102  | 530,000.00   | 747,212.55   |
| 1.5 BUND 220904          | 2,800,000.00 | 2,890,033.44 |
| 1.5 BUND 230215          | 3,300,000.00 | 3,440,321.28 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 1.5 BUND 230515          | 5,500,000.00 | 5,765,635.15 |  |
| 1.5 BUND 240515          | 3,000,000.00 | 3,215,739.00 |  |
| 1.5 FINNISH GOVT 230415  | 550,000.00   | 575,033.25   |  |
| 1.5 IRISH GOVT 500515    | 700,000.00   | 847,615.30   |  |
| 1.5 ITALY GOVT 250601    | 2,980,000.00 | 3,185,757.08 |  |
| 1.5 O.A.T 310525         | 5,300,000.00 | 6,161,488.50 |  |
| 1.5 O.A.T 500525         | 3,750,000.00 | 4,533,652.50 |  |
| 1.5 SPAIN GOVT 270430    | 3,100,000.00 | 3,424,542.10 |  |
| 1.6 BEL GOVT 470622      | 1,540,000.00 | 1,879,198.86 |  |
| 1.6 ITALY GOVT 260601    | 4,300,000.00 | 4,659,521.28 |  |
| 1.6 SPAIN GOVT 250430    | 2,900,000.00 | 3,141,664.54 |  |
| 1.625 FINNISH GOV 220915 | 550,000.00   | 569,070.15   |  |
| 1.65 AUSTRIA GOVT 241021 | 2,100,000.00 | 2,276,456.70 |  |
| 1.65 ITALY GOVT 320301   | 2,950,000.00 | 3,249,006.10 |  |
| 1.7 IRISH GOVT 370515    | 630,000.00   | 770,147.28   |  |
| 1.75 AUSTRIA GOVT 231020 | 1,900,000.00 | 2,019,527.10 |  |
| 1.75 BUND 240215         | 3,950,000.00 | 4,241,241.40 |  |
| 1.75 NETH GOVT 230715    | 3,100,000.00 | 3,279,268.35 |  |
| 1.75 O.A.T 230525        | 7,800,000.00 | 8,215,950.60 |  |
| 1.75 O.A.T 241125        | 4,400,000.00 | 4,792,440.40 |  |
| 1.75 O.A.T 390625        | 3,780,000.00 | 4,709,653.20 |  |
| 1.75 O.A.T 660525        | 1,660,000.00 | 2,215,300.04 |  |
| 1.85 ITALY GOVT 240515   | 1,200,000.00 | 1,280,445.84 |  |
| 1.85 ITALY GOVT 250701   | 2,200,000.00 | 2,385,732.58 |  |
| 1.9 BEL GOVT 380622      | 1,050,000.00 | 1,323,905.10 |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 260430   | 3,000,000.00 | 3,349,644.00 |  |
| 1.95 SPAIN GOVT 300730   | 3,250,000.00 | 3,786,058.25 |  |
| 2 BUND 230815            | 3,100,000.00 | 3,306,206.73 |  |
| 2 FINNISH GOVT 240415    | 1,050,000.00 | 1,137,675.00 |  |
| 2 IRISH GOVT 450218      | 1,000,000.00 | 1,326,843.00 |  |
| 2 ITALY GOVT 251201      | 2,900,000.00 | 3,184,044.56 |  |
| 2 ITALY GOVT 280201      | 3,600,000.00 | 4,034,840.04 |  |
| 2 NETH GOVT 240715       | 2,200,000.00 | 2,399,663.20 |  |
| 2 O.A.T 480525           | 3,220,000.00 | 4,298,799.82 |  |
| 2.05 ITALY GOVT 270801   | 4,100,000.00 | 4,591,462.08 |  |
| 2.1 AUSTRIA GOVT 170920  | 810,000.00   | 1,461,826.44 |  |
| 2.15 BEL GOVT 660622     | 890,000.00   | 1,306,433.67 |  |
| 2.15 SPAIN GOVT 251031   | 3,500,000.00 | 3,910,196.15 |  |
| 2.2 ITALY GOVT 270601    | 1,950,000.00 | 2,199,680.53 |  |
| 2.25 BEL GOVT 230622     | 2,150,000.00 | 2,294,328.42 |  |
| 2.25 BEL GOVT 570622     | 1,150,000.00 | 1,672,672.70 |  |
| 2.25 ITALY GOVT 360901   | 2,150,000.00 | 2,524,938.50 |  |
|                          |              |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 2.25 O.A.T 221025        | 1,000,000.00 | 1,047,043.00 |
| 2.25 O.A.T 240525        | 4,450,000.00 | 4,865,932.60 |
| 2.35 SPAIN GOVT 330730   | 4,590,000.00 | 5,635,051.20 |
| 2.4 AUSTRIA GOVT 340523  | 900,000.00   | 1,182,069.90 |
| 2.4 IRISH GOVT 300515    | 1,740,000.00 | 2,151,555.24 |
| 2.45 ITALY GOVT 330901   | 2,150,000.00 | 2,559,728.08 |
| 2.45 ITALY GOVT 500901   | 2,420,000.00 | 2,912,820.90 |
| 2.5 BUND 440704          | 3,080,000.00 | 4,821,493.60 |
| 2.5 BUND 460815          | 3,480,000.00 | 5,566,177.87 |
| 2.5 ITALY GOVT 241201    | 2,500,000.00 | 2,749,778.25 |
| 2.5 ITALY GOVT 251115    | 1,700,000.00 | 1,904,989.40 |
| 2.5 NETH GOVT 330115     | 2,070,000.00 | 2,728,233.91 |
| 2.5 O.A.T 300525         | 7,800,000.00 | 9,737,995.80 |
| 2.625 FINNISH GOV 420704 | 450,000.00   | 668,601.00   |
| 2.7 ITALY GOVT 470301    | 2,680,000.00 | 3,370,030.32 |
| 2.7 SPAIN GOVT 481031    | 2,200,000.00 | 3,009,215.88 |
| 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 890,000.00   | 1,097,962.56 |
| 2.75 NETH GOVT 470115    | 1,900,000.00 | 3,128,768.00 |
| 2.75 O.A.T 271025        | 5,530,000.00 | 6,706,058.46 |
| 2.75 SPAIN GOVT 241031   | 3,000,000.00 | 3,348,926.10 |
| 2.8 ITALY GOVT 281201    | 4,860,000.00 | 5,773,009.32 |
| 2.8 ITALY GOVT 670301    | 1,900,000.00 | 2,417,115.97 |
| 2.9 SPAIN GOVT 461031    | 2,380,000.00 | 3,341,957.20 |
| 2.95 ITALY GOVT 380901   | 2,080,000.00 | 2,664,729.80 |
| 3 BEL GOVT 340622        | 1,200,000.00 | 1,656,254.40 |
| 3 O.A.T 220425           | 1,000,000.00 | 1,039,953.50 |
| 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 790,000.00   | 1,295,989.86 |
| 3.25 BUND 420704         | 2,310,000.00 | 3,902,978.31 |
| 3.25 ITALY GOVT 460901   | 2,610,000.00 | 3,583,668.33 |
| 3.25 O.A.T 450525        | 2,970,000.00 | 4,775,896.62 |
| 3.35 ITALY GOVT 350301   | 1,950,000.00 | 2,560,498.20 |
| 3.4 AUSTRIA GOVT 221122  | 1,750,000.00 | 1,869,166.25 |
| 3.4 IRISH GOVT 240318    | 750,000.00   | 840,708.75   |
| 3.45 ITALY GOVT 480301   | 2,450,000.00 | 3,495,446.85 |
| 3.45 SPAIN GOVT 660730   | 2,180,000.00 | 3,545,024.44 |
| 3.5 ITALY GOVT 300301    | 5,200,000.00 | 6,578,182.00 |
| 3.5 O.A.T 260425         | 3,300,000.00 | 3,991,821.90 |
| 3.65 AUSTRIA GOVT 220420 | 1,250,000.00 | 1,307,895.87 |
| 3.75 BEL GOVT 450622     | 1,490,000.00 | 2,548,585.40 |
| 3.75 ITALY GOVT 240901   | 2,100,000.00 | 2,389,052.82 |
| 3.75 NETH GOVT 230115    | 1,350,000.00 | 1,460,211.30 |
| 3.75 NETH GOVT 420115    | 1,830,000.00 | 3,202,973.97 |
| 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 640,000.00   | 1,395,808.00 |

|                          |              |              |  |
|--------------------------|--------------|--------------|--|
| 3.8 SPAIN GOVT 240430    | 4,800,000.00 | 5,444,025.60 |  |
| 3.9 IRISH GOVT 230320    | 2,200,000.00 | 2,400,210.34 |  |
| 4 BEL GOVT 320328        | 1,090,000.00 | 1,580,456.83 |  |
| 4 BUND 370104            | 2,750,000.00 | 4,557,676.75 |  |
| 4 FINNISH GOVT 250704    | 750,000.00   | 901,731.00   |  |
| 4 ITALY GOVT 370201      | 3,500,000.00 | 4,985,085.00 |  |
| 4 NETH GOVT 370115       | 1,870,000.00 | 3,058,385.74 |  |
| 4 O.A.T 381025           | 3,590,000.00 | 5,858,098.44 |  |
| 4 O.A.T 550425           | 2,050,000.00 | 4,045,005.67 |  |
| 4 O.A.T 600425           | 2,040,000.00 | 4,220,683.08 |  |
| 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 2,020,000.00 | 3,310,306.31 |  |
| 4.2 SPAIN GOVT 370131    | 2,330,000.00 | 3,571,811.24 |  |
| 4.25 BEL GOVT 410328     | 2,360,000.00 | 4,068,052.36 |  |
| 4.25 BUND 390704         | 2,450,000.00 | 4,394,859.00 |  |
| 4.25 O.A.T 231025        | 7,000,000.00 | 7,905,044.00 |  |
| 4.4 SPAIN GOVT 231031    | 3,100,000.00 | 3,501,174.41 |  |
| 4.5 BEL GOVT 260328      | 980,000.00   | 1,233,459.36 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 230501    | 5,100,000.00 | 5,627,809.20 |  |
| 4.5 ITALY GOVT 240301    | 2,900,000.00 | 3,309,335.00 |  |
| 4.5 O.A.T 410425         | 4,610,000.00 | 8,242,034.60 |  |
| 4.65 SPAIN GOVT 250730   | 4,400,000.00 | 5,374,360.20 |  |
| 4.7 SPAIN GOVT 410730    | 2,650,000.00 | 4,522,516.50 |  |
| 4.75 BUND 280704         | 2,100,000.00 | 2,936,209.50 |  |
| 4.75 BUND 340704         | 3,960,000.00 | 6,631,598.55 |  |
| 4.75 BUND 400704         | 2,500,000.00 | 4,824,125.00 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 230801   | 4,300,000.00 | 4,823,740.00 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 280901   | 5,850,000.00 | 7,759,644.75 |  |
| 4.75 ITALY GOVT 440901   | 2,470,000.00 | 4,107,001.63 |  |
| 4.75 O.A.T 350425        | 3,380,000.00 | 5,561,621.00 |  |
| 4.8 SPAIN GOVT 240131    | 2,400,000.00 | 2,766,492.00 |  |
| 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 800,000.00   | 1,021,407.68 |  |
| 4.9 SPAIN GOVT 400730    | 2,210,000.00 | 3,813,244.27 |  |
| 5 BEL GOVT 350328        | 2,400,000.00 | 4,011,088.80 |  |
| 5 ITALY GOVT 220301      | 3,650,000.00 | 3,836,332.50 |  |
| 5 ITALY GOVT 250301      | 3,850,000.00 | 4,637,132.50 |  |
| 5 ITALY GOVT 340801      | 3,100,000.00 | 4,698,826.55 |  |
| 5 ITALY GOVT 390801      | 2,920,000.00 | 4,749,634.04 |  |
| 5 ITALY GOVT 400901      | 3,630,000.00 | 5,963,197.02 |  |
| 5.15 SPAIN GOVT 281031   | 2,800,000.00 | 3,898,440.56 |  |
| 5.15 SPAIN GOVT 441031   | 2,100,000.00 | 3,923,178.21 |  |
| 5.25 ITALY GOVT 291101   | 6,680,000.00 | 9,410,176.12 |  |
| 5.4 IRISH GOVT 250313    | 1,600,000.00 | 1,984,664.00 |  |
|                          |              |              |  |

|       |                          |                |                                      |  |
|-------|--------------------------|----------------|--------------------------------------|--|
|       | 5.5 BEL GOVT 280328      | 1,690,000.00   | 2,402,044.32                         |  |
|       | 5.5 BUND 310104          | 3,390,000.00   | 5,399,995.41                         |  |
|       | 5.5 ITALY GOVT 221101    | 5,300,000.00   | 5,801,404.91                         |  |
|       | 5.5 NETH GOVT 280115     | 2,600,000.00   | 3,681,220.40                         |  |
|       | 5.5 O.A.T 290425         | 6,340,000.00   | 9,359,900.50                         |  |
|       | 5.625 BUND 280104        | 2,700,000.00   | 3,870,517.50                         |  |
|       | 5.75 ITALY GOVT 330201   | 3,350,000.00   | 5,239,969.50                         |  |
|       | 5.75 O.A.T 321025        | 4,080,000.00   | 6,826,602.96                         |  |
|       | 5.75 SPAIN GOVT 320730   | 4,130,000.00   | 6,618,861.90                         |  |
|       | 5.9 SPAIN GOVT 260730    | 3,200,000.00   | 4,266,057.60                         |  |
|       | 6 ITALY GOVT 310501      | 4,220,000.00   | 6,454,515.32                         |  |
|       | 6 O.A.T 251025           | 5,000,000.00   | 6,540,555.00                         |  |
|       | 6 SPAIN GOVT 290131      | 3,500,000.00   | 5,145,674.80                         |  |
|       | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 1,400,000.00   | 2,005,882.48                         |  |
|       | 6.25 BUND 240104         | 3,300,000.00   | 3,950,059.74                         |  |
|       | 6.25 BUND 300104         | 1,700,000.00   | 2,732,070.00                         |  |
|       | 6.5 BUND 270704          | 2,070,000.00   | 3,022,622.28                         |  |
|       | 6.5 ITALY GOVT 271101    | 4,070,000.00   | 5,751,752.49                         |  |
|       | 7.25 ITALY GOVT 261101   | 2,400,000.00   | 3,368,817.60                         |  |
|       | 7.5 NETH GOVT 230115     | 400,000.00     | 460,192.00                           |  |
|       | 8.5 O.A.T 230425         | 4,150,000.00   | 4,952,261.40                         |  |
|       | 9 ITALY GOVT 231101      | 2,550,000.00   | 3,171,923.07                         |  |
| ユーロ合計 |                          | 682,200,000.00 | 830,947,222.17<br>(106,901,360,132)  |  |
| 合計    |                          |                | 258,980,727,601<br>(258,980,727,601) |  |

(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<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|------------|--------------|-------------------------|
| アメリカドル     | 国債証券 160銘柄 | 100.00%      | 43.90%                  |
| カナダドル      | 国債証券 22銘柄  | 100.00%      | 1.94%                   |
| オーストラリアドル  | 国債証券 21銘柄  | 100.00%      | 2.36%                   |
| イギリスポンド    | 国債証券 39銘柄  | 100.00%      | 6.76%                   |
| シンガポールドル   | 国債証券 13銘柄  | 100.00%      | 0.42%                   |
| マレーシアリンギット | 国債証券 12銘柄  | 100.00%      | 0.47%                   |
| スウェーデンクローネ | 国債証券 7銘柄   | 100.00%      | 0.33%                   |
| ノルウェークローネ  | 国債証券 9銘柄   | 100.00%      | 0.24%                   |
| デンマーククローネ  | 国債証券 6銘柄   | 100.00%      | 0.48%                   |



|           |      |       |         |        |
|-----------|------|-------|---------|--------|
| メキシコペソ    | 国債証券 | 14銘柄  | 100.00% | 0.75%  |
| イスラエルシェケル | 国債証券 | 6銘柄   | 100.00% | 0.44%  |
| ポーランドズロチ  | 国債証券 | 14銘柄  | 100.00% | 0.63%  |
| ユーロ       | 国債証券 | 249銘柄 | 100.00% | 41.28% |

## 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。

## ヘッジ付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 3年 3月25日現在] |               |
| 資産の部            |               |
| 流動資産            |               |
| 預金              | 28,878,962    |
| コール・ローン         | 121,507,255   |
| 国債証券            | 4,666,207,753 |
| 派生商品評価勘定        | 2,432,507     |
| 未収利息            | 37,135,142    |
| 前払費用            | 15,501,756    |
| 流動資産合計          | 4,871,663,375 |
| 資産合計            | 4,871,663,375 |
| 負債の部            |               |
| 流動負債            |               |
| 派生商品評価勘定        | 82,283,467    |
| 未払金             | 110,033,356   |
| 未払解約金           | 256,134       |
| 未払利息            | 21            |
| 流動負債合計          | 192,572,978   |
| 負債合計            | 192,572,978   |
| 純資産の部           |               |
| 元本等             |               |
| 元本              | 4,058,904,669 |
| 剰余金             |               |
| 剰余金又は欠損金（△）     | 620,185,728   |
| 元本等合計           | 4,679,090,397 |
| 純資産合計           | 4,679,090,397 |
| 負債純資産合計         | 4,871,663,375 |

### 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<br>「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 3年 3月25日現在] |
|-----------------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                                   | 令和 2年 3月26日     |
| 期首元本額                                   | 1,072,788,155円  |
| 期中追加設定元本額                               | 9,318,745,902円  |
| 期中一部解約元本額                               | 6,332,629,388円  |
| 元本の内訳※                                  |                 |
| eMAXIS 新興国債券インデックス（為替ヘッジあり）             | 744,607,288円    |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）              | 171,469,563円    |
| ヘッジ付新興国債券インデックスファンド                     | 379,620,893円    |
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）        | 223,255,580円    |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 325,600,248円    |
| MUKAM バランスファンド2020-04（適格機関投資家限定）        | 241,314,795円    |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）        | 230,823,687円    |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定） | 318,922,710円    |
| MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）        | 229,655,907円    |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定） | 316,987,527円    |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 318,739,996円    |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）        | 224,013,312円    |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 333,893,163円    |
| 合計                                      | 4,058,904,669円  |
| 2. 受益権の総数                               | 4,058,904,669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 2年 3月26日<br>至 令和 3年 3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 | <p>当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、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。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                                                                                                                                                                         |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | [令和 3年 3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 | △120,709,231       |
| 合計   | △120,709,231       |

（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 3年 3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<br>の取引 | 為替予約取引<br>買建 |               |       |               |             |
|               | アメリカドル       | 96,688,532    | —     | 96,894,300    | 205,768     |
|               | 売建           |               |       |               |             |
|               | アメリカドル       | 4,549,759,072 | —     | 4,629,815,800 | △80,056,728 |
| 合計            |              | 4,646,447,604 | —     | 4,726,710,100 | △79,850,960 |

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

|           | [令和 3年 3月25日現在] |
|-----------|-----------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1528円         |

|              |                 |
|--------------|-----------------|
|              | [令和 3年 3月25日現在] |
| (1万口当たり純資産額) | (11,528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<br>ドル | 国債証券 | 1 ARGENTINA 290709      | 91,576.00  | 33,870.28  |    |
|            |      | 11.875 TURKEY 300115    | 180,000.00 | 234,539.10 |    |
|            |      | 2.844 PERU 300620       | 450,000.00 | 460,602.00 |    |
|            |      | 3 ROMANIA 310214        | 100,000.00 | 100,809.40 |    |
|            |      | 3.125 COLOMBIA 310415   | 800,000.00 | 791,800.00 |    |
|            |      | 3.25 TURKEY 230323      | 400,000.00 | 384,822.00 |    |
|            |      | 3.375 INDONESIA 230415  | 200,000.00 | 210,448.76 |    |
|            |      | 3.5 INDONESIA 280111    | 200,000.00 | 215,722.61 |    |
|            |      | 3.6 MEXICO 250130       | 400,000.00 | 437,100.00 |    |
|            |      | 3.7 INDONESIA 491030    | 600,000.00 | 617,285.59 |    |
|            |      | 3.7 PHILIPPINE 420202   | 400,000.00 | 427,501.02 |    |
|            |      | 3.75 MEXICO 280111      | 600,000.00 | 645,111.00 |    |
|            |      | 3.75 PANAMA 250316      | 200,000.00 | 217,981.00 |    |
|            |      | 3.75 PHILIPPINE 290114  | 400,000.00 | 445,512.50 |    |
|            |      | 3.85 INDONESIA 301015   | 200,000.00 | 222,698.00 |    |
|            |      | 3.875 PANAMA 280317     | 200,000.00 | 218,971.00 |    |
|            |      | 3.95 PHILIPPINE 400120  | 400,000.00 | 437,898.00 |    |
|            |      | 4 MEXICO 231002         | 220,000.00 | 237,895.90 |    |
|            |      | 4 ROMANIA 510214        | 190,000.00 | 188,040.15 |    |
|            |      | 4.1 INDONESIA 280424    | 400,000.00 | 446,143.98 |    |
|            |      | 4.125 INDONESIA 250115  | 400,000.00 | 439,278.72 |    |
|            |      | 4.125 MEXICO 260121     | 200,000.00 | 223,462.00 |    |
|            |      | 4.125 PERU 270825       | 200,000.00 | 224,714.00 |    |
|            |      | 4.3 SOUTH AFRICA 281012 | 400,000.00 | 398,770.00 |    |
|            |      | 4.35 INDONESIA 270108   | 600,000.00 | 676,301.64 |    |
|            |      | 4.375 RUSSIA 290321     | 600,000.00 | 661,471.80 |    |
|            |      | 4.5 COLOMBIA 260128     | 800,000.00 | 881,884.00 |    |
|            |      | 4.5 COLOMBIA 290315     | 400,000.00 | 440,664.00 |    |

|                          |            |            |  |
|--------------------------|------------|------------|--|
| 4.5 MEXICO 290422        | 600,000.00 | 667,983.00 |  |
| 4.5 MEXICO 500131        | 400,000.00 | 413,800.00 |  |
| 4.5 PANAMA 500416        | 200,000.00 | 223,002.00 |  |
| 4.5 PANAMA 560401        | 200,000.00 | 221,750.00 |  |
| 4.6 MEXICO 460123        | 400,000.00 | 416,718.00 |  |
| 4.6 MEXICO 480210        | 200,000.00 | 208,533.00 |  |
| 4.625 BRAZIL 280113      | 600,000.00 | 638,685.00 |  |
| 4.75 BRAZIL 500114       | 400,000.00 | 368,180.00 |  |
| 4.75 INDONESIA 290211    | 200,000.00 | 232,532.88 |  |
| 4.75 MEXICO 320427       | 200,000.00 | 225,200.00 |  |
| 4.75 RUSSIA 260527       | 800,000.00 | 900,768.80 |  |
| 4.85 SOUTH AFRICA 290930 | 400,000.00 | 407,232.00 |  |
| 4.875 ROMANIA 240122     | 150,000.00 | 166,980.45 |  |
| 4.875 SOUTH AFRIC 260414 | 400,000.00 | 423,660.00 |  |
| 4.875 TURKEY 261009      | 400,000.00 | 370,708.00 |  |
| 4.875 TURKEY 430416      | 400,000.00 | 305,900.00 |  |
| 5 BRAZIL 450127          | 200,000.00 | 193,537.00 |  |
| 5 COLOMBIA 450615        | 400,000.00 | 435,500.00 |  |
| 5.1 RUSSIA 350328        | 400,000.00 | 465,546.00 |  |
| 5.125 INDONESIA 450115   | 200,000.00 | 239,690.00 |  |
| 5.125 ROMANIA 480615     | 200,000.00 | 230,194.60 |  |
| 5.2 COLOMBIA 490515      | 400,000.00 | 447,700.00 |  |
| 5.25 INDONESIA 420117    | 400,000.00 | 483,911.36 |  |
| 5.25 RUSSIA 470623       | 600,000.00 | 711,579.00 |  |
| 5.25 TURKEY 300313       | 200,000.00 | 177,278.00 |  |
| 5.35 INDONESIA 490211    | 400,000.00 | 505,988.00 |  |
| 5.375 HUNGARY 240325     | 400,000.00 | 453,468.00 |  |
| 5.5 CROATIA 230404       | 200,000.00 | 219,444.00 |  |
| 5.55 MEXICO 450121       | 160,000.00 | 188,888.00 |  |
| 5.625 BRAZIL 410107      | 400,000.00 | 419,576.00 |  |
| 5.625 BRAZIL 470221      | 400,000.00 | 413,142.00 |  |
| 5.625 PERU 501118        | 280,000.00 | 372,902.60 |  |
| 5.625 RUSSIA 420404      | 800,000.00 | 977,760.00 |  |
| 5.65 SOUTH AFRICA 470927 | 200,000.00 | 187,007.00 |  |
| 5.75 HUNGARY 231122      | 300,000.00 | 339,909.60 |  |
| 5.75 MEXICO 101012       | 570,000.00 | 646,337.25 |  |
| 5.75 TURKEY 240322       | 400,000.00 | 398,000.00 |  |
| 5.75 TURKEY 470511       | 400,000.00 | 325,258.80 |  |
| 5.875 REPUBLIC OF 250916 | 200,000.00 | 222,133.60 |  |
| 5.875 RUSSIA 430916      | 200,000.00 | 252,938.80 |  |
| 5.875 SOUTH AFRIC 300622 | 200,000.00 | 216,415.00 |  |
| 6 BRAZIL 260407          | 200,000.00 | 229,929.00 |  |
|                          |            |            |  |

|          |                         |               |                                  |  |
|----------|-------------------------|---------------|----------------------------------|--|
|          | 6 CROATIA 240126        | 200,000.00    | 229,245.20                       |  |
|          | 6 TURKEY 270325         | 1,400,000.00  | 1,347,416.00                     |  |
|          | 6.05 MEXICO 400111      | 330,000.00    | 404,868.75                       |  |
|          | 6.125 COLOMBIA 410118   | 500,000.00    | 605,750.00                       |  |
|          | 6.125 ROMANIA 440122    | 160,000.00    | 207,000.00                       |  |
|          | 6.125 TURKEY 281024     | 400,000.00    | 380,878.40                       |  |
|          | 6.3 SOUTH AFRICA 480622 | 200,000.00    | 199,040.20                       |  |
|          | 6.375 PHILIPPINE 320115 | 100,000.00    | 134,659.50                       |  |
|          | 6.375 PHILIPPINE 341023 | 400,000.00    | 551,599.18                       |  |
|          | 6.55 PERU 370314        | 160,000.00    | 218,488.80                       |  |
|          | 6.625 TURKEY 450217     | 400,000.00    | 360,080.00                       |  |
|          | 6.7 PANAMA 360126       | 340,000.00    | 460,803.70                       |  |
|          | 6.75 INDONESIA 440115   | 200,000.00    | 286,093.00                       |  |
|          | 6.75 MEXICO 340927      | 720,000.00    | 935,330.40                       |  |
|          | 6.75 TURKEY 400530      | 300,000.00    | 275,589.00                       |  |
|          | 7.125 BRAZIL 370120     | 200,000.00    | 247,205.00                       |  |
|          | 7.25 TURKEY 231223      | 200,000.00    | 206,900.00                       |  |
|          | 7.253 UKRAINE 330315    | 400,000.00    | 407,487.12                       |  |
|          | 7.35 PERU 250721        | 200,000.00    | 248,231.00                       |  |
|          | 7.375 COLOMBIA 370918   | 100,000.00    | 134,300.00                       |  |
|          | 7.375 TURKEY 250205     | 990,000.00    | 1,028,313.00                     |  |
|          | 7.375 UKRAINE 320925    | 400,000.00    | 411,758.40                       |  |
|          | 7.625 HUNGARY 410329    | 140,000.00    | 228,130.28                       |  |
|          | 7.625 TURKEY 290426     | 200,000.00    | 205,689.20                       |  |
|          | 7.75 INDONESIA 380117   | 200,000.00    | 297,039.00                       |  |
|          | 7.75 PHILIPPINE 310114  | 200,000.00    | 292,222.88                       |  |
|          | 7.75 UKRAINE 240901     | 300,000.00    | 326,990.40                       |  |
|          | 7.75 UKRAINE 250901     | 100,000.00    | 109,948.00                       |  |
|          | 7.75 UKRAINE 270901     | 200,000.00    | 216,880.00                       |  |
|          | 8.25 BRAZIL 340120      | 670,000.00    | 894,577.30                       |  |
|          | 8.75 BRAZIL 250204      | 140,000.00    | 174,266.40                       |  |
|          | 9.375 PANAMA 290401     | 480,000.00    | 705,033.60                       |  |
|          | 9.5 PHILIPPINE 300202   | 330,000.00    | 516,151.35                       |  |
|          | 9.75 UKRAINE 281101     | 200,000.00    | 236,244.00                       |  |
|          | FRN ARGENTINA 300709    | 2,750,000.00  | 946,935.00                       |  |
|          | FRN ARGENTINA 350709    | 2,150,000.00  | 654,137.50                       |  |
|          | FRN ARGENTINA 380109    | 1,200,000.00  | 442,800.00                       |  |
|          | FRN ARGENTINA 410709    | 900,000.00    | 319,050.00                       |  |
|          | FRN ARGENTINA 460709    | 455,500.00    | 142,330.08                       |  |
| アメリカドル合計 |                         | 43,807,076.00 | 42,856,426.83<br>(4,666,207,753) |  |
| 合計       |                         |               | 4,666,207,753<br>(4,666,207,753) |  |

(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<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|--------|------------|--------------|-------------------------|
| アメリカドル | 国債証券 109銘柄 | 100.00%      | 100.00%                 |

#### 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】

## 【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）】

## 【純資産額計算書】

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 25,986,641,646  |
| II 負債総額              | 73,471,618      |
| III 純資産総額（I－II）      | 25,913,170,028  |
| IV 発行済口数             | 22,728,430,728口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.1401          |
| （10,000口当たり）         | （11,401）        |

## 【三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）】

## 【純資産額計算書】

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 27,140,085,363  |
| II 負債総額              | 73,924,335      |
| III 純資産総額（I－II）      | 27,066,161,028  |
| IV 発行済口数             | 20,800,306,328口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.3012          |
| （10,000口当たり）         | （13,012）        |

## 【三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）】

## 【純資産額計算書】

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 7,998,913,375  |
| II 負債総額              | 18,817,690     |
| III 純資産総額（I－II）      | 7,980,095,685  |
| IV 発行済口数             | 6,129,553,802口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.3019         |
| （10,000口当たり）         | （13,019）       |

（参考）

## ＴＯＰＩＸマザーファンド

### 純資産額計算書

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 522,651,679,240  |
| II 負債総額              | 11,011,461,238   |
| III 純資産総額（I－II）      | 511,640,218,002  |
| IV 発行済口数             | 230,074,354,501口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 2.2238           |
| （10,000口当たり）         | （22,238）         |

## 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 3年 3月31日現在

（単位：円）

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 925,796,913,213  |
| II 負債総額              | 18,468,855,558   |
| III 純資産総額（I－II）      | 907,328,057,655  |
| IV 発行済口数             | 236,755,542,322口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 3.8323           |
| （10,000口当たり）         | （38,323）         |

## 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 3年 3月31日現在

（単位：円）

|                      |                 |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額               | 212,355,709,228 |
| II 負債総額              | 444,202,356     |
| III 純資産総額（I－II）      | 211,911,506,872 |
| IV 発行済口数             | 65,796,923,909口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 3.2207          |
| （10,000口当たり）         | （32,207）        |

## 国内債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 3年 3月31日現在

(単位：円)

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 156,902,442,247  |
| II 負債総額              | 1,965,523,520    |
| III 純資産総額（I－II）      | 154,936,918,727  |
| IV 発行済口数             | 158,753,652,894口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 0.9760           |
| （10,000口当たり）         | （9,760）          |

## ヘッジ付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 3年 3月31日現在

(単位：円)

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額               | 266,629,123,997  |
| II 負債総額              | 7,860,181,161    |
| III 純資産総額（I－II）      | 258,768,942,836  |
| IV 発行済口数             | 190,190,135,826口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.3606           |
| （10,000口当たり）         | （13,606）         |

## ヘッジ付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 3年 3月31日現在

(単位：円)

|                      |                |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額               | 5,148,881,565  |
| II 負債総額              | 419,566,077    |
| III 純資産総額（I－II）      | 4,729,315,488  |
| IV 発行済口数             | 4,143,956,660口 |
| V 1口当たり純資産価額（III／IV） | 1.1413         |
| （10,000口当たり）         | （11,413）       |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換等

該当事項はありません。

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

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

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

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### （1）資本金の額等

2021年3月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

###### （2）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### ①投資環境見通しの策定

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

###### ②運用戦略の決定

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

###### ③運用計画の決定

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

###### ④ポートフォリオの構築

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

###### ⑤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。

###### ⑥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。

###### ⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

###### ⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2021年 3月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本 数<br>(本) | 純資産総額<br>(百万円) |
|------------|------------|----------------|
| 追加型株式投資信託  | 877        | 16,533,818     |
| 追加型公社債投資信託 | 16         | 1,480,056      |
| 単位型株式投資信託  | 77         | 343,121        |
| 単位型公社債投資信託 | 40         | 173,598        |
| 合 計        | 1,010      | 18,530,593     |

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### （1）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

#### （2）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度に係る中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

#### （1）【貸借対照表】

(単位：千円)

| 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>(平成31年3月31日現在) |           | 第35期<br>(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<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |             |
|                             |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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 |       |  |  |          |  |
|--|------|-------|--|--|----------|--|
|  |      | 資本剰余金 |  |  | 利益剰余金    |  |
|  |      |       |  |  | その他利益剰余金 |  |

|                             | 資本金       | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 | 利益剰余金<br>合計 | 株主資本合計     |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
| 当期首残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 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<br>項目の当期変動額<br>(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             |                | 純資産合計      |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 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<br>項目の当期変動額<br>(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。

## ①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

## ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (5)役員退職慰労引当金

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

## (6)時効後支払損引当金

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

## 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<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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<br>株式数 (株) | 当事業年度増加<br>株式数 (株) | 当事業年度減少<br>株式数 (株) | 当事業年度末<br>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。

- |   |          |              |
|---|----------|--------------|
| ① | 配当金の総額   | 11,363,380千円 |
| ② | 1株当たり配当額 | 53,707円      |
| ③ | 基準日      | 平成30年3月31日   |
| ④ | 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。

- |   |          |             |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額   | 9,675,175千円 |
| ② | 配当の原資    | 利益剰余金       |
| ③ | 1株当たり配当額 | 45,728円     |
| ④ | 基準日      | 平成31年3月31日  |
| ⑤ | 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<br>株式数 (株) | 当事業年度増加<br>株式数 (株) | 当事業年度減少<br>株式数 (株) | 当事業年度末<br>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。

- |   |          |             |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額   | 9,675,175千円 |
| ② | 1株当たり配当額 | 45,728円     |
| ③ | 基準日      | 平成31年3月31日  |
| ④ | 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。

|   |          |             |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額   | 9,457,670千円 |
| ② | 配当の原資    | 利益剰余金       |
| ③ | 1株当たり配当額 | 44,700円     |
| ④ | 基準日      | 令和2年3月31日   |
| ⑤ | 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<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>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<br>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<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>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）



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<br>(千円) | 取得原価<br>(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の  | 株式  | —                | —            | —         |
|                       | 債券  | —                | —            | —         |
|                       | その他 | 14,744,545       | 12,559,380   | 2,185,164 |
|                       | 小計  | 14,744,545       | 12,559,380   | 2,185,164 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの | 株式  | —                | —            | —         |
|                       | 債券  | —                | —            | —         |
|                       | その他 | 8,012,389        | 8,573,551    | △561,161  |
|                       | 小計  | 8,012,389        | 8,573,551    | △561,161  |
| 合計                    |     | 22,756,935       | 21,132,932   | 1,624,002 |

第35期(令和2年3月31日現在)

|                       | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(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<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>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<br>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<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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

##### ①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|     | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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                   |

##### ②長期期待運用収益率の設定方法

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

#### (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

##### 主要な数理計算上の計算基礎

|           | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(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<br>名称                   | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容   | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                                           | 取引の内容                                                      | 取引金額<br>(注4)                         | 科目                | 期末残高<br>(注4)                       |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------------------------------|-------------------|------------------------------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%        | 連結納税                                                                    | 連結納税に<br>伴う支払<br>(注1)                                      | 3,216,517<br>千円                      | その他未払金            | 3,217,341<br>千円                    |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株)             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%        | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>投資の助言<br><br>役員の兼任 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2)<br><br>投資助言料<br>(注3) | 5,298,064<br>千円<br><br>695,834<br>千円 | 未払手数料<br><br>未払費用 | 671,568<br>千円<br><br>365,510<br>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<br>名称                   | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容   | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                                           | 取引の内容                                                      | 取引金額<br>(注4)                         | 科目                | 期末残高<br>(注4)                       |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------------------------------|-------------------|------------------------------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%        | 連結納税                                                                    | 連結納税に<br>伴う支払<br>(注1)                                      | 3,030,180<br>千円                      | その他未払金            | 3,029,426<br>千円                    |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株)             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%        | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>投資の助言<br><br>役員の兼任 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2)<br><br>投資助言料<br>(注3) | 5,234,629<br>千円<br><br>583,270<br>千円 | 未払手数料<br><br>未払費用 | 712,210<br>千円<br><br>302,681<br>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<br>名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(注4) | 科目 | 期末残高<br>(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<br>百万円 | 銀行業 | なし<br>(注1) | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>(注2) | 4,629,670<br>千円  | 未払手数料  | 734,633<br>千円    |
|             |                      |         |                  |     |            | 取引銀行                          | コーラブル預金の預入<br>(注3)        | 20,000,000<br>千円 | 現金及び預金 | 20,000,000<br>千円 |
|             |                      |         |                  |     |            |                               | コーラブル預金に係る受取利息<br>(注3)    | 1,578<br>千円      | 未収収益   | 1,578<br>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<br>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<br>(注2) | 6,152,016<br>千円  | 未払手数料  | 962,840<br>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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                     | 取引の内容                     | 取引金額<br>(注4)     | 科目     | 期末残高<br>(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<br>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<br>(注2) | 4,073,855<br>千円  | 未払手数料  | 697,109<br>千円    |
|             |                      |         |                  |       |                    | 取引銀行                          | コーラブル預金の払戻<br>(注3)        | 20,000,000<br>千円 |        |                  |
|             |                      |         |                  |       |                    |                               | コーラブル預金の預入<br>(注3)        | 20,000,000<br>千円 | 現金及び預金 | 20,000,000<br>千円 |
|             |                      |         |                  |       |                    |                               | コーラブル預金に係る受取利息<br>(注3)    | 4,126<br>千円      | 未収収益   | 997<br>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<br>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<br>(注2) | 5,714,501<br>千円  | 未払手数料  | 944,351<br>千円    |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. (株)三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを

(株)三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、

(株)三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。

なお、(株)三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行(株)に対して承継させております。

2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

- ３．預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
- ４．上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2.親会社に関する注記

株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（非上場）

### （１株当たり情報）

|              | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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、記載しておりません。

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                    | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>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                              |

## 中間財務諸表

### (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

| 第36期中間会計期間<br>(令和2年9月30日現在) |    |            |
|-----------------------------|----|------------|
| (資産の部)                      |    |            |
| 流動資産                        |    |            |
| 現金及び預金                      |    | 51,757,620 |
| 有価証券                        |    | 47,281     |
| 前払費用                        |    | 533,748    |
| 未収入金                        |    | 22,328     |
| 未収委託者報酬                     |    | 11,205,707 |
| 未収収益                        |    | 1,109,882  |
| 金銭の信託                       |    | 200,000    |
| その他                         |    | 216,914    |
| 流動資産合計                      |    | 65,093,483 |
| 固定資産                        |    |            |
| 有形固定資産                      |    |            |
| 建物                          | ※1 | 561,961    |
| 器具備品                        | ※1 | 1,130,570  |
| 土地                          |    | 628,433    |
| 有形固定資産合計                    |    | 2,320,965  |
| 無形固定資産                      |    |            |
| 電話加入権                       |    | 15,822     |
| ソフトウェア                      |    | 3,039,396  |

|            |    |            |
|------------|----|------------|
| ソフトウェア仮勘定  |    | 2,003,918  |
| 無形固定資産合計   |    | 5,059,137  |
| 投資その他の資産   |    |            |
| 投資有価証券     |    | 17,150,138 |
| 関係会社株式     |    | 320,136    |
| 投資不動産      | ※1 | 817,921    |
| 長期差入保証金    |    | 552,888    |
| 前払年金費用     |    | 316,933    |
| 繰延税金資産     |    | 1,088,156  |
| その他        |    | 45,230     |
| 貸倒引当金      |    | △23,600    |
| 投資その他の資産合計 |    | 20,267,805 |
| 固定資産合計     |    | 27,647,907 |
| 資産合計       |    | 92,741,391 |

(単位：千円)

## 第36期中間会計期間

(令和2年9月30日現在)

|           |    |            |
|-----------|----|------------|
| (負債の部)    |    |            |
| 流動負債      |    |            |
| 預り金       |    | 326,091    |
| 未払金       |    |            |
| 未払収益分配金   |    | 158,732    |
| 未払償還金     |    | 133,877    |
| 未払手数料     |    | 4,401,647  |
| その他未払金    |    | 2,173,325  |
| 未払費用      |    | 4,669,476  |
| 未払消費税等    | ※2 | 507,145    |
| 未払法人税等    |    | 523,722    |
| 賞与引当金     |    | 895,400    |
| 役員賞与引当金   |    | 76,200     |
| その他       |    | 699,988    |
| 流動負債合計    |    | 14,565,607 |
| 固定負債      |    |            |
| 長期未払金     |    | 21,600     |
| 退職給付引当金   |    | 1,075,559  |
| 役員退職慰労引当金 |    | 133,578    |
| 時効後支払損引当金 |    | 248,354    |
| 固定負債合計    |    | 1,479,092  |
| 負債合計      |    | 16,044,700 |
| (純資産の部)   |    |            |
| 株主資本      |    |            |
| 資本金       |    | 2,000,131  |
| 資本剰余金     |    |            |
| 資本準備金     |    | 3,572,096  |
| その他資本剰余金  |    | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計   |    | 44,732,712 |
| 利益剰余金     |    |            |
| 利益準備金     |    | 342,589    |
| その他利益剰余金  |    |            |
| 別途積立金     |    | 6,998,000  |
| 繰越利益剰余金   |    | 20,902,380 |
| 利益剰余金合計   |    | 28,242,970 |
| 株主資本合計    |    | 74,975,814 |



(単位：千円)

| 第36期中間会計期間<br>(令和2年9月30日現在) |            |
|-----------------------------|------------|
| 評価・換算差額等                    |            |
| その他有価証券評価差額金                | 1,720,876  |
| 評価・換算差額等合計                  | 1,720,876  |
| 純資産合計                       | 76,696,691 |
| 負債純資産合計                     | 92,741,391 |

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

| 第36期中間会計期間<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和2年9月30日) |            |
|-------------------------------------------|------------|
| 営業収益                                      |            |
| 委託者報酬                                     | 32,500,161 |
| 投資顧問料                                     | 1,178,818  |
| その他営業収益                                   | 6,615      |
| 営業収益合計                                    | 33,685,595 |
| 営業費用                                      |            |
| 支払手数料                                     | 12,792,753 |
| 広告宣伝費                                     | 275,488    |
| 公告費                                       | 250        |
| 調査費                                       |            |
| 調査費                                       | 1,005,823  |
| 委託調査費                                     | 5,663,034  |
| 事務委託費                                     | 344,079    |
| 営業雑経費                                     |            |
| 通信費                                       | 208,539    |
| 印刷費                                       | 182,427    |
| 協会費                                       | 26,229     |
| 諸会費                                       | 8,309      |
| 事務機器関連費                                   | 917,566    |
| その他営業雑経費                                  | 126        |
| 営業費用合計                                    | 21,424,626 |
| 一般管理費                                     |            |
| 給料                                        |            |
| 役員報酬                                      | 171,181    |
| 給料・手当                                     | 2,786,316  |
| 賞与引当金繰入                                   | 895,400    |
| 役員賞与引当金繰入                                 | 76,200     |
| 福利厚生費                                     | 625,724    |
| 交際費                                       | 1,235      |
| 旅費交通費                                     | 10,767     |
| 租税公課                                      | 186,405    |
| 不動産賃借料                                    | 327,689    |
| 退職給付費用                                    | 229,835    |
| 役員退職慰労引当金繰入                               | 11,763     |
| 固定資産減価償却費                                 | ※1 643,956 |
| 諸経費                                       | 188,448    |
| 一般管理費合計                                   | 6,154,923  |
| 営業利益                                      | 6,106,045  |

(単位：千円)

第36期中間会計期間  
（自 令和2年4月1日  
至 令和2年9月30日）

|              |           |
|--------------|-----------|
| 営業外収益        |           |
| 受取配当金        | 17,539    |
| 受取利息         | 2,089     |
| 投資有価証券償還益    | 24,505    |
| 収益分配金等時効完成分  | 275,165   |
| 受取賃貸料        | 32,904    |
| その他          | 9,312     |
| 営業外収益合計      | 361,516   |
| 営業外費用        |           |
| 投資有価証券償還損    | 37,772    |
| 時効後支払損引当金繰入  | 13,892    |
| 賃貸関連費用       | ※1 6,562  |
| その他          | 2,149     |
| 営業外費用合計      | 60,377    |
| 経常利益         | 6,407,184 |
| 特別利益         |           |
| 投資有価証券売却益    | 157,075   |
| 特別利益合計       | 157,075   |
| 特別損失         |           |
| 投資有価証券売却損    | 37,339    |
| 特別損失合計       | 37,339    |
| 税引前中間純利益     | 6,526,919 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 1,948,492 |
| 法人税等調整額      | 65,981    |
| 法人税等合計       | 2,014,473 |
| 中間純利益        | 4,512,445 |

## (3)中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）

(単位：千円)

|                                       | 株主資本      |           |              |             |           |           |             |             | 株主資本合計     |
|---------------------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
|                                       | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益剰余金     |           |             |             |            |
|                                       |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |            |
|                                       |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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 | 25,847,605  | 33,188,194  | 79,921,039 |
| 当中間期変動額                               |           |           |              |             |           |           |             |             |            |
| 剰余金の配当                                |           |           |              |             |           |           | △9,457,670  | △9,457,670  | △9,457,670 |
| 中間純利益                                 |           |           |              |             |           |           | 4,512,445   | 4,512,445   | 4,512,445  |
| 株主資本以外の<br>項目の当中<br>間 期 変 動 額<br>(純額) |           |           |              |             |           |           |             |             |            |
| 当中間期変動額合計                             | —         | —         | —            | —           | —         | —         | △4,945,224  | △4,945,224  | △4,945,224 |
| 当中間期末残高                               | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 20,902,380  | 28,242,970  | 74,975,814 |

|         | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計      |
|---------|----------------------|----------------|------------|
|         | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高   | 1,815                | 1,815          | 79,922,854 |
| 当中間期変動額 |                      |                |            |

|                               |           |           |            |
|-------------------------------|-----------|-----------|------------|
| 剰余金の配当                        |           |           | △9,457,670 |
| 中間純利益                         |           |           | 4,512,445  |
| 株主資本以外の<br>項目の当中間期<br>変動額（純額） | 1,719,061 | 1,719,061 | 1,719,061  |
| 当中間期変動額合計                     | 1,719,061 | 1,719,061 | △3,226,163 |
| 当中間期末残高                       | 1,720,876 | 1,720,876 | 76,696,691 |

## [重要な会計方針]

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

#### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (4) 退職給付引当金

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

##### ① 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

##### ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

#### (5) 役員退職慰労引当金

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

す。

## (6) 時効後支払損引当金

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

## 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

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

## (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

- (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。

## [注記事項]

（中間貸借対照表関係）

## ※1 減価償却累計額

|       | 第36期中間会計期間<br>（令和2年9月30日現在） |
|-------|-----------------------------|
| 建物    | 621,629千円                   |
| 器具備品  | 1,475,730千円                 |
| 投資不動産 | 148,595千円                   |

## ※2 消費税等の取扱い

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

（中間損益計算書関係）

## ※1 減価償却実施額

|        | 第36期中間会計期間<br>（自 令和2年4月1日<br>至 令和2年9月30日） |
|--------|-------------------------------------------|
| 有形固定資産 | 83,458千円                                  |
| 無形固定資産 | 560,498千円                                 |
| 投資不動産  | 3,204千円                                   |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

令和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。

|   |          |             |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額   | 9,457,670千円 |
| ② | 配当の原資    | 利益剰余金       |
| ③ | 1株当たり配当額 | 44,700円     |
| ④ | 基準日      | 令和2年3月31日   |
| ⑤ | 効力発生日    | 令和2年6月29日   |

## （リース取引関係）

第36期中間会計期間(令和2年9月30日現在)

## 〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

|     |           |
|-----|-----------|
| 1年内 | 337,978千円 |
| 1年超 | —         |
| 合 計 | 337,978千円 |

## （金融商品関係）

第36期中間会計期間(令和2年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

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

|             | 中間貸借対照表計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|-------------|----------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 51,757,620     | 51,757,620 | —      |
| (2) 有価証券    | 47,281         | 47,281     | —      |
| (3) 未収委託者報酬 | 11,205,707     | 11,205,707 | —      |
| (4) 投資有価証券  | 17,118,778     | 17,118,778 | —      |
| 資産計         | 80,129,387     | 80,129,387 | —      |
| (1) 未払手数料   | 4,401,647      | 4,401,647  | —      |
| 負債計         | 4,401,647      | 4,401,647  | —      |

## （注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

## (2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

## (1)未払手数料

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

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

## （注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、

異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

（有価証券関係）

第36期中間会計期間（令和2年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

|                                | 種類  | 中間貸借対照表<br>計上額（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額（千円）    |
|--------------------------------|-----|--------------------|--------------|-----------|
| 中間貸借対照表計<br>上額が取得原価を<br>超えるもの  | 株式  | —                  | —            | —         |
|                                | 債券  | —                  | —            | —         |
|                                | その他 | 14,690,037         | 11,992,800   | 2,697,236 |
|                                | 小 計 | 14,690,037         | 11,992,800   | 2,697,236 |
| 中間貸借対照表計<br>上額が取得原価を<br>超えないもの | 株式  | —                  | —            | —         |
|                                | 債券  | —                  | —            | —         |
|                                | その他 | 2,476,022          | 2,692,895    | △216,872  |
|                                | 小 計 | 2,476,022          | 2,692,895    | △216,872  |
| 合 計                            |     | 17,166,060         | 14,685,695   | 2,480,364 |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                                      | 第36期中間会計期間<br>（令和2年9月30日現在） |
|--------------------------------------|-----------------------------|
| 1株当たり純資産額                            | 362,493.28円                 |
| （算定上の基礎）                             |                             |
| 純資産の部の合計額（千円）                        | 76,696,691                  |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）                 | 76,696,691                  |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた<br>中間期末の普通株式の数（株） | 211,581                     |

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                    | 第36期中間会計期間<br>(自 令和2年4月1日<br>至 令和2年9月30日) |
|--------------------|-------------------------------------------|
| 1株当たり中間純利益金額       | 21,327.27円                                |
| (算定上の基礎)           |                                           |
| 中間純利益金額（千円）        | 4,512,445                                 |
| 普通株主に帰属しない金額（千円）   | —                                         |
| 普通株式に係る中間純利益金額（千円） | 4,512,445                                 |
| 普通株式の期中平均株式数（株）    | 211,581                                   |

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- ①定款の変更等  
定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- ②訴訟事件その他重要事項  
該当事項はありません。

#### 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

- ①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)
- ②資本金の額：324,279百万円（2020年9月末現在）
- ③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

| ①名称                   | ②資本金の額<br>(2020年9月末現在) | ③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。                  |
| 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。           |
| 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。 |
| 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。 |
| 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。 |
| 松井証券株式会社              | 11,945 百万円             | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 | 40,500 百万円             | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

## 2【関係業務の概要】

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

## 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2021年3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【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
  - ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
  - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
  - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
  - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
  - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
  - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
  - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。
- (3) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されること



があります。

- （５）投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- （６）目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- （７）目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

# 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3年4月28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 鶴田 光夫 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」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の令和2年3月26日から令和3年3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、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）の令和3年3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。

# 独立監査人の監査報告書

令和3年4月28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 鶴田 光夫 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」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の令和2年3月26日から令和3年3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、三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）の令和3年3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。

# 独立監査人の監査報告書

令和3年4月28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 鶴田 光夫 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」に掲げられている三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の令和2年3月26日から令和3年3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、三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）の令和3年3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。

# 独立監査人の中間監査報告書

令和2年11月30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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（令和2年4月1日から令和2年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の令和2年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（令和2年4月1日から令和2年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。