

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年6月24日提出
【計算期間】	第7期(自 2020年3月26日至 2021年3月25日)
【ファンド名】	三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）
【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
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の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、5,000億円です。

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

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

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

ます。

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

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

#### 商品分類の定義

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

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

#### 属性区分の定義

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

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

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

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

#### [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、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

### 投資対象

ファンドは、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。

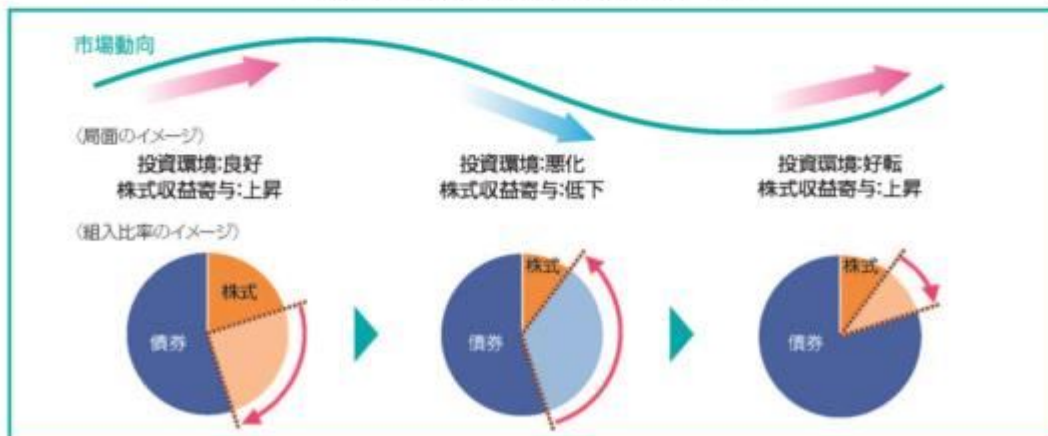
- 国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドです。
- 国内株式、先進国株式の組入比率を抑えて、比較的安定的な基準価額の上昇をめざすファンドです。

### <ファンドが投資対象とするマザーファンドと運用目標>

各マザーファンド	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式 (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 (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 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。

## ■運用方法・運用プロセス

### <(ご参考)組入比率変更のイメージ>



- 1 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、組入比率の変更をイメージとして示したものです。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>

国内株式	0.0%～22.0%
先進国株式	0.0%～22.0%
国内債券	0.0%～51.0%
先進国債券	0.0%～25.0% (原則、25.0%固定とします。)

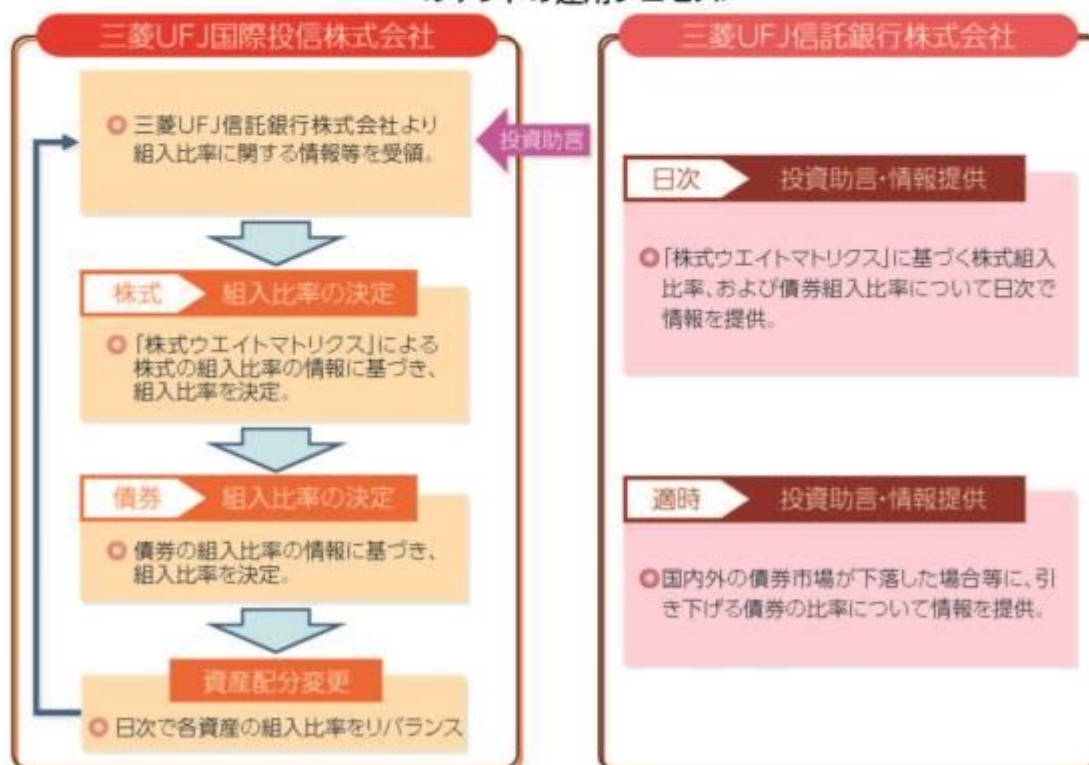
- 1 上記以外に短期金融資産を組み入れます。
- 1 上記組入比率は、今後、変更となる場合があります。

- 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「株式ウエイトマトリクス」を活用します。
- ◆ 「投資環境」は、株式市場や景気の方向性、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。
- ◆ 「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。
- ❗ 「株式ウエイトマトリクス」は、各資産（国内株式、先進国株式）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。

### <株式ウエイトマトリクスのイメージ>



❗ 上記の株式ウエ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。
- 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.mufig.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。



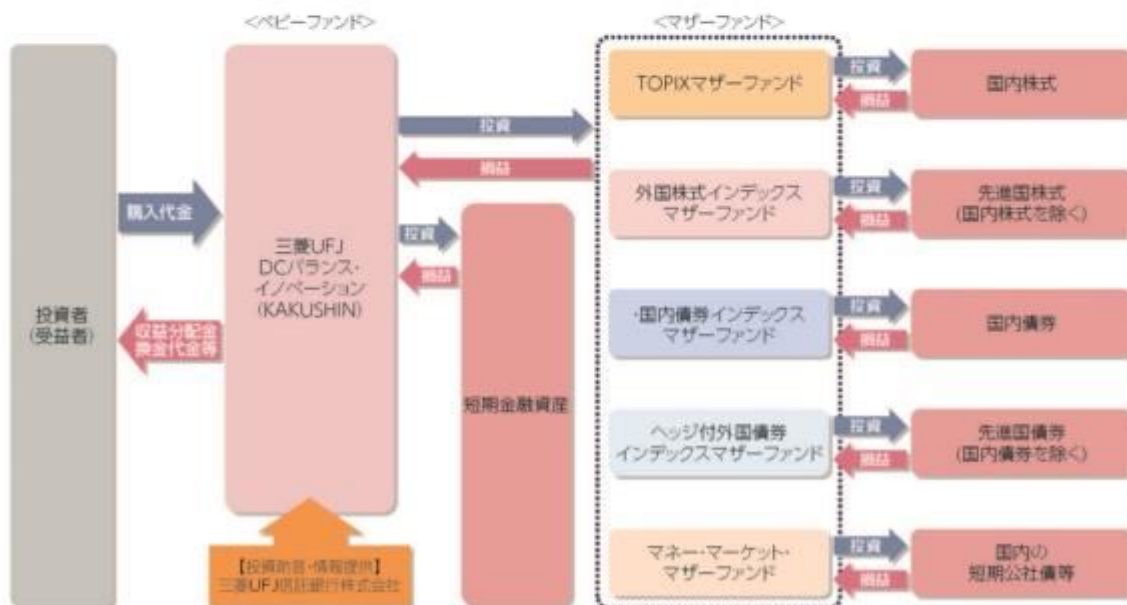
為替対応  
方針

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、ファンドは為替相場の変動による影響を受けます。
- 1 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。



## 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。
- ・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。

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】

2014年5月30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】

## 委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）		お申込金 収益分配金、解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。		
お申込金 収益分配金、解約代金等			
受託会社（受託者） 三菱UFJ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱UFJ国際投信株式会社		
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。		
投資 損益			
マザーファンド			
投資 損益			
有価証券等			

## 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況（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】

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。

### （2）【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

a．有価証券先物取引等

b．スワップ取引

c．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

#### 有価証券の指図範囲

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

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

- ます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
  11. コマーシャル・ペーパー
  12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
  14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
  16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から23. に該当するものを除きます。）
  25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
  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
- 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

## &lt;マザーファンドの概要&gt;

## TOPIXマザーファンド

## （基本方針）

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

## （運用方法）

## 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

## 投資態度

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

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

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

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

## （投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

## （基本方針）

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

## （運用方法）

## 投資対象

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

## 投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。



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

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

### 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 - B P I 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）

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

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）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引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）

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。

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）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

### 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）

投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

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）

株式への投資は行いません。

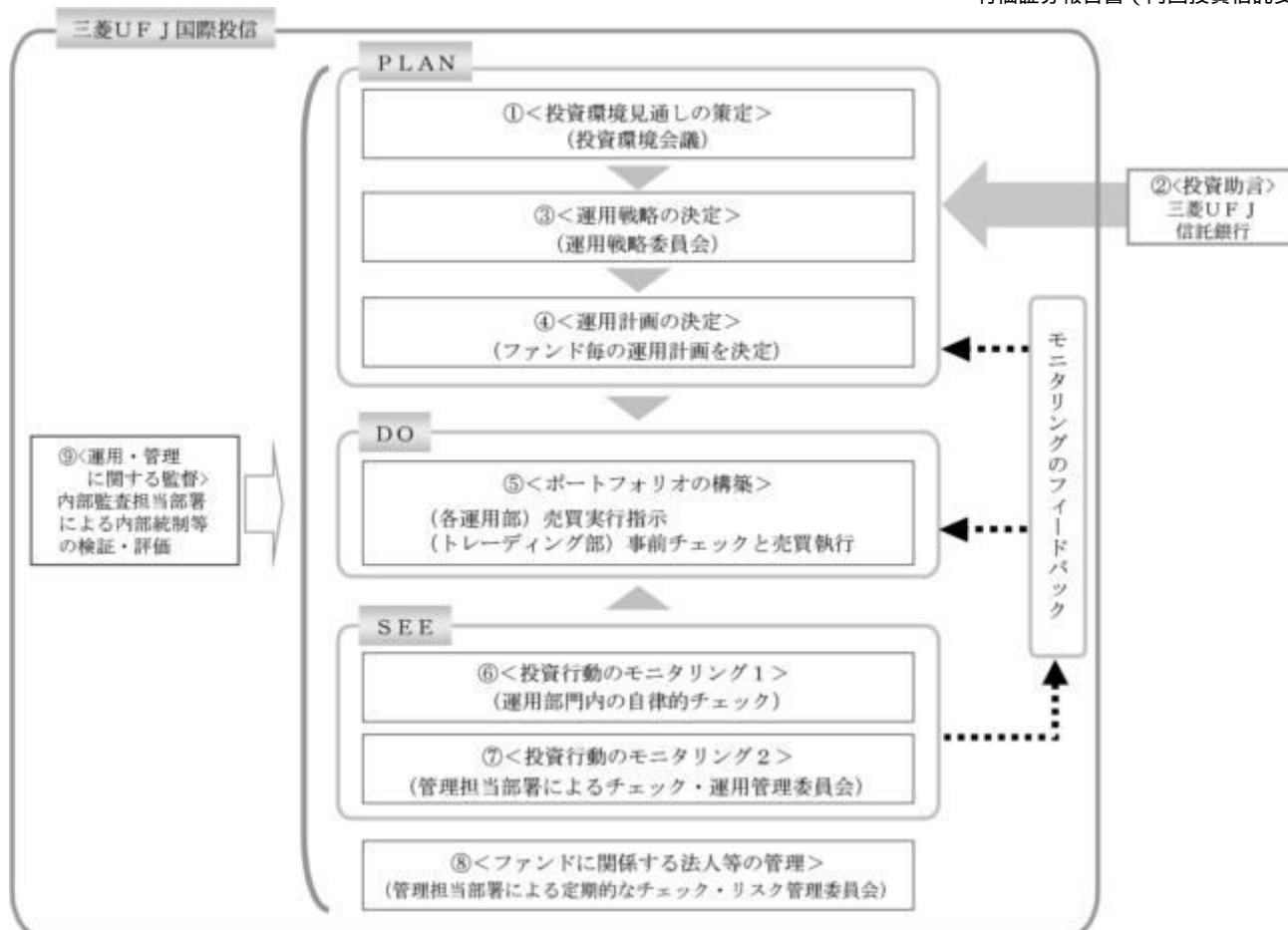
外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引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】



### 投資環境見通しの策定

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

### 投資助言

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

### 運用戦略の決定

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

### 運用計画の決定

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

### ポートフォリオの構築

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

### 投資行動のモニタリング1

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

### 投資行動のモニタリング2

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

### ファンドに関する法人等の管理

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

### 運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

#### (4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

#### (5)【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

投資信託証券

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

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

同一銘柄の転換社債等

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

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

スワップ取引

a. 委託会社は、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、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、
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

#### 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、
  - 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（ 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の新株予約権（ 5. に定めるものを除き、）の行使により取得可能な株券

#### 外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、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、

#### 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るときは、担保の提供の指図を行うものとし、
- 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、

#### 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、
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約

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

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

#### 投資する株式等の範囲

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

#### 金利先渡取引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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 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るときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の空売り

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### デリバティブ取引等

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



### 信用リスクの分散規制

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

#### <その他法令等に定められた投資制限>

##### ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

## 3【投資リスク】

### (1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。)

#### 価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、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。

#### 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。

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や公社債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。

### 留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・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。

### トレーディング担当部署

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

### コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

### リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

### 内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

## <流動性リスクに対する管理体制>

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

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

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

## （２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

## （３）【信託報酬等】

- 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.66%（税抜0.6%）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	0.4%	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	0.17%	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	0.03%	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の解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- 信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

### １．収益分配金の課税

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

ん。

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

## 2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

### 法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

### 個別元本について

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

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

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

### 収益分配金について

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

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

ます。

上記は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 DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

#### （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	12,190,007,511	97.00
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		377,498,595	3.00
純資産総額		12,567,506,106	100.00

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### a 評価額上位30銘柄

令和 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)	投資 比率 (%)
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	4,624,869,590	0.9775	4,520,810,025	0.9760	4,513,872,719	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	2,282,622,922	1.3687	3,124,225,993	1.3606	3,105,736,747	24.71
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	605,952,653	3.7163	2,251,912,739	3.8323	2,322,192,352	18.48
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	1,010,974,770	2.2083	2,232,603,800	2.2238	2,248,205,693	17.89

（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	97.00
合計	97.00



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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和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 (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27年 3月25日)	35,553,059	35,553,059	10,752	10,752
第2計算期間末日 (平成28年 3月25日)	807,612,280	807,612,280	10,742	10,742
第3計算期間末日 (平成29年 3月27日)	1,403,572,405	1,403,572,405	10,697	10,697
第4計算期間末日 (平成30年 3月26日)	2,639,151,920	2,639,151,920	11,120	11,120
第5計算期間末日 (平成31年 3月25日)	6,301,738,329	6,301,738,329	11,294	11,294
第6計算期間末日 (令和 2年 3月25日)	8,770,011,322	8,770,011,322	11,178	11,178
第7計算期間末日 (令和 3年 3月25日)	12,406,605,658	12,406,605,658	11,599	11,599
令和 2年 3月末日	8,864,583,466		11,204	
4月末日	9,342,488,264		11,214	
5月末日	9,571,717,778		11,181	
6月末日	9,934,762,198		11,150	
7月末日	10,259,253,900		11,195	
8月末日	10,502,674,885		11,265	
9月末日	10,755,800,935		11,249	
10月末日	10,961,328,425		11,163	
11月末日	11,242,128,262		11,326	
12月末日	11,577,377,850		11,396	
令和 3年 1月末日	11,899,053,714		11,396	
2月末日	11,930,614,255		11,396	
3月末日	12,567,506,106		11,655	

### 【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

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	7.52
第2計算期間	0.09
第3計算期間	0.41
第4計算期間	3.95
第5計算期間	1.56
第6計算期間	1.02
第7計算期間	3.76

（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	34,064,041	997,459	33,066,582
第2計算期間	897,344,061	178,600,159	751,810,484
第3計算期間	815,850,058	255,563,488	1,312,097,054
第4計算期間	1,435,863,542	374,521,457	2,373,439,139
第5計算期間	3,809,862,810	603,687,552	5,579,614,397
第6計算期間	3,243,919,150	977,723,872	7,845,809,675
第7計算期間	4,245,785,038	1,395,735,918	10,695,858,795

（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 (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/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,896,400	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	S M C	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 （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 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	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	SP1 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。

#### 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 （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

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 2 1 年 0 6 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 （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/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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。

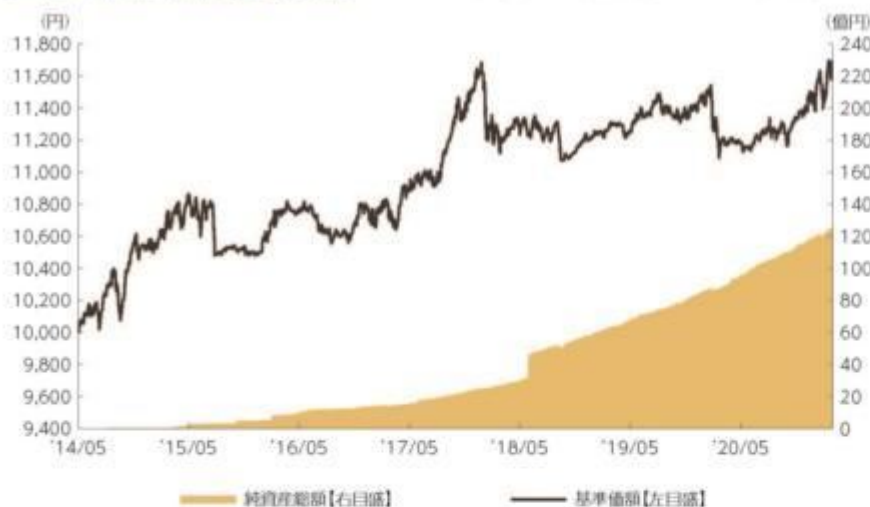
#### 参考情報



## 運用実績

2021年3月31日現在

## ■基準価額・純資産の推移 2014年5月30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	11,655円
純資産総額	125.6億円

・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1万円当たり、税引前

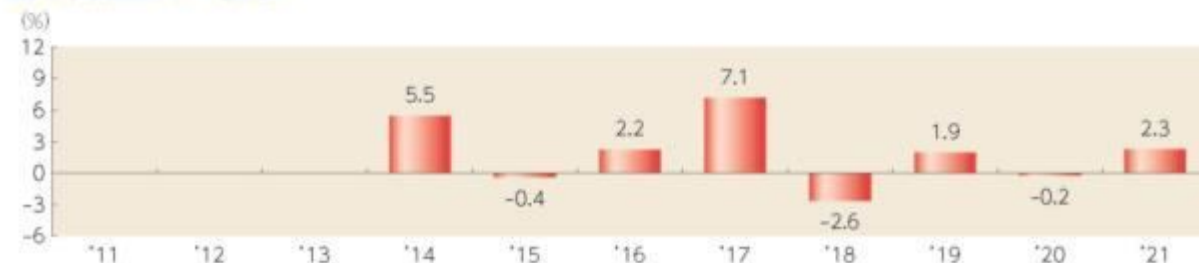
## ■主要な資産の状況

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	17.5%	1 円	81.7%	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	13.1%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	0.6%
外国株式	18.0%	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	25.0%	4 イギリスポンド	0.9%	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	0.5%
		5 カナダドル	0.6%	ソニー	株式	電気機器	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%
コールローン他 (負債控除後)	4.0%	9 香港ドル	0.2%	第140回利付国債(5年)	債券	国債	0.4%
合計	100.0%	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%

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
- ・2014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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### 申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

#### 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

#### 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

#### 申込手数料

ありません。

#### 申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

#### 申込受付時間

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

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

#### 取得申込みの受付の中止および取消し

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。  
ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

### 解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

### 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

### 信託財産留保額

ありません。

### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

### 支払開始日

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

### 解約請求受付時間

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

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

### 解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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、

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

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

・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

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】

無期限（2014年5月30日設定）  
ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年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】

ファンドの償還条件等

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

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

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

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

信託約款の変更等

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

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

ファンドの償還等に関する開示方法

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

いて賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 運用報告書

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

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

#### 信託事務の再信託

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

#### 公告

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

### (1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

収益分配金は、「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。(税金が差引かれる場合があります。)

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

(3) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金(解約)請求する権利を有します。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 [ 令和 2年 3月25日現在 ]	第7期 [ 令和 3年 3月25日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,253,382,444	305,970,637
親投資信託受益証券	6,579,779,813	12,065,114,759
未収入金	-	111,000,000
流動資産合計	8,833,162,257	12,482,085,396
資産合計	8,833,162,257	12,482,085,396
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	36,094,380	37,473,706
未払受託者報酬	1,344,710	1,888,973
未払委託者報酬	25,549,396	35,890,392
未払利息	1,145	53
その他未払費用	161,304	226,614
流動負債合計	63,150,935	75,479,738
負債合計	63,150,935	75,479,738
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,845,809,675	10,695,858,795
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	924,201,647	1,710,746,863
（分配準備積立金）	120,622,881	379,077,753
元本等合計	8,770,011,322	12,406,605,658
純資産合計	8,770,011,322	12,406,605,658
負債純資産合計	8,833,162,257	12,482,085,396

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期			
	自 至	平成31年 令和2年	3月26日 3月25日	自 至	令和2年 令和3年	3月26日 3月25日
営業収益						
受取利息			3,934			10,723
有価証券売買等損益			54,392,149			494,418,261
営業収益合計			54,388,215			494,428,984
営業費用						
支払利息			456,821			343,913
受託者報酬			2,471,667			3,516,783
委託者報酬			46,961,552			66,818,768
その他費用			298,750			421,894
営業費用合計			50,188,790			71,101,358
営業利益又は営業損失( )			104,577,005			423,327,626
経常利益又は経常損失( )			104,577,005			423,327,626
当期純利益又は当期純損失( )			104,577,005			423,327,626
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( )			4,363,020			19,044,128
期首剰余金又は期首欠損金( )			722,123,932			924,201,647
剰余金増加額又は欠損金減少額			438,777,752			548,404,876
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額			438,777,752			548,404,876
剰余金減少額又は欠損金増加額			127,760,012			166,143,158
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額			127,760,012			166,143,158
分配金			-			-
期末剰余金又は期末欠損金( )			924,201,647			1,710,746,863

## (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6期 [令和 2年 3月25日現在]	第7期 [令和 3年 3月25日現在]
1. 期首元本額	5,579,614,397円	7,845,809,675円
期中追加設定元本額	3,243,919,150円	4,245,785,038円
期中一部解約元本額	977,723,872円	1,395,735,918円
2. 受益権の総数	7,845,809,675口	10,695,858,795口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 平成31年 3月26日 至 令和 2年 3月25日			第7期 自 令和 2年 3月26日 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		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	40,894,657円	費用控除後の配当等収益額	A	106,003,628円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	168,993,272円
収益調整金額	C	803,578,766円	収益調整金額	C	1,331,669,110円
分配準備積立金額	D	79,728,224円	分配準備積立金額	D	104,080,853円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	924,201,647円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,710,746,863円
当ファンドの期末残存口数	F	7,845,809,675口	当ファンドの期末残存口数	F	10,695,858,795口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,177円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,599円
1万口当たり分配金額	H	円	1万口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	円

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	第6期 自 平成31年 3月26日 至 令和 2年 3月25日	第7期 自 令和 2年 3月26日 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6期 [ 令和 2年 3月25日現在 ]	第7期 [ 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            売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>同左</p>



区分	第6期	第7期
	[ 令和 2年 3月25日現在 ]	[ 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6期	第7期
	[ 令和 2年 3月25日現在 ]	[ 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 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	99,726,413	278,994,843
合計	99,726,413	278,994,843

## ( 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6期	第7期
	[ 令和 2年 3月25日現在 ]	[ 令和 3年 3月25日現在 ]
1口当たり純資産額	1.1178円	1.1599円
(1万口当たり純資産額)	(11,178円)	(11,599円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	2,282,622,922	3,124,225,993	
	国内債券インデックスマザーファンド	4,657,584,843	4,553,254,942	
	TOPIXマザーファンド	995,976,201	2,197,721,085	
	外国株式インデックスマザーファンド	589,669,002	2,189,912,739	
合計		8,525,852,968	12,065,114,759	

## 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
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

[ 令和 3年 3月25日現在 ]

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
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

[令和 3年 3月25日現在]

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
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

	[令和 3年 3月25日現在]
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
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

	[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 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	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 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、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

区分	自 令和 2年 3月26日 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          売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引          デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品          上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	[ 令和 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 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 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 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 200株(200株)
1429	日本アクア	10,100	622.00	6,282,200	貸付有価証券 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 1,300株(300株)
1435	TATERU	47,500	189.00	8,977,500	貸付有価証券 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 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	ピ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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 9,500株
1878	大東建託	63,900	12,200.00	779,580,000	貸付有価証券 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 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 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 500株(500株)
1911	住友林業	137,600	2,444.00	336,294,400	貸付有価証券 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 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 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 3,800株(3,800株)
1959	九電工	41,000	4,140.00	169,740,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 F o o d s	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 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 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 ホールデ	143,400	2,008.00	287,947,200	貸付有価証券 9,900株(9,900株)
2587	サントリー食品インターナショナル	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 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 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 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 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 5,000株(5,000株)
2875	東洋水産	96,300	4,860.00	468,018,000	
2882	イ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 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 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 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 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	ピッ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 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 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 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 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 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 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 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 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 1,600株(1,600株)
3607	クラウディ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 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 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 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 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 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	13,800	3,140.00	43,332,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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	日本パーカライズニング	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 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 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 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 8,100株(8,100株)
4202	ダイセル	245,600	876.00	215,145,600	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 1,200株(1,200株)
4401	ADEKA	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 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 1,100株

4465	ニイタカ	3,800	2,873.00	10,917,400	貸付有価証券 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 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 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 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 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S C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 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 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 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	エステー	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 2,300株(2,300株)
4958	長谷川香料	32,200	2,105.00	67,781,000	
4963	星光P M C	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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 4,300株(4,300株)
4541	日医工	52,800	1,030.00	54,384,000	貸付有価証券 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 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	JCR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 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 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 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 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 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 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 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 8,700株(2,100株)
5201	AGC	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 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 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 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 3,300株
5344	MARUWA	6,400	11,020.00	70,528,000	貸付有価証券 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 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 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 900株(900株)
5384	フジ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 100株(100株)
5393	ニチアス	47,100	2,807.00	132,209,700	貸付有価証券 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 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 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 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 1,000株
5541	大平洋金属	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 900株(400株)
5632	三菱製鋼	13,600	852.00	11,587,200	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
5658	日亜鋼業	27,000	313.00	8,451,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 8,300株(8,300株)
5741	UACJ	28,000	2,624.00	73,472,000	
5757	CKサンエツ	3,900	4,025.00	15,697,500	貸付有価証券 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 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 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 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 1,600株
5851	リョービ	22,700	1,669.00	37,886,300	貸付有価証券 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 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 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 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	ホッカホホールディングス	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 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 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	LIXIL	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 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 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 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	東京製綱	13,200	1,277.00	16,856,400	貸付有価証券 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 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 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 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 4,700株(4,700株)
6101	ツガミ	38,200	1,666.00	63,641,200	貸付有価証券 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 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 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 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 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 3,600株(3,600株)
6141	D M G 森精機	116,700	1,850.00	215,895,000	貸付有価証券 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 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 600株(600株)
6203	豊和工業	10,200	886.00	9,037,200	貸付有価証券 1,300株
6205	O K K	7,100	445.00	3,159,500	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 3,400株(3,400株)
6273	S M C	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 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 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 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	T O W A	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 1,100株（200株）
6325	タカキタ	6,500	685.00	4,452,500	貸付有価証券 100株（100株）
6326	クボタ	980,000	2,436.50	2,387,770,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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	SANKYO	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 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 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 2,300株(2,300株)
6436	アマノ	48,800	2,706.00	132,052,800	
6440	JUKI	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 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 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 2,800株(2,800株)
6465	ホシザキ	58,700	9,580.00	562,346,000	貸付有価証券 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	NTN	431,700	332.00	143,324,400	貸付有価証券 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 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 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 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	コニカミノルタ	378,500	612.00	231,642,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 - P E X	8,700	2,115.00	18,400,500	貸付有価証券 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 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 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 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 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 26,500株(26,500株)
6727	ワコム	135,000	738.00	99,630,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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	S M K	4,800	2,905.00	13,944,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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	O B A R A G R O U P	10,900	3,850.00	41,965,000	貸付有価証券 700株(700株)
6901	澤藤電機	2,000	2,287.00	4,574,000	貸付有価証券 200株(200株)
6904	原田工業	7,600	930.00	7,068,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 4,200株(1,000株)
6938	双信電機	9,000	453.00	4,077,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 100株(100株)
6996	ニチコン	58,700	1,120.00	65,744,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 7,600株(7,600株)
7240	NOK	90,200	1,547.00	139,539,400	
7241	フタバ産業	46,700	608.00	28,393,600	
7242	KYB	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 7,000株(7,000株)
7256	河西工業	25,200	456.00	11,491,200	貸付有価証券 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 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 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 600株(600株)
7294	ヨロズ	16,000	1,356.00	21,696,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 5,600株(5,600株)
7731	ニコン	284,900	1,087.00	309,686,300	貸付有価証券 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 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 1,200株(1,200株)
7740	タムロン	15,000	2,156.00	32,340,000	
7741	H O Y A	370,100	12,735.00	4,713,223,500	
7743	シード	7,900	714.00	5,640,600	
7744	ノーリツ鋼機	16,800	2,698.00	45,326,400	
7745	エー・アンド・デイ	15,700	1,198.00	18,808,600	貸付有価証券 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 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 16,300株(16,300株)
7769	リズム	5,800	880.00	5,104,000	貸付有価証券 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 6,600株(6,600株)
8086	ニプロ	139,000	1,355.00	188,345,000	貸付有価証券 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 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 1,200株(1,200株)
7821	前田工織	20,600	3,285.00	67,671,000	貸付有価証券 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	S H O E I	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	トップバン・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	廣濟堂	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 1,200株(1,200株)
7897	ホクシン	11,500	120.00	1,380,000	貸付有価証券 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 9,600株(9,600株)
7916	光村印刷	1,600	1,802.00	2,883,200	
7921	T A K A R A & C O M P A N Y	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 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 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 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 2,300株(2,300株)
7981	タカラスタンダード	38,500	1,710.00	65,835,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 158,000株(81,400株)
9232	パスコ	3,400	1,515.00	5,151,000	貸付有価証券 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 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 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 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	エーアイティー	11,100	1,001.00	11,111,100	貸付有価証券 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 1,500株(400株)
2317	システナ	65,300	2,191.00	143,072,300	貸付有価証券 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 3,000株(700株)
2352	エイジア	2,800	1,742.00	4,877,600	貸付有価証券 500株(300株)
2359	コア	7,700	1,529.00	11,773,300	貸付有価証券 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 2,100株
3040	ソリトンシステムズ	9,100	1,626.00	14,796,600	
3371	ソフトクリエイイトホールディングス	7,200	2,765.00	19,908,000	貸付有価証券 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 9,500株(9,500株)
3633	G M Oペパボ	1,200	7,740.00	9,288,000	
3635	コーエーテッ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 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	ポルトゥウィン・ピットクレーホールディ	24,300	1,404.00	34,117,200	
3658	イーブ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 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 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	コロブラ	60,100	853.00	51,265,300	貸付有価証券 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 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 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 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 2,300株
3677	システム情報	13,700	1,031.00	14,124,700	貸付有価証券 2,900株
3678	メディアドゥ	7,100	6,140.00	43,594,000	貸付有価証券 1,800株(400株)
3679	じげん	45,300	429.00	19,433,700	

3681	バイキューブ	10,000	2,452.00	24,520,000	貸付有価証券 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 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 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 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 1,200株
3688	CARTA HOLDINGS	7,400	1,546.00	11,440,400	
3694	オブティム	12,800	2,837.00	36,313,600	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
3696	セレス	6,000	4,385.00	26,310,000	貸付有価証券 500株(500株)
3697	SHIFT	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 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 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 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 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 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 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 800株
3817	SRA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 2,800株(1,500株)
3834	朝日ネット	14,800	818.00	12,106,400	
3835	eBASE	21,900	950.00	20,805,000	貸付有価証券 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 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 2,600株

3844	コムチュア	16,800	2,715.00	45,612,000	貸付有価証券 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 200株(200株)
3853	アステリア	13,200	799.00	10,546,800	貸付有価証券 800株(800株)
3854	アイル	10,200	1,668.00	17,013,600	貸付有価証券 2,200株
3901	マークライNZ	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 5,500株(1,000株)
3903	g u m i	25,300	908.00	22,972,400	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 200株(200株)
3926	オープンドア	10,900	1,806.00	19,685,400	貸付有価証券 2,200株
3928	マイネット	6,000	811.00	4,866,000	貸付有価証券 1,400株
3932	アカツキ	7,300	4,380.00	31,974,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 1,100株(300株)
3983	オロ	5,800	3,660.00	21,228,000	貸付有価証券 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 200株(200株)
4284	ソルクシーズ	7,000	936.00	6,552,000	貸付有価証券 1,500株(600株)
4295	フェイス	5,600	806.00	4,513,600	貸付有価証券 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 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 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 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 600株
4384	ラクスル	14,800	4,745.00	70,226,000	
4390	IPS	3,200	2,782.00	8,902,400	
4392	FIG	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 800株
4420	イーソル	9,900	1,268.00	12,553,200	貸付有価証券 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	EduLab	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 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	トピラシステムズ	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	ギフトィ	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 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 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 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 500株(500株)
4728	トーセ	4,900	823.00	4,032,700	貸付有価証券 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 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 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 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 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 2,500株(2,500株)
4820	E M 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 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 500株(500株)
6879	IMAGICA GROUP	15,500	529.00	8,199,500	貸付有価証券 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	エイベックス	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 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 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 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 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 1,700株(400株)
9418	USEN-NEXT HOLDINGS	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 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 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 300株(300株)

9466	アйдママーケティングコミュニケーション	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 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 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 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 700株(700株)
9601	松竹	12,100	13,170.00	159,357,000	貸付有価証券 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 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 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 400株(400株)
9682	D T S	38,000	2,590.00	98,420,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	78,100	6,350.00	495,935,000	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
9692	シーイーシー	19,600	1,559.00	30,556,400	
9697	カブコン	78,400	7,200.00	564,480,000	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
9702	アイ・エス・ピー	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 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 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	オルバ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	JALUX	5,200	1,690.00	8,788,000	貸付有価証券 300株(300株)
2733	あらた	14,600	4,925.00	71,905,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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	ジュー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	OCHIホールディングス	5,300	1,419.00	7,520,700	
3167	TOKAI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 1,000株
3173	Cominix	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 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 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 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 800株(200株)
5009	富士興産	5,600	1,213.00	6,792,800	貸付有価証券 1,800株(400株)
6973	協栄産業	2,000	1,412.00	2,824,000	貸付有価証券 400株(400株)
7414	小野建	16,500	1,440.00	23,760,000	貸付有価証券 3,900株
7417	南陽	3,700	1,704.00	6,304,800	
7420	佐鳥電機	11,400	799.00	9,108,600	
7427	エコトレーディング	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 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 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 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 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 2,600株
7594	マルカ	5,900	2,007.00	11,841,300	貸付有価証券 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 1,300株(300株)
7609	ダイترون	7,800	1,817.00	14,172,600	貸付有価証券 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 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 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 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 2,000株(2,000株)
8070	東京産業	16,600	678.00	11,254,800	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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	オートボックスセブン	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 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 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 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 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 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 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 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 5,400株(2,700株)
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,600	412.00	1,071,200	
2695	くら寿司	10,800	7,310.00	78,948,000	
2698	キャンドウ	8,700	1,954.00	16,999,800	貸付有価証券 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 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 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	アルベン	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	ジンスホールディングス	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 8,200株(8,200株)
3050	D C Mホールディングス	113,400	1,159.00	131,430,600	貸付有価証券 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 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 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 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	ZOZO	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 24,100株(24,100株)
3134	Hamee	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 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 2,000株(2,000株)
3159	丸善CHI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 400株(400株)
3179	シュッピン	12,500	1,030.00	12,875,000	貸付有価証券 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	SFP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 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 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	B E E N O S	8,500	2,823.00	23,995,500	貸付有価証券 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 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 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 3,400株(3,400株)
3415	T O K Y O B A S E	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	J M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 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 700株
3548	パ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 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 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 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 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 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 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 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 1,200株
7601	ポプラ	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 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 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 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 1,800株(1,800株)
7630	壱番屋	12,900	4,975.00	64,177,500	貸付有価証券 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 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 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 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 4,700株(4,700株)
8160	木曽路	24,000	2,499.00	59,976,000	貸付有価証券 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 2,100株(2,100株)
8168	ケーヨー	34,000	730.00	24,820,000	貸付有価証券 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 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 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 1,700株(1,700株)
8203	M r M a x H D	25,200	709.00	17,866,800	
8207	テンアライド	16,900	356.00	6,016,400	
8214	A O K Iホールディングス	36,800	635.00	23,368,000	貸付有価証券 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 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 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 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 700株(700株)
8267	イオン	707,000	3,256.00	2,301,992,000	貸付有価証券 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 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 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	O l y m p i cグループ	9,500	846.00	8,037,000	貸付有価証券 4,500株(2,300株)
8291	日産東京販売ホールディングス	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 DrugStores	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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 500株(500株)
9979	大庄	9,800	1,003.00	9,829,400	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 1,100株（1,100株）
8524	北洋銀行	277,400	326.00	90,432,400	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 1,000株(1,000株)
8622	水戸証券	49,100	342.00	16,792,200	貸付有価証券 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 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 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 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	S O M P O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	M S & A D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 1,000株

7164	全国保証	47,900	5,010.00	239,979,000	貸付有価証券 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 2,100株（600株）
7196	C a s a	5,100	990.00	5,049,000	貸付有価証券 500株（500株）
7198	アルヒ	27,200	1,746.00	47,491,200	
7199	プレミアグループ	8,500	2,419.00	20,561,500	貸付有価証券 800株
8253	クレディセゾン	107,400	1,397.00	150,037,800	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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	S R Eホールディングス	2,000	4,235.00	8,470,000	
2982	A D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 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 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 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	ビーロッド	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 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 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 600株(600株)
3480	ジェイ・エス・ピー	3,400	3,295.00	11,203,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 600株
8918	ランド	1,001,500	10.00	10,015,000	貸付有価証券 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 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 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 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 100株(100株)



2146	UTグループ	25,700	3,370.00	86,609,000	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 700株(700株)
2395	新日本科学	21,700	647.00	14,039,900	貸付有価証券 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 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 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 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 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 600株(600株)
2433	博報堂D Yホールディングス	248,100	1,867.00	463,202,700	貸付有価証券 52,600株(52,600株)
2440	ぐるなび	31,000	617.00	19,127,000	貸付有価証券 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 400株(400株)
2471	エスプール	45,800	1,092.00	50,013,600	
2475	W D B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 800株(800株)
2487	C D G	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 14,600株(14,600株)
2749	J P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	E P S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 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	T A C	9,600	257.00	2,467,200	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 2,700株(2,700株)
6029	アトラ	4,100	353.00	1,447,300	貸付有価証券 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 500株(500株)
6036	Keepertech 技研	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 1,000株
6044	三機サービス	3,400	1,082.00	3,678,800	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 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 1,600株
6083	E R I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 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 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 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 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 2,200株(2,200株)
6184	鎌倉新書	18,000	1,252.00	22,536,000	
6185	S M N	3,800	763.00	2,899,400	貸付有価証券 200株(200株)
6186	一蔵	2,200	416.00	915,200	
6187	L I T A L I C O	7,200	3,915.00	28,188,000	貸付有価証券 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 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	バイカレント・コンサルティング	11,700	24,820.00	290,394,000	貸付有価証券 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	M S - J a p a n	7,200	1,090.00	7,848,000	貸付有価証券 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 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 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 500株
6552	GameWith	5,300	669.00	3,545,700	
6553	ソウルドアウト	4,200	1,610.00	6,762,000	
6555	M S & C o n s u l t i n g	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	R P A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 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 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 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 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 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 8,600株(8,600株)
9715	トランス・コスモス	17,000	3,060.00	52,020,000	
9716	乃村工藝社	76,400	939.00	71,739,600	貸付有価証券 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 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 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 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 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 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 500株(500株)
9765	オオバ	12,500	818.00	10,225,000	貸付有価証券 3,300株
9768	いであ	4,300	1,827.00	7,856,100	貸付有価証券 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 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MUFJ証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

## (2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

	[令和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(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(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 (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 (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 (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 (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 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 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          売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引          デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品          上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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 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

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

## 通貨関連

[ 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	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

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 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
FREEMONT-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
ENERGY 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	
	SOLAREEDGE 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 (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 (30,495,518,825)
オーストラリア 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 (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
	ASHTREAD 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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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
BRENNTAG 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
NEMETSCHKE 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 (91,577,906,580)	
合計	175,893,667		837,953,318,557 (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 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	(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	(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	(1,191,395,652)
	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	132,156	679,546.15	

イギリス 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	(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	(328,358,284)
シンガ ポールド 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	(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	(468,498,963)
合計				18,542,582,665	(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 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	595銘柄	97.47%	69.97%
	投資証券	35銘柄		2.53%
カナダドル	株式	87銘柄	99.60%	3.56%
	投資証券	2銘柄		0.40%
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%
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%
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%
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%

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。

## 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 ]

<b>資産の部</b>	
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
特殊債証券	9,403,243,313
社債証券	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
<b>負債の部</b>	
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
<b>純資産の部</b>	
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

[ 令和 3年 3月25日現在 ]

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[ 令和 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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[ 令和 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4 1 1 回利付国債（2年）	160,000,000	160,364,800	
	第4 1 3 回利付国債（2年）	900,000,000	902,394,000	
	第4 1 4 回利付国債（2年）	800,000,000	802,280,000	
	第4 1 5 回利付国債（2年）	250,000,000	250,777,500	
	第4 1 7 回利付国債（2年）	430,000,000	431,535,100	
	第4 1 8 回利付国債（2年）	400,000,000	401,508,000	
	第4 1 9 回利付国債（2年）	400,000,000	401,584,000	
	第4 2 0 回利付国債（2年）	730,000,000	733,036,800	
	第4 2 1 回利付国債（2年）	800,000,000	803,488,000	
	第4 2 2 回利付国債（2年）	370,000,000	371,683,500	
	第1 3 2 回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,303,536,000	
	第1 3 3 回利付国債（5年）	280,000,000	280,938,000	
	第1 3 4 回利付国債（5年）	400,000,000	401,600,000	
	第1 3 5 回利付国債（5年）	1,500,000,000	1,506,855,000	
	第1 3 6 回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,618,291,500	
	第1 3 7 回利付国債（5年）	1,900,000,000	1,910,906,000	
	第1 3 8 回利付国債（5年）	2,000,000,000	2,012,620,000	
	第1 3 9 回利付国債（5年）	500,000,000	503,440,000	
	第1 4 0 回利付国債（5年）	1,890,000,000	1,904,118,300	
	第1 4 1 回利付国債（5年）	1,220,000,000	1,229,613,600	
	第1 4 2 回利付国債（5年）	2,213,000,000	2,231,677,720	
	第1 4 3 回利付国債（5年）	1,090,000,000	1,099,592,000	
	第1 4 4 回利付国債（5年）	1,210,000,000	1,221,071,500	
	第1 4 5 回利付国債（5年）	1,740,000,000	1,756,860,600	
	第1 4 6 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 キュービー	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

[ 令和 3年 3月25日現在 ]

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 「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	
e M A X I S 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
e M A X I S 債券バランス(2資産均等型)	67,713,101円
M U A M 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
M U K A M バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	10,047,413,462円
M U K A M バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	3,889,739,221円
M U K A M スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	1,590,416,086円
M U K A M 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,567,651,419円
M U K A M バランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	658,960,657円
M U K A M 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

	[令和 3年 3月25日現在]
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
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 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 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、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            売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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

	[ 令和 3年 3月25日現在 ]
--	-------------------

種類	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。

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

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

- (イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
  - (ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

( 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 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 (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 (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 (6,113,143,820)
イギリス 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 (17,501,080,427)	
シンガ ポールド ドル	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	
シンガポールドドル合計			12,320,000.00	13,387,687.00 (1,083,063,878)	
	国債証券	3.48 MALAYSIAGOV 230315	4,000,000.00	4,105,340.40	

マレーシア リング ギット		3.502MALAYSIAGOV 270531	4,500,000.00	4,618,774.80
		3.8 MALAYSIAGOV 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	
マレーシアリングギット合計			44,500,000.00	46,005,181.38 (1,211,316,425)
スウェー デンク ローネ	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
スウェーデンクローネ合計			61,400,000.00	67,686,677.01 (856,236,464)
ノル ウェー クロー 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
ノルウェークローネ合計			47,550,000.00	49,016,781.48 (621,532,789)
デンマ ークク ロー 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
デンマーククローネ合計			57,100,000.00	71,183,079.34 (1,231,467,272)
	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	44,750,000.00	51,387,767.50

メキシコ ペソ		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	(1,951,574,030)
イスラエル 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	(1,151,575,222)
ポーランド 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	(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 (106,901,360,132)
合計			258,980,727,601 (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 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 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%
マレーシアリングgit	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。

## 2【ファンドの現況】

## 【三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

## 【純資産額計算書】

令和 3年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	12,589,456,180
負債総額	21,950,074
純資産総額（ - ）	12,567,506,106
発行済口数	10,782,645,334口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1655
（10,000口当たり）	（11,655）

（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）

資産総額	522,651,679,240
負債総額	11,011,461,238
純資産総額（ - ）	511,640,218,002
発行済口数	230,074,354,501口
1口当たり純資産価額（ / ）	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）

資産総額	925,796,913,213
負債総額	18,468,855,558
純資産総額（ - ）	907,328,057,655
発行済口数	236,755,542,322口

1口当たり純資産価額（ / ）	3.8323
（10,000口当たり）	（38,323）

## 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）

資産総額	156,902,442,247
負債総額	1,965,523,520
純資産総額（ - ）	154,936,918,727
発行済口数	158,753,652,894口
1口当たり純資産価額（ / ）	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）

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

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## （1）名義書換等

該当事項はありません。

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

## （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

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

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

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

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額等

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

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

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

###### 投資行動のモニタリング2

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

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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 (本)	純資産総額 (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 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
------------------------	-----------------------

## (資産の部)

## 流動資産

現金及び預金	2	53,969,686	2	56,398,457
有価証券		1,403,513		1,960,318
前払費用		514,587		575,904
未収入金		2,284		14,559
未収委託者報酬		9,995,458		10,296,453
未収収益	2	560,483	2	638,994
金銭の信託	2	100,000	2	100,000
その他		153,256		254,330
流動資産合計		66,699,271		70,239,017

## 固定資産

## 有形固定資産

建物	1	617,032	1	584,048
器具備品	1	665,247	1	871,893
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		1,910,713		2,084,375

## 無形固定資産

電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,670,753		3,369,611
ソフトウェア仮勘定		536,345		1,374,932
無形固定資産合計		4,222,921		4,760,365

## 投資その他の資産

投資有価証券		21,408,781		16,704,756
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	824,268	1	819,255
長期差入保証金		593,536		565,358
前払年金費用		415,234		375,031
繰延税金資産		1,496,180		1,912,824
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		25,079,767		20,718,993

## 固定資産合計

固定資産合計		31,213,401		27,563,734
--------	--	------------	--	------------

## 資産合計

資産合計		97,912,673		97,802,752
------	--	------------	--	------------

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	293,258	687,565
未払金		
未払収益分配金	170,281	131,478
未払償還金	448,695	395,400
未払手数料	2 3,990,054	2 4,026,078
その他未払金	2 3,961,765	2 3,818,195
未払費用	2 3,803,995	2 4,402,578
未払消費税等	194,852	629,469
未払法人税等	573,657	617,341



賞与引当金	901,135	933,517
役員賞与引当金	140,100	124,590
その他	868,992	701,285
流動負債合計	15,346,788	16,467,499
固定負債		
長期未払金	43,200	32,400
退職給付引当金	860,851	1,010,401
役員退職慰労引当金	144,303	130,784
時効後支払損引当金	247,767	238,811
固定負債合計	1,296,122	1,412,398
負債合計	16,642,910	17,879,897
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	26,069,594	25,847,605
利益剰余金合計	33,410,184	33,188,194
株主資本合計	80,143,028	79,921,039

(単位：千円)

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,375,414	67,967,489
投資顧問料	2,505,299	2,385,084
その他営業収益	18,844	16,085
営業収益合計	72,899,557	70,368,658

営業費用				
支払手数料	2	28,533,952	2	27,106,451
広告宣伝費		739,643		696,418
公告費		500		1,000
調査費				
調査費		1,794,755		1,857,271
委託調査費		12,194,996		11,579,175
事務委託費		1,016,816		847,769
営業雑経費				
通信費		170,794		153,731
印刷費		427,442		427,118
協会費		48,375		52,053
諸会費		16,175		15,990
事務機器関連費		1,841,631		1,953,926
営業費用合計		46,785,083		44,690,907
一般管理費				
給料				
役員報酬		349,083		331,987
給料・手当		6,453,717		6,611,427
賞与引当金繰入		901,135		933,517
役員賞与引当金繰入		140,100		124,590
福利厚生費		1,234,293		1,276,950
交際費		13,011		11,871
旅費交通費		200,426		165,891
租税公課		373,201		360,165
不動産賃借料		654,886		647,402
退職給付費用		428,912		422,919
役員退職慰労引当金繰入		51,159		48,183
固定資産減価償却費		1,252,321		1,307,555
諸経費		523,213		427,212
一般管理費合計		12,575,461		12,669,674
営業利益		13,539,012		13,008,076

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	181,073	90,965
受取利息	2 1,913	2 4,169
投資有価証券償還益	416,706	585,179
収益分配金等時効完成分	44,392	101,734
受取賃貸料	2 38,388	2 65,808
その他	11,871	19,987
営業外収益合計	694,346	867,845
営業外費用		
投資有価証券償還損	118,173	96,379
時効後支払損引当金繰入	1,166	
事務過誤費	420	3,483
賃貸関連費用	35,994	20,339
その他	1,481	1,920

営業外費用合計		157,235		122,122
経常利益		14,076,123		13,753,799
特別利益				
投資有価証券売却益		501,778		174,842
特別利益合計		501,778		174,842
特別損失				
投資有価証券売却損		135,399		75,963
投資有価証券評価損		62,310		163,865
固定資産除却損	1	4,848	1	8,832
固定資産売却損		225		435
システム関連費		322,986		
商標使用料		90,000		
特別損失合計		615,770		249,096
税引前当期純利益		13,962,130		13,679,545
法人税、住民税及び事業税	2	4,420,179	2	4,146,534
法人税等調整額		100,112		79,824
法人税等合計		4,320,066		4,226,359
当期純利益		9,642,064		9,453,186

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）

(単位：千円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
当期純利益			9,642,064
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	358,179	358,179	358,179
当期変動額合計	358,179	358,179	2,079,495
当期末残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762

第35期（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
				その他利益剰余金

	資本金	資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							221,989	221,989	221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4)退職給付引当金

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

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## (5)役員退職慰労引当金

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

## (6)時効後支払損引当金

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

## 5.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1)消費税等の会計処理

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

## (2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

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

## (未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

## (1)概要

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

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわ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、統一した算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

#### (2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

#### (3)当該会計基準等の適用による影響

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

#### (貸借対照表関係)

##### 1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

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

##### 2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

#### (損益計算書関係)

##### 1.固定資産除却損の内訳

	第34期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
建物	2,547千円	
器具備品	2,301千円	8,832千円

計	4,848千円	8,832千円
---	---------	---------

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
支払手数料	5,298,064千円	5,234,629千円
受取利息	3千円	2千円
受取賃貸料	38,388千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,216,517千円	3,030,180千円

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度増加 株式数 (株)	当事業年度減少 株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

第35期(自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度増加 株式数 (株)	当事業年度減少 株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

- (2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

(リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第34期(平成31年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	53,969,686	53,969,686	-
(2) 有価証券	1,403,513	1,403,513	-
(3) 未収委託者報酬	9,995,458	9,995,458	-
(4) 投資有価証券	21,353,421	21,353,421	-
資産計	86,722,080	86,722,080	-
(1) 未払手数料	3,990,054	3,990,054	-
負債計	3,990,054	3,990,054	-

第35期(令和2年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(4) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,328,625	85,328,625	-



(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

## (2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

## 負債

## (1)未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
非上場株式	55,360	31,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第34期(平成31年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	53,969,686	-	-	-
未収委託者報酬	9,995,458	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,403,513	9,358,708	5,874,634	90,573
合計	65,368,659	9,358,708	5,874,634	90,573

第35期(令和2年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	56,398,457	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,655,228	5,652,257	4,813,929	27,375

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円)

円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第34期(平成31年3月31日現在)

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

第35期(令和2年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,774,369	9,937,087	1,162,718
	小計	8,774,369	9,937,087	1,162,718
合計		18,633,714	18,631,098	2,616

## 3. 売却したその他有価証券

第34期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	140,240	58,440	-
債券	-	-	-
その他	5,222,594	443,338	135,399
合計	5,362,834	501,778	135,399

第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	8,940	-	15,060
債券	-	-	-
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について62,310千円(その他有価証券のその他62,310千円)減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について163,865千円(その他有価証券のその他163,865千円)減損処理を行っております。

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

## （退職給付関係）

## 1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

## 2.確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,729,252 千円	3,712,289 千円
勤務費用	193,531	204,225
利息費用	24,351	17,557
数理計算上の差異の発生額	15,898	52,430
退職給付の支払額	218,947	162,904
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,712,289	3,718,736

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

## (3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

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

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
勤務費用	193,531 千円	204,225 千円

利息費用	24,351	17,557
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の費用処理額	43,633	24,035
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	5,986	6,427
確定給付制度に係る退職給付費用	284,199	269,848

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額です。

#### (5)年金資産に関する事項

##### 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
債券	63.9 %	64.7 %
株式	33.2	32.3
その他	2.9	3.0
合計	100	100

##### 長期期待運用収益率の設定方法

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

#### (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

##### 主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
割引率	0.035 ~ 0.49%	0.095 ~ 0.52%
長期期待運用収益率	1.5 ~ 1.8%	1.5 ~ 1.8%

#### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

##### （税効果会計関係）

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,122,023	2,029,829
繰延税金負債		
前払年金費用	127,144	114,834
連結納税適用による時価評価	1,320	1,260
その他有価証券評価差額金	497,269	801
その他	108	109
繰延税金負債 合計	625,842	117,005
繰延税金資産の純額	1,496,180	1,912,824

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳  
第34期（平成31年3月31日現在）及び第35期（令和2年3月31日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）及び第35期（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）及び第35期（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注4)	科目	期末残高(注4)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,216,517 千円	その他未払金	3,217,341 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等  投資の助言  役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)  投資助言料 (注3)	5,298,064 千円  695,834 千円	未払手数料  未払費用	671,568 千円  365,510 千円

## 第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注4)	科目	期末残高(注4)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,030,180 千円	その他未払金	3,029,426 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等  投資の助言  役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)  投資助言料 (注3)	5,234,629 千円  583,270 千円	未払手数料  未払費用	712,210 千円  302,681 千円

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

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

3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

## 第34期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

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

同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし (注1)	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注2)	4,629,670 千円	未払手数料	734,633 千円
						取引銀行	コーラブル預金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息 (注3)	1,578 千円	未収収益	1,578 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円

## 第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注4)	科目	期末残高(注4)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注2)	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
						取引銀行	コーラブル預金の払戻 (注3)	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息 (注3)	4,126 千円	未収収益	997 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注2)	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. (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 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
1株当たり純資産額	384,107.08円	377,741.17円
1株当たり当期純利益金額	45,571.50円	44,678.80円

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

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 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)
当期純利益金額(千円)	9,642,064	9,453,186
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	9,642,064	9,453,186
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581	211,581

## 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 (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 (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 (自 令和2年4月1日 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			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	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
株主資本以外の項目の当中間期変動額(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
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
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 項目の当中間期 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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

#### (5) 役員退職慰労引当金

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

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 (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 (自 令和2年4月1日 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 株式数 (株)	当中間会計期間 増加株式数 (株)	当中間会計期間 減少株式数 (株)	当中間会計期間末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

## 2. 配当に関する事項

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

（リース取引関係）

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 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	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 上額が取得原価を 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 （令和2年9月30日現在）
1株当たり純資産額 （算定上の基礎）	362,493.28円
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 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 (自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	21,327.27円
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。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

#### 5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2020年9月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

###### (2) 販売会社



名称	資本金の額 (2020年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096 百万円	銀行業務を営んでいます。
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。
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。
株式会社みずほ銀行	1,404,065 百万円	銀行業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

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

## 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年6月24日	有価証券届出書
2020年6月24日	有価証券報告書
2020年12月24日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年12月24日	半期報告書

# 独立監査人の監査報告書

令和2年6月26日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

## 有限責任監査法人トーマツ 東京事務所

指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 青 木 裕 晃 印  
行社員

指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 伊 藤 鉄 也 印  
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、「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 DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）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 DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）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 公認会計士 青 木 裕 晃 印  
行社員指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 伊 藤 鉄 也 印  
行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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。