

【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】	2022年5月6日提出
【計算期間】	第5期(自 2021年2月6日至 2022年2月7日)
【ファンド名】	国内株式セレクション（ラップ向け）
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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、主として値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

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

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MR F（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MR Fをいいます。
	E T F	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	
投資対象地域	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。
	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

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

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

〔ファンドの目的・特色〕

ファンドの目的

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

ファンドの特色

特色

1

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

- 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2022年5月7日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<TOPIXマザーファンド>

東京証券取引所に上場されている日本の株式への投資を行います。

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

<JPX日経400インデックスマザーファンド>

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

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

<日本株インカム・マザーファンド>

日本の株式への投資を行います。

- ・主としてTOPIX構成銘柄に投資しますが、TOPIX構成銘柄以外の上場株式等に投資する場合があります。
- ・主として、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、「高水準の配当収入」と「中長期的な株価の値上がり益」の獲得をめざして運用を行います。

<JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド>

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

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

<日本株オープン「35」マザーファンド>

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

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

<日本・小型株・ファンド・マザーファンド>

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

- ・原則、東京証券取引所のグロース市場上場株式、スタンダード市場上場株式およびプライム市場上場株式を中心に投資します。
- ・目標株価への到達もしくは接近、ファンダメンタルズの変化、新規投資候補銘柄との相対比較等を勘案し、組入銘柄は適宜入れ替えます。
- ・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスをベンチマークとします。

<日本株式最小分散インデックスマザーファンド>

日本の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

<ジャパン・アクティブ・マザーファンド>

日本の株式を主要投資対象とします。

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

<日本株ESGアクティブマザーファンド>

日本の株式を主要投資対象とします。

- ・株式への投資にあたっては、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業の中から、企業収益の成長性、株価水準等を考慮して、銘柄選定を行います。
- ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。

<ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

日本の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)を主要投資対象とします。

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

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

特色

2

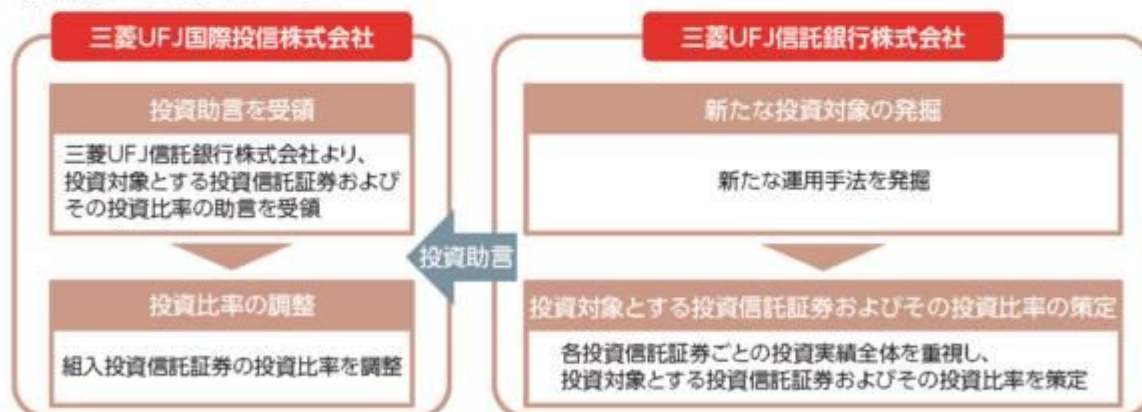
三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

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

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

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

<運用プロセスのイメージ>



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

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

特色3

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

為替ヘッジの活用

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

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

<投資リターンのイメージ図>



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

特色4

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

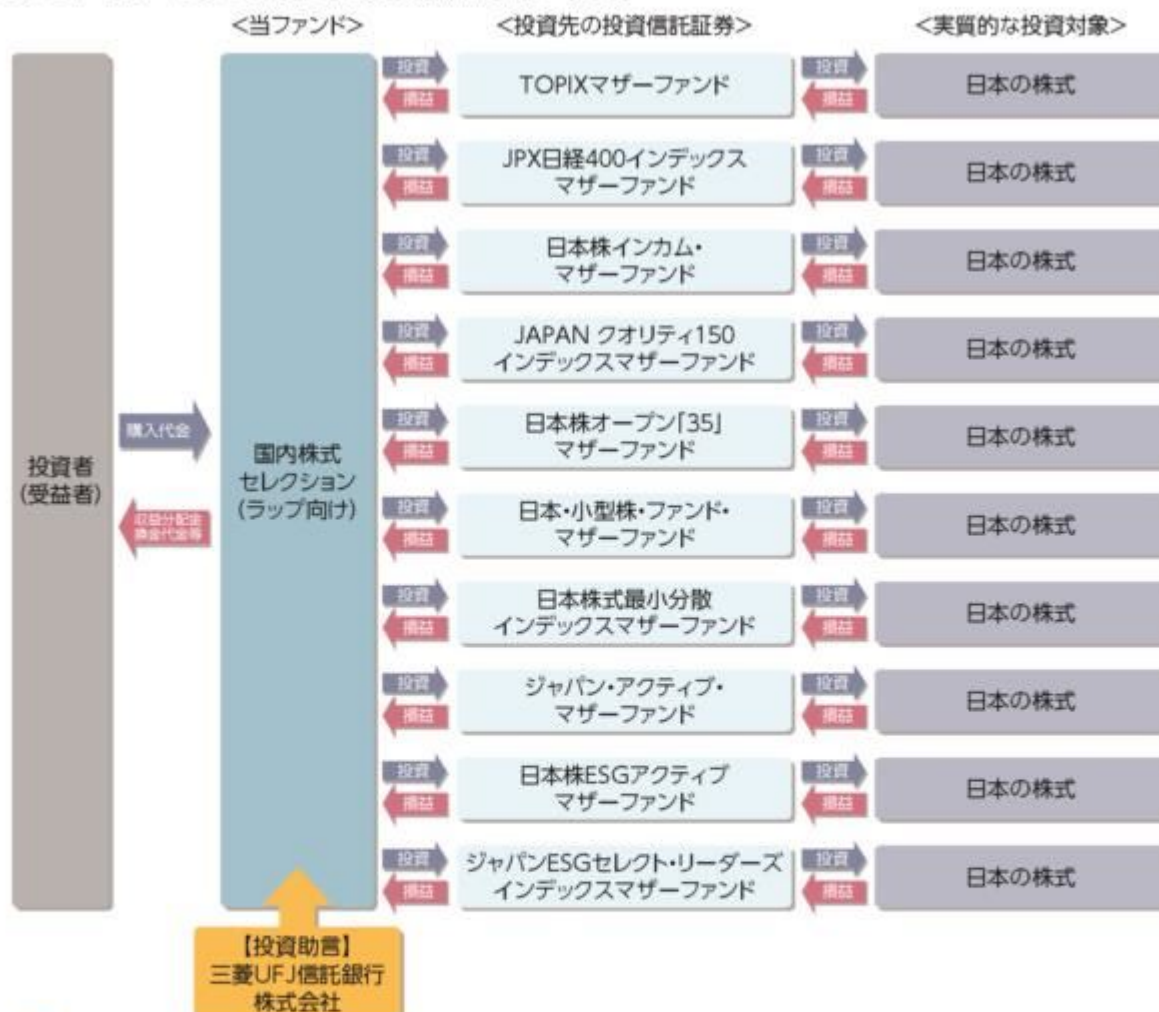
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。

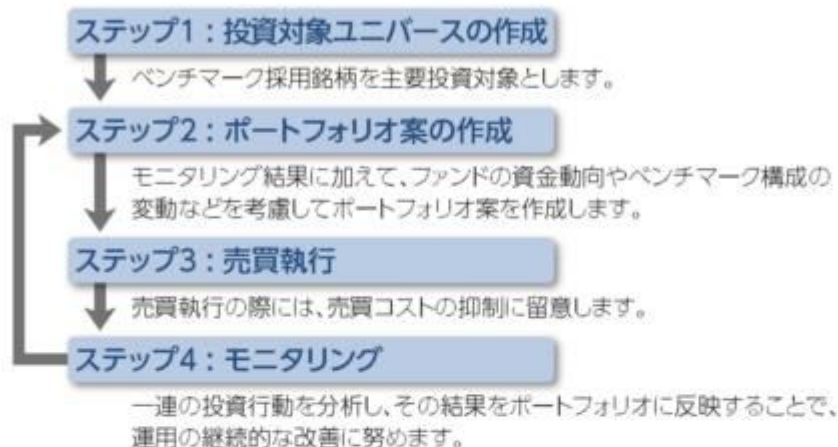


■主な投資制限

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

■各投資信託証券の運用プロセス

<TOPIXマザーファンド／JPX日経400インデックスマザーファンド／JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド／日本株式最小分散インデックスマザーファンド／ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>



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

<日本株インカム・マザーファンド>

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

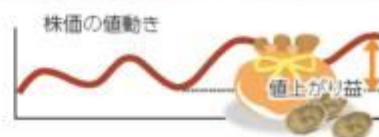
ファンドの主な収益の源泉

I. 高水準の配当収入



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

II. 中長期的な株価の値上がり益



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

<組入銘柄選定プロセスについて>



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

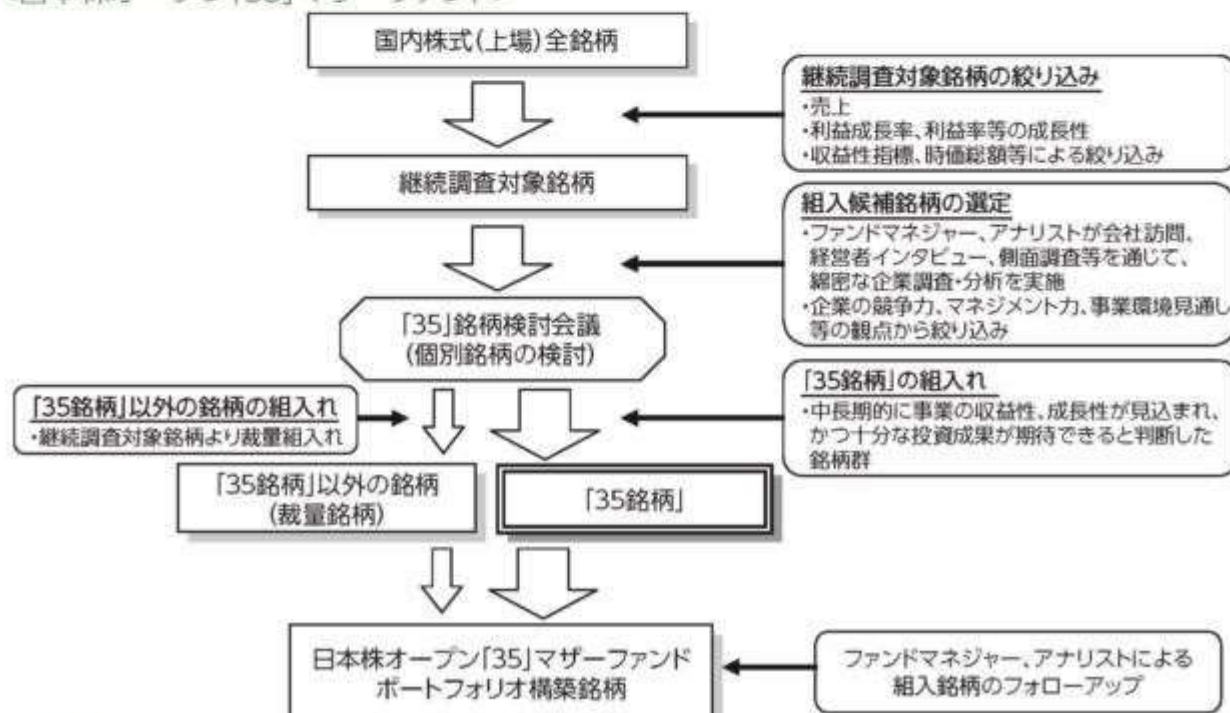
❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

◆ PBR、PERは株価がどの程度の水準にあるかを評価する指標です。

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

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

<日本株オープン「35」マザーファンド>

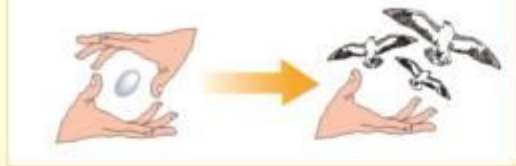


❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、こうした企業が必ず利益成長を達成し、株価が上昇するわけではなく、環境によっては業績が悪化し、株価が下落することがある点にご留意ください。

<日本・小型株・ファンド・マザーファンド>

ファンドの主な銘柄選定基準

I. 成長性の高い小型株式



中長期的に高い成長が期待できる小型株式に注目します。

II. 綿密な企業調査により厳選



株価に影響を与える「企業情報」は、常に公平に株価に反映するとは限りません。綿密な企業調査により、将来的価値が株価に反映されていない銘柄の発掘に努めます。

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

<ジャパン・アクティブ・マザーファンド>

銘柄選定プロセス

STEP 1

利益成長のためのポテンシャルである豊富なキャッシュフローを持つ割安企業を選別

・グループ企業も含めた総合的な収益力（低PER、低PCFRなど） ・時価で評価した保有資産の価値（低PBRなど）

STEP 2

豊富なキャッシュフローを活用し、優れたマネジメント力を発揮する企業を選別

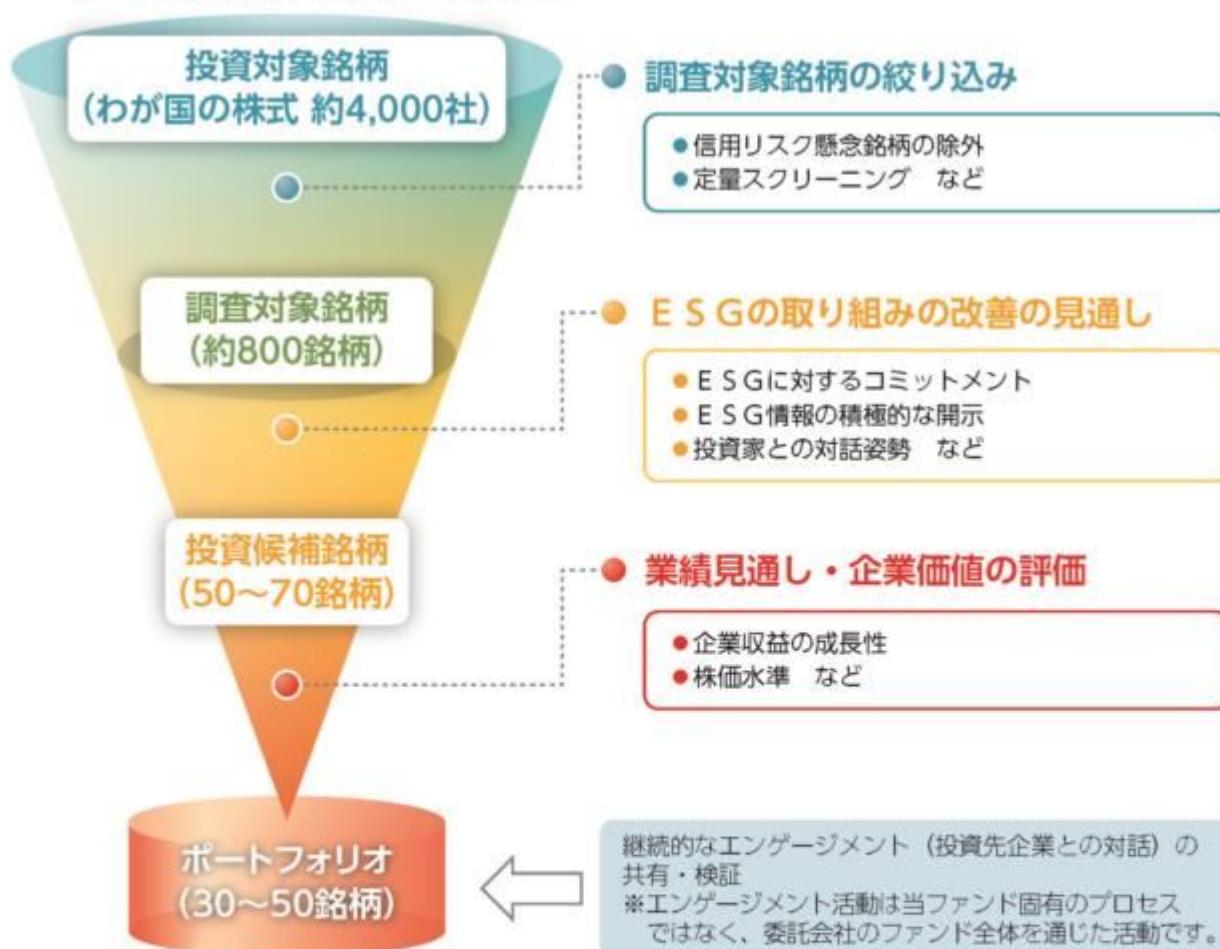
・資産・事業売却 ～リストラクチャリングなどの原資に
・事業交換 ～経営資源の「選択と集中」
・企業買収・合併 …など ～スケールメリット、残存者メリットの追求 …など

STEP 3

ポートフォリオ組入銘柄の決定

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

<日本株ESGアクティブマザーファンド>



! 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記プロセスは、今後変更されることがあります。

<ご参考>委託会社のエンゲージメント活動について

- 当社は、投資先企業との「目的を持った対話」を通じて、投資先企業の様々な問題についての認識共有化や改善への取組みが図られ、ひいては資本効率改善や持続的成長に結びつくと考えています。こうした考えの下、ファンドの運用方針やファンドにおける投資先企業の重要性等を勘案しつつアクティブ運用及びパッシブ運用共に「目的を持った対話」を実施します。

※三菱UFJ国際投信のスチュワードシップ・コードへの対応方針より抜粋



指数について

- ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・JPX日経インデックス400(配当込み)とは、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社JPX総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則400銘柄で構成される株価指数です。「JPX日経インデックス400(配当込み)」(以下「JPX日経インデックス400」といいます。))は、株式会社JPX総研(以下「JPX総研」といいます。))及び株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。))によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、JPX総研及び日経は、その運用及びファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
- ・iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)とは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、流動性によりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し、高ROEの継続性を評価して150銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)は、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとSTOXXリミテッド(以下「STOXX社」)が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。2001年6月18日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。
- ・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスは、RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスを構成するインデックスの一つです。RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスは、わが国の全金融商品取引所全上場銘柄の全時価総額(時価総額は全て安定持株控除後)の98%超をカバーするRUSSELL/NOMURA Total Marketインデックスのうち、時価総額下位約15%の銘柄により構成されています。RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスは、Frank Russell Companyと野村證券株式会社が作成している株価指数で、当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は両社に帰属します。なお、両社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- ・MSCI日本株最小分散指数(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、J-REITを除いた日本株式を対象に、ボラティリティ(価格変動率)が最も小さくなるように各銘柄の構成比率を決定し算出した指数です。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ・MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、業種内において相対的にESG(環境、社会、ガバナンス)評価が優れた企業で構成されています。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年3月13日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①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)

委託会社（委託者）

三菱UFJ国際投信株式会社

信託銀行株式会社)	
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資↓↑損益	
投資対象ファンド	
投資↓↑損益	
有価証券等	

②委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「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。

③委託会社の概況（2022年2月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

投資信託証券を主要投資対象とします。

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

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

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

投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）ならびに投資証券および外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。

１．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

２．コマーシャル・ペーパー

３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、２．の証券の性質を有するもの

４．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

③金融商品の指図範囲

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

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

・外国為替予約取引

<投資信託証券の概要>

ファンド名	TOPIXマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。 ・株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	東京証券取引所に上場されている株式
主な投資制限	・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。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2001年3月26日
決算日	原則として毎年3月25日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	JPX日経400インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・株式の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2014年4月1日
決算日	原則として毎年1月26日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本株インカム・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてTOPIX構成銘柄の中から、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。なお、TOPIX構成銘柄以外の上場株式等に投資する場合があります。 ・銘柄選定にあたっては、予想配当利回りが原則として市場平均以上の銘柄から流動性等を勘案して調査対象銘柄を選定し、その中から財務の健全性や配当の実現性等を勘案して組入候補銘柄を決定します。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、銘柄分散を意識し、適宜組入銘柄の入替えを行います。 ・原則として株式の組入比率は高位を維持します。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・なお、市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	0.3%
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2005年7月15日
決算日	原則として毎年2月3日、8月3日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)に投資を行い、ISTOXX MUT B JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2015年11月6日
決算日	原則として毎年1月26日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本株オープン「35」マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・国内の上場株式、店頭登録株式を主たる投資対象とし、個別企業訪問等によるボトム・アップ・アプローチをベースとしたアクティブ運用を行います。 ・東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、これを上回る投資成果をめざします。 ・ファンドマネジャーが自ら企業訪問・調査・分析を行うことにより、企業の成長性とそのリスク、経営理念とその浸透度等を直接判断します。 ・現物株を中心に投資します。 ・主として、委託者が厳選した「35銘柄」に投資します。投資対象を「35銘柄」に絞ることで、銘柄のフォローを徹底し、集中投資効果を図ります。 ・「35銘柄」とは、委託者が独自の調査・分析等に基づき、投資判断・決定を行うなかで中長期的に事業の収益性・成長性が見込まれ、かつ十分な投資成果が期待できると判断した銘柄群をいいます。投資妙味のある銘柄を新規に発掘した場合、既存銘柄との比較を行い入替えの是非を検討します。 ・市場動向等によっては、限定された範囲内で、委託者が継続的にフォローしている銘柄群に投資することがあります。 ・株式組入比率は原則100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2001年10月5日
決算日	原則として毎年3月23日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本・小型株・ファンド・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の小型株式の中から、ボトムアップアプローチにより成長性が高いと判断される銘柄を厳選して投資することを基本とします。 ・※小型株式の分類は「RUSSELL/NOMURA 日本株インデックス」の分類に準ずるものとします。 ・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックスをベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 ・組入銘柄については、適宜見直しを行い、必要に応じ入替えを行います。 ・株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式(金融商品取引所上場および店頭登録株式)
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2000年3月31日
決算日	原則として毎年6月10日、12月10日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

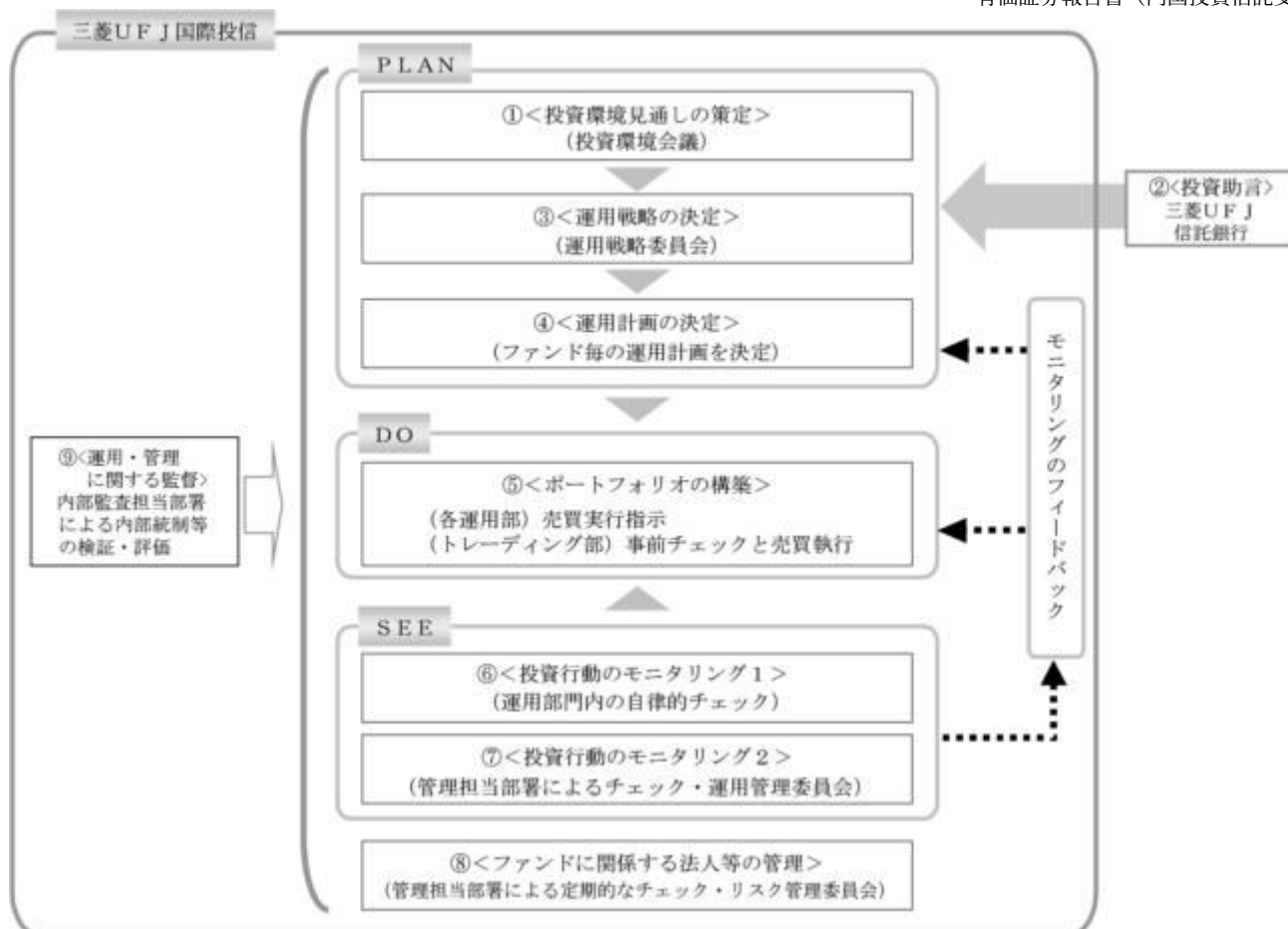
ファンド名	日本株式最小分散インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2016年11月9日
決算日	原則として毎年10月29日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ジャパン・アクティブ・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・わが国の株式の中から、「資産・利益等と比較して株価が割安と判断され、かつ、優れたマネジメント力で継続的な利益成長や企業再生・復活が期待できる銘柄」を厳選し投資します。 ・東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2003年2月28日
決算日	原則として毎年10月30日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本株ESGアクティブマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の株式に投資を行います。 ・株式への投資にあたっては、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業の中から、企業収益の成長性、株価水準等を考慮して、銘柄選定を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・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(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10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2019年5月15日
決算日	原則として毎年5月25日、11月25日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主として対象インデックスに採用されているわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定株式を含みます。)
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2018年10月22日
決算日	原則として毎年1月26日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

(3) 【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②投資助言

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

③運用戦略の決定

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

④運用計画の決定

③で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

⑤ポートフォリオの構築

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

⑥投資行動のモニタリング1

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

⑦投資行動のモニタリング2

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

⑧ファンドに関係する法人等の管理

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

⑨運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

（５）【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①株式

株式への直接投資は行いません。

②投資信託証券

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

③信用取引

信用取引の指図は行いません。

④外国為替予約取引

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

⑤公社債の借入れ

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

⑥資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

⑦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。

⑧信用リスクの分散規制

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

3【投資リスク】

（１）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動 リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

為替変動 リスク

組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

信用リスク

組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。

流動性 リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

※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。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上

がりが小さかった場合も同様です。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

（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い、運用管理委員会において、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。

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。運用管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①トレーディング担当部署

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

②コンプライアンス担当部署

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

③リスク管理担当部署

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

④内部監査担当部署

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

＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

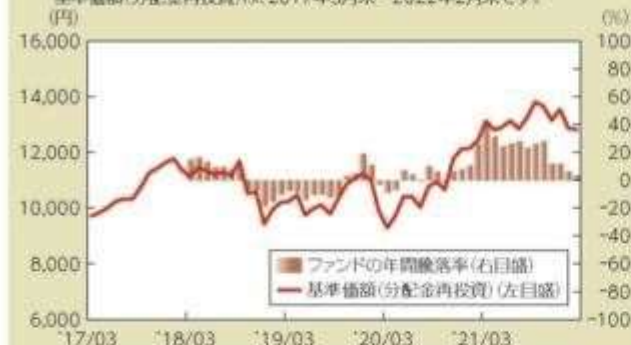
■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2018年3月～2022年2月です。

基準価額(分配金再投資)は、2017年3月末～2022年2月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2017年3月末～2022年2月末)

ファンドの年間騰落率は、2018年3月～2022年2月です。



ファンド：日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

●基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

●年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

●ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
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0.462%（税抜0.42%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

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

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

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

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

<投資信託証券の信託報酬率>

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

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。上記の他、監査費用等の諸費用が別途かかります。申込手数料はかかりません。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について

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

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

ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

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

◇収益分配金について

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

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

※上記は2022年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

（１）【投資状況】

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	15,128,270,867	97.99
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	310,499,965	2.01
純資産総額		15,438,770,832	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	2,602,555,962	2.2182	5,773,033,468	2.1748	5,660,038,706	36.66
日本	親投資信託受益証券	日本株インカム・マザーファンド	920,944,843	2.4920	2,294,994,549	2.4449	2,251,618,046	14.58
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	1,218,298,842	1.3915	1,695,262,839	1.3661	1,664,318,048	10.78

日本	親投資信託受益証券	日本・小型株・ファンド・マザーファンド	150,975,756	7.6961	1,161,938,547	7.6906	1,161,094,149	7.52
日本	親投資信託受益証券	J P X日経４００インデックスマザーファンド	493,109,256	1.8712	922,727,191	1.8335	904,115,820	5.86
日本	親投資信託受益証券	日本株オープン「３５」マザーファンド	190,678,688	4.0640	774,932,413	3.9872	760,274,064	4.92
日本	親投資信託受益証券	ジャパン・アクティブ・マザーファンド	196,689,518	3.9051	768,098,401	3.8577	758,769,153	4.91
日本	親投資信託受益証券	日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド	504,223,573	1.5237	768,290,618	1.4983	755,478,179	4.89
日本	親投資信託受益証券	J A P A N クオリティ１５０インデックスマザーファンド	391,974,554	1.5914	623,791,915	1.5535	608,932,469	3.94
日本	親投資信託受益証券	ジャパンＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	473,325,675	1.3134	621,700,896	1.2753	603,632,233	3.91

（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 4年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.99
合計	97.99

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和4年2月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (平成30年 2月 5日)	3,798,197,134	3,798,197,134	11,677	11,677
第2計算期間末日 (平成31年 2月 5日)	6,798,579,101	6,798,579,101	10,048	10,048
第3計算期間末日 (令和 2年 2月 5日)	6,734,611,028	6,734,611,028	11,120	11,120
第4計算期間末日 (令和 3年 2月 5日)	9,808,518,564	9,808,518,564	12,620	12,620
第5計算期間末日 (令和 4年 2月 7日)	15,658,464,142	15,658,464,142	13,043	13,043
令和 3年 2月末日	9,790,091,396	—	12,416	—

3月末日	10,784,391,651	—	13,122	—
4月末日	10,984,102,454	—	12,803	—
5月末日	11,572,606,591	—	12,910	—
6月末日	12,536,048,827	—	13,136	—
7月末日	12,936,075,398	—	12,844	—
8月末日	14,016,806,470	—	13,246	—
9月末日	14,912,064,937	—	13,814	—
10月末日	14,990,424,949	—	13,648	—
11月末日	14,923,015,836	—	13,146	—
12月末日	15,855,785,907	—	13,541	—
令和 4年 1月末日	15,441,615,960	—	12,878	—
2月末日	15,438,770,832	—	12,809	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	16.77
第2計算期間	△13.95
第3計算期間	10.66
第4計算期間	13.48
第5計算期間	3.35

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	4,180,718,781	927,957,119	3,252,761,662
第2計算期間	4,337,352,686	824,150,797	6,765,963,551
第3計算期間	1,480,174,624	2,189,987,840	6,056,150,335
第4計算期間	5,016,855,517	3,300,953,963	7,772,051,889

第5計算期間	6,234,909,350	2,001,689,711	12,005,271,528
--------	---------------	---------------	----------------

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在
(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	698,445,923,390	99.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	7,070,899,432	1.00
純資産総額		705,516,822,822	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 4年 2月28日現在
(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	6,977,790,000	0.99

(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 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	13,718,700	1,858.34	25,494,090,997	2,138.50	29,337,439,950	4.16
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,696,600	11,969.86	20,308,075,810	11,810.00	20,036,846,000	2.84
日本	株式	キーエンス	電気機器	245,400	61,735.12	15,149,799,406	53,780.00	13,197,612,000	1.87
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	16,752,500	627.42	10,510,917,148	712.80	11,941,182,000	1.69
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,996,500	6,149.03	12,276,557,014	4,819.00	9,621,133,500	1.36
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	171,900	50,598.91	8,697,954,142	55,770.00	9,586,863,000	1.36
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,780,300	3,094.03	8,602,343,585	3,293.00	9,155,527,900	1.30

日本	株式	任天堂	その他製品	152,900	58,456.36	8,937,977,517	58,020.00	8,871,258,000	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,593,600	7,817.84	12,458,519,628	5,125.00	8,167,200,000	1.16
日本	株式	信越化学工業	化学	455,500	19,298.44	8,790,439,442	17,670.00	8,048,685,000	1.14
日本	株式	HOYA	精密機器	528,500	15,498.72	8,191,077,330	14,855.00	7,850,867,500	1.11
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,998,900	3,411.66	6,819,585,475	3,871.00	7,737,741,900	1.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,849,000	4,027.97	7,447,728,774	4,121.00	7,619,729,000	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,132,400	3,345.68	7,134,333,404	3,525.00	7,516,710,000	1.07
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	2,128,700	3,814.99	8,120,972,841	3,501.00	7,452,578,700	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,302,600	6,001.29	7,817,288,385	5,650.00	7,359,690,000	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	345,100	24,641.83	8,503,896,560	21,205.00	7,317,845,500	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,937,500	3,588.70	6,953,120,236	3,756.00	7,277,250,000	1.03
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,865,700	3,474.33	6,482,073,282	3,743.00	6,983,315,100	0.99
日本	株式	日本電産	電気機器	702,000	12,954.70	9,094,203,640	9,883.00	6,937,866,000	0.98
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	305,800	16,970.44	5,189,560,826	21,130.00	6,461,554,000	0.92
日本	株式	村田製作所	電気機器	795,600	9,291.03	7,391,950,785	7,787.00	6,195,337,200	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	2,128,300	2,931.51	6,239,152,596	2,793.50	5,945,406,050	0.84
日本	株式	三井物産	卸売業	2,071,500	2,479.65	5,136,595,890	2,865.50	5,935,883,250	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	4,025,300	1,525.47	6,140,512,185	1,450.50	5,838,697,650	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,043,500	4,825.50	5,035,417,058	5,591.00	5,834,208,500	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	879,800	5,656.44	4,976,541,521	6,574.00	5,783,805,200	0.82
日本	株式	SMC	機械	79,300	69,534.21	5,514,062,860	68,050.00	5,396,365,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,416,300	1,610.85	5,503,151,096	1,525.00	5,209,857,500	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	237,700	25,676.60	6,103,327,901	21,155.00	5,028,543,500	0.71

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.28
	建設業	2.29
	食料品	3.40
	繊維製品	0.46
	パルプ・紙	0.21
	化学	6.55
	医薬品	4.99
	石油・石炭製品	0.44
	ゴム製品	0.67
	ガラス・土石製品	0.77
	鉄鋼	0.86

	非鉄金属	0.81
	金属製品	0.60
	機械	5.18
	電気機器	17.47
	輸送用機器	8.42
	精密機器	2.62
	その他製品	2.37
	電気・ガス業	1.17
	陸運業	3.05
	海運業	0.64
	空運業	0.43
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.99
	卸売業	5.66
	小売業	4.33
	銀行業	5.37
	証券、商品先物取引業	0.78
	保険業	2.16
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.97
	サービス業	5.67
	小計	99.00
合計		99.00

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 4年 2月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 22年03月限	買建	369	円	7,079,247,950	6,977,790,000	0.99

（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。

J P X日経400インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	6,951,968,930	97.20
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	199,999,598	2.80
純資産総額		7,151,968,528	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 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	198,841,500	2.78

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2,400	56,262.18	135,029,244	55,770.00	133,848,000	1.87
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	55,600	2,222.12	123,550,087	2,138.50	118,900,600	1.66
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	10,000	12,621.81	126,218,142	11,810.00	118,100,000	1.65
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	165,000	683.10	112,711,916	712.80	117,612,000	1.64
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	33,400	3,222.58	107,634,353	3,293.00	109,986,200	1.54
日本	株式	HOYA	精密機器	7,300	14,738.65	107,592,177	14,855.00	108,441,500	1.52
日本	株式	三菱商事	卸売業	27,500	3,802.69	104,574,206	3,871.00	106,452,500	1.49
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	25,500	4,142.60	105,636,449	4,121.00	105,085,500	1.47
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	29,400	3,341.09	98,228,090	3,525.00	103,635,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	21,300	5,488.13	116,897,282	4,819.00	102,644,700	1.44
日本	株式	ダイキン工業	機械	4,800	24,025.26	115,321,261	21,205.00	101,784,000	1.42
日本	株式	KDDI	情報・通信業	26,700	3,565.60	95,201,672	3,756.00	100,285,200	1.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,800	57,757.66	103,963,802	53,780.00	96,804,000	1.35
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	25,700	3,633.84	93,389,940	3,743.00	96,195,100	1.35
日本	株式	日立製作所	電気機器	17,000	6,104.08	103,769,373	5,650.00	96,050,000	1.34
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	27,400	3,309.15	90,670,922	3,501.00	95,927,400	1.34
日本	株式	信越化学工業	化学	5,400	18,131.61	97,910,736	17,670.00	95,418,000	1.33

日本	株式	任天堂	その他製品	1,600	56,286.21	90,057,944	58,020.00	92,832,000	1.30
日本	株式	日本電産	電気機器	9,000	10,198.43	91,785,900	9,883.00	88,947,000	1.24
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	4,200	18,556.16	77,935,876	21,130.00	88,746,000	1.24
日本	株式	村田製作所	電気機器	11,000	8,381.77	92,199,547	7,787.00	85,657,000	1.20
日本	株式	第一三共	医薬品	29,300	2,597.07	76,094,177	2,793.50	81,849,550	1.14
日本	株式	三井物産	卸売業	28,500	2,816.30	80,264,801	2,865.50	81,666,750	1.14
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	14,400	5,347.62	77,005,829	5,591.00	80,510,400	1.13
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	12,100	6,783.98	82,086,249	6,574.00	79,545,400	1.11
日本	株式	SMC	機械	1,100	63,402.87	69,743,157	68,050.00	74,855,000	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	47,000	1,557.07	73,182,374	1,525.00	71,675,000	1.00
日本	株式	ファナック	電気機器	3,300	22,191.11	73,230,668	21,155.00	69,811,500	0.98
日本	株式	デンソー	輸送用機器	8,200	8,504.80	69,739,432	8,047.00	65,985,400	0.92
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	32,300	1,882.10	60,791,976	1,918.50	61,967,550	0.87

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.04
	鉱業	0.34
	建設業	2.46
	食料品	3.79
	繊維製品	0.37
	パルプ・紙	0.21
	化学	7.25
	医薬品	6.36
	石油・石炭製品	0.57
	ゴム製品	0.85
	ガラス・土石製品	0.75
	非鉄金属	0.77
	金属製品	0.31
	機械	5.65
	電気機器	17.11
	輸送用機器	6.56
	精密機器	3.16
	その他製品	1.96
	電気・ガス業	1.24
	陸運業	1.62
	海運業	0.71
	倉庫・運輸関連業	0.03

情報・通信業	7.18
卸売業	6.45
小売業	3.84
銀行業	5.44
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	2.81
その他金融業	1.35
不動産業	2.29
サービス業	4.84
小計	97.20
合計	97.20

（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 4年 2月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	J P X日経インデックス４００先物 ２２年０３月限	買建	117	円	200,035,870	198,841,500	2.78

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

日本株インカム・マザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	7,194,699,380	96.25
投資証券	日本	175,409,900	2.35
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	104,621,874	1.40
純資産総額		7,474,731,154	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 4年 2月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	230,200	2,291.13	527,418,126	2,138.50	492,282,700	6.59
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	148,000	2,623.00	388,204,000	2,408.00	356,384,000	4.77
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	77,900	3,338.00	260,030,200	3,293.00	256,524,700	3.43
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	347,200	721.05	250,348,560	712.80	247,484,160	3.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	3,800	55,200.00	209,760,000	55,770.00	211,926,000	2.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	54,700	3,845.10	210,327,174	3,871.00	211,743,700	2.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	50,300	3,672.00	184,701,600	3,743.00	188,272,900	2.52
日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	71,000	1,907.50	135,432,500	2,108.50	149,703,500	2.00
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	100,200	1,440.00	144,288,000	1,450.50	145,340,100	1.94
日本	株式	ライイト工業	建設業	69,800	1,848.00	128,990,400	1,953.00	136,319,400	1.82
日本	株式	オリックス	その他金融業	58,500	2,416.00	141,336,000	2,283.00	133,555,500	1.79
日本	株式	ニコン	精密機器	111,400	1,265.00	140,921,000	1,193.00	132,900,200	1.78
日本	株式	三菱瓦斯化学	化学	62,800	2,164.53	135,932,484	2,037.00	127,923,600	1.71
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	19,100	6,897.00	131,732,700	6,574.00	125,563,400	1.68
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	30,100	4,174.00	125,637,400	4,121.00	124,042,100	1.66
日本	株式	A G C	ガラス・土石製品	24,100	5,200.00	125,320,000	5,090.00	122,669,000	1.64
日本	株式	S B I ホールディングス	証券、商品先物取引業	39,000	3,030.00	118,170,000	3,000.00	117,000,000	1.57
日本	株式	タムロン	精密機器	49,200	2,517.00	123,836,400	2,354.00	115,816,800	1.55
日本	株式	日本瓦斯	小売業	65,800	1,596.30	105,036,817	1,729.00	113,768,200	1.52
日本	株式	丸紅	卸売業	93,500	1,218.00	113,883,000	1,203.50	112,527,250	1.51
日本	株式	大日本印刷	その他製品	36,700	2,753.10	101,038,847	2,987.00	109,622,900	1.47
日本	株式	I N P E X	鉱業	88,500	1,148.00	101,598,000	1,185.00	104,872,500	1.40
日本	株式	アサヒグループホールディングス	食料品	22,400	4,790.00	107,296,000	4,644.00	104,025,600	1.39
日本	株式	リソー教育	サービス業	283,400	409.00	115,910,600	362.00	102,590,800	1.37
日本	株式	キリンホールディングス	食料品	51,800	1,865.50	96,632,900	1,907.50	98,808,500	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	1,700	57,454.80	97,673,174	58,020.00	98,634,000	1.32
日本	株式	エービーシー・マート	小売業	19,600	5,100.00	99,960,000	4,980.00	97,608,000	1.31
日本	株式	デンソー	輸送用機器	12,100	8,741.00	105,766,100	8,047.00	97,368,700	1.30
日本	株式	住友金属鉱山	非鉄金属	16,900	5,296.00	89,502,400	5,746.00	97,107,400	1.30
日本	株式	S U B A R U	輸送用機器	51,100	2,127.50	108,715,250	1,893.50	96,757,850	1.29

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	鉱業	1.40
	建設業	5.54
	食料品	2.71
	化学	6.02
	医薬品	1.01
	ゴム製品	1.09
	ガラス・土石製品	2.44
	鉄鋼	2.00
	非鉄金属	3.07
	金属製品	2.34
	機械	1.75
	電気機器	6.26
	輸送用機器	9.18
	精密機器	3.33
	その他製品	2.79
	電気・ガス業	0.50
	陸運業	1.47
	倉庫・運輸関連業	1.09
	情報・通信業	5.79
	卸売業	9.13
	小売業	4.27
	銀行業	5.44
	証券、商品先物取引業	2.35
	保険業	6.45
	その他金融業	3.38
	不動産業	1.41
	サービス業	4.04
	小計	96.25
投資証券	—	2.35
合計		98.60

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

投資状況

令和 4年 2月28日現在
(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	4,958,327,600	98.83
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	58,686,574	1.17
純資産総額		5,017,014,174	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 4年 2月28日現在
(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	56,730,000	1.13

（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 4年 2月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	KDDI	情報・通信業	33,100	3,562.99	117,934,981	3,756.00	124,323,600	2.48
日本	株式	任天堂	その他製品	2,100	56,292.80	118,214,888	58,020.00	121,842,000	2.43
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	32,300	3,632.79	117,339,388	3,743.00	120,898,900	2.41
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	18,300	6,782.44	124,118,658	6,574.00	120,304,200	2.40
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	35,800	3,222.17	115,353,839	3,293.00	117,889,400	2.35
日本	株式	SMC	機械	1,500	63,405.91	95,108,872	68,050.00	102,075,000	2.03
日本	株式	オリンパス	精密機器	44,200	2,447.81	108,193,346	2,299.50	101,637,900	2.03
日本	株式	信越化学工業	化学	5,700	18,085.57	103,087,774	17,670.00	100,719,000	2.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,800	56,408.23	101,534,816	55,770.00	100,386,000	2.00
日本	株式	村田製作所	電気機器	12,800	8,375.68	107,208,786	7,787.00	99,673,600	1.99
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	1,600	67,620.00	108,192,000	61,830.00	98,928,000	1.97
日本	株式	ファナック	電気機器	4,600	22,198.27	102,112,065	21,155.00	97,313,000	1.94
日本	株式	富士通	電気機器	5,700	17,763.74	101,253,320	16,565.00	94,420,500	1.88

日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	12,900	7,663.68	98,861,571	7,262.00	93,679,800	1.87
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	7,900	12,619.55	99,694,475	11,810.00	93,299,000	1.86
日本	株式	HOYA	精密機器	6,100	14,741.63	89,923,970	14,855.00	90,615,500	1.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	4,200	24,100.00	101,220,000	21,205.00	89,061,000	1.78
日本	株式	花王	化学	16,200	5,826.74	94,393,196	5,380.00	87,156,000	1.74
日本	株式	中外製薬	医薬品	22,900	3,701.36	84,761,164	3,800.00	87,020,000	1.73
日本	株式	テルモ	精密機器	23,300	4,163.07	96,999,733	3,709.00	86,419,700	1.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,500	57,720.00	86,580,000	53,780.00	80,670,000	1.61
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	37,700	2,304.48	86,879,206	2,120.00	79,924,000	1.59
日本	株式	シマノ	輸送用機器	2,900	26,248.08	76,119,447	26,580.00	77,082,000	1.54
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	10,000	6,423.12	64,231,269	7,641.00	76,410,000	1.52
日本	株式	スズキ	輸送用機器	16,700	4,875.35	81,418,471	4,573.00	76,369,100	1.52
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	15,300	5,484.55	83,913,723	4,819.00	73,730,700	1.47
日本	株式	ユニ・チャーム	化学	15,800	4,652.63	73,511,643	4,320.00	68,256,000	1.36
日本	株式	レーザーテック	電気機器	3,200	26,413.90	84,524,501	20,840.00	66,688,000	1.33
日本	株式	エムスリー	サービス業	15,200	4,480.92	68,110,048	4,269.00	64,888,800	1.29
日本	株式	パンダイナムコホールディングス	その他製品	7,600	7,922.85	60,213,667	8,370.00	63,612,000	1.27

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	建設業	2.59
	食料品	5.32
	繊維製品	0.25
	化学	10.88
	医薬品	5.14
	ガラス・土石製品	0.96
	金属製品	0.20
	機械	6.27
	電気機器	18.17
	輸送用機器	3.81
	精密機器	7.03
	その他製品	4.46
	陸運業	0.83
	情報・通信業	12.87
	卸売業	3.85
	小売業	5.37
	保険業	3.58
	その他金融業	1.00

	不動産業	1.04
	サービス業	5.20
	小計	98.83
合計		98.83

（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 4年 2月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 22年03月限	買建	3	円	56,416,100	56,730,000	1.13

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

日本株オープン「35」マザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	6,694,070,540	98.79
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	81,893,948	1.21
純資産総額		6,775,964,488	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	株式	デクセリアルズ	化学	100,100	2,384.38	238,676,714	3,240.00	324,324,000	4.79
日本	株式	イビデン	電気機器	58,000	5,415.38	314,092,057	5,520.00	320,160,000	4.72
日本	株式	そーせいグループ	医薬品	214,900	1,930.66	414,899,963	1,419.00	304,943,100	4.50

日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	390,300	625.99	244,323,897	712.80	278,205,840	4.11
日本	株式	昭和電工	化学	129,600	3,113.97	403,570,512	2,105.00	272,808,000	4.03
日本	株式	第一三共	医薬品	89,200	3,108.44	277,273,695	2,793.50	249,180,200	3.68
日本	株式	GMOペイメントゲートウェイ	情報・通信業	21,700	11,190.58	242,835,731	10,970.00	238,049,000	3.51
日本	株式	山一電機	電気機器	121,400	1,512.43	183,609,002	1,924.00	233,573,600	3.45
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	107,200	1,792.19	192,122,768	2,138.50	229,247,200	3.38
日本	株式	富士電機	電気機器	38,000	4,925.39	187,164,963	5,860.00	222,680,000	3.29
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	18,300	12,774.29	233,769,603	11,810.00	216,123,000	3.19
日本	株式	三井物産	卸売業	67,400	2,580.88	173,951,312	2,865.50	193,134,700	2.85
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	139,000	1,396.49	194,112,827	1,340.00	186,260,000	2.75
日本	株式	トリケミカル研究所	化学	69,100	3,452.26	238,551,280	2,665.00	184,151,500	2.72
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	3,200	47,309.68	151,390,976	55,770.00	178,464,000	2.63
日本	株式	トレンドーズ	サービス業	218,700	721.79	157,856,706	796.00	174,085,200	2.57
日本	株式	マネーフォワード	情報・通信業	33,600	5,262.43	176,817,859	5,030.00	169,008,000	2.49
日本	株式	日東紡績	ガラス・土石製品	52,500	3,184.98	167,211,835	3,045.00	159,862,500	2.36
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	16,900	9,632.33	162,786,531	9,070.00	153,283,000	2.26
日本	株式	セブテーニ・ホールディングス	サービス業	238,800	586.78	140,124,565	639.00	152,593,200	2.25
日本	株式	ベिकाレント・コンサルティング	サービス業	3,300	34,899.98	115,169,961	45,350.00	149,655,000	2.21
日本	株式	Sansan	情報・通信業	138,800	2,258.20	313,438,160	998.00	138,522,400	2.04
日本	株式	デンソー	輸送用機器	16,200	7,791.23	126,217,926	8,047.00	130,361,400	1.92
日本	株式	JSR	化学	36,000	4,313.25	155,277,000	3,590.00	129,240,000	1.91
日本	株式	スミダコーポレーション	電気機器	142,800	1,114.11	159,094,908	905.00	129,234,000	1.91
日本	株式	資生堂	化学	19,400	7,248.62	140,623,277	6,566.00	127,380,400	1.88
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	24,100	8,537.98	205,765,318	5,125.00	123,512,500	1.82
日本	株式	三菱瓦斯化学	化学	60,400	2,495.54	150,730,805	2,037.00	123,034,800	1.82
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	50,800	2,253.80	114,493,040	2,408.00	122,326,400	1.81
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	16,500	9,305.77	153,545,244	7,262.00	119,823,000	1.77

（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 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	化学	18.90
	医薬品	8.18
	ガラス・土石製品	3.50
	非鉄金属	1.02
	電気機器	28.52
	輸送用機器	6.93
	精密機器	1.45

	電気・ガス業	0.16
	情報・通信業	11.45
	卸売業	2.85
	小売業	1.73
	銀行業	4.11
	保険業	2.96
	サービス業	7.03
	小計	98.79
合計		98.79

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	8,006,747,800	96.27
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	310,422,690	3.73
純資産総額		8,317,170,490	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 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	セブテーニ・ホールディングス	サービス業	448,300	473.05	212,070,640	639.00	286,463,700	3.44

日本	株式	ペイカレント・コンサルティング	サービス業	4,900	48,222.44	236,289,973	45,350.00	222,215,000	2.67
日本	株式	トブコン	精密機器	145,400	1,658.39	241,131,070	1,508.00	219,263,200	2.64
日本	株式	SHOEI	その他製品	47,000	4,837.87	227,379,947	4,550.00	213,850,000	2.57
日本	株式	フルキャストホールディングス	サービス業	86,500	2,515.33	217,576,815	2,366.00	204,659,000	2.46
日本	株式	NECネットエスアイ	情報・通信業	112,000	1,827.87	204,722,529	1,756.00	196,672,000	2.36
日本	株式	扶桑化学工業	化学	41,400	4,785.34	198,113,351	4,615.00	191,061,000	2.30
日本	株式	ネクステージ	小売業	77,800	2,363.00	183,841,400	2,448.00	190,454,400	2.29
日本	株式	前田工織	その他製品	57,100	3,980.00	227,258,000	3,290.00	187,859,000	2.26
日本	株式	新日本電工	鉄鋼	559,000	299.28	167,301,072	335.00	187,265,000	2.25
日本	株式	住友ベークライト	化学	37,500	5,492.85	205,982,073	4,755.00	178,312,500	2.14
日本	株式	日本瓦斯	小売業	96,000	1,575.00	151,200,000	1,729.00	165,984,000	2.00
日本	株式	アイダエンジニアリング	機械	165,500	972.99	161,031,348	993.00	164,341,500	1.98
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	10,800	14,640.14	158,113,512	14,870.00	160,596,000	1.93
日本	株式	RS Technologies	金属製品	28,500	6,350.00	180,975,000	5,530.00	157,605,000	1.89
日本	株式	インフロニア・ホールディングス	建設業	149,000	1,018.51	151,758,626	1,020.00	151,980,000	1.83
日本	株式	ジャパンマテリアル	サービス業	83,000	1,787.13	148,332,112	1,674.00	138,942,000	1.67
日本	株式	インターネットイニシアティブ	情報・通信業	33,800	3,550.52	120,007,792	3,660.00	123,708,000	1.49
日本	株式	松田産業	卸売業	50,000	2,380.67	119,033,931	2,466.00	123,300,000	1.48
日本	株式	電通国際情報サービス	情報・通信業	33,000	3,636.68	120,010,676	3,725.00	122,925,000	1.48
日本	株式	エアトリ	サービス業	39,000	3,449.24	134,520,360	3,085.00	120,315,000	1.45
日本	株式	ビザスク	情報・通信業	35,000	5,161.35	180,647,573	3,410.00	119,350,000	1.43
日本	株式	タクマ	機械	82,000	1,414.02	115,950,215	1,455.00	119,310,000	1.43
日本	株式	ニチアス	ガラス・土石製品	45,800	2,765.81	126,674,330	2,597.00	118,942,600	1.43
日本	株式	三井ハイテック	電気機器	14,200	8,929.30	126,796,101	8,350.00	118,570,000	1.43
日本	株式	トヨタ紡織	輸送用機器	56,500	2,268.36	128,162,717	2,096.00	118,424,000	1.42
日本	株式	マクセル	電気機器	98,000	1,437.34	140,859,542	1,179.00	115,542,000	1.39
日本	株式	SEMITEC	電気機器	15,800	9,802.21	154,874,994	7,210.00	113,918,000	1.37
日本	株式	技研製作所	機械	31,000	4,207.79	130,441,772	3,580.00	110,980,000	1.33
日本	株式	TREホールディングス	サービス業	64,000	1,726.05	110,467,682	1,713.00	109,632,000	1.32

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.79
	建設業	2.22
	食料品	0.40

繊維製品	0.77
化学	7.43
医薬品	3.35
ガラス・土石製品	4.10
鉄鋼	2.25
金属製品	2.37
機械	7.49
電気機器	6.40
輸送用機器	1.42
精密機器	4.94
その他製品	5.27
陸運業	0.37
情報・通信業	12.91
卸売業	2.55
小売業	6.16
その他金融業	2.50
不動産業	2.90
サービス業	19.65
小計	96.27
合計	96.27

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	12,738,950,510	99.26
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	94,368,777	0.74
純資産総額		12,833,319,287	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 4年 2月28日現在
(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	94,550,000	0.74

（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 4年 2月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (％)
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	61,300	3,251.53	199,318,789	3,743.00	229,445,900	1.79
日本	株式	三菱商事	卸売業	58,700	3,613.26	212,098,362	3,871.00	227,227,700	1.77
日本	株式	KDDI	情報・通 信業	59,500	3,503.35	208,449,676	3,756.00	223,482,000	1.74
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	219,100	897.43	196,628,126	1,014.00	222,167,400	1.73
日本	株式	オリエンタルランド	サービス 業	10,200	17,975.17	183,346,734	21,130.00	215,526,000	1.68
日本	株式	三井住友フィナンシャルグ ループ	銀行業	52,100	3,718.79	193,748,959	4,121.00	214,704,100	1.67
日本	株式	セコム	サービス 業	25,400	7,734.35	196,452,490	8,422.00	213,918,800	1.67
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	63,200	3,187.70	201,462,640	3,293.00	208,117,600	1.62
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機 器	95,700	2,011.56	192,506,932	2,138.50	204,654,450	1.59
日本	株式	日本マクドナルドホール ディングス	小売業	39,800	5,086.27	202,433,546	4,940.00	196,612,000	1.53
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	102,400	1,906.15	195,190,372	1,918.50	196,454,400	1.53
日本	株式	中部電力	電気・ガ ス業	169,300	1,164.32	197,120,320	1,153.00	195,202,900	1.52
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	40,700	5,016.43	204,168,701	4,725.00	192,307,500	1.50
日本	株式	日本郵政	サービス 業	201,400	876.24	176,476,276	954.10	192,155,740	1.50
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	54,700	3,137.51	171,621,797	3,501.00	191,504,700	1.49
日本	株式	ソフトバンク	情報・通 信業	129,500	1,552.06	200,992,810	1,450.50	187,839,750	1.46
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	88,000	2,241.43	197,245,840	2,120.00	186,560,000	1.45
日本	株式	村田製作所	電気機器	23,100	8,658.78	200,017,818	7,787.00	179,879,700	1.40
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャ ル・グループ	銀行業	250,300	604.50	151,306,632	712.80	178,413,840	1.39
日本	株式	セブン&アイ・ホールディ ングス	小売業	31,700	4,788.12	151,783,404	5,591.00	177,234,700	1.38
日本	株式	みずほフィナンシャルグ ループ	銀行業	114,200	1,504.82	171,850,639	1,525.00	174,155,000	1.36

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	25,900	6,007.50	155,594,250	6,574.00	170,266,600	1.33
日本	株式	ニトリホールディングス	小売業	9,700	20,751.58	201,290,392	17,245.00	167,276,500	1.30
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	21,600	7,417.62	160,220,592	7,641.00	165,045,600	1.29
日本	株式	HOYA	精密機器	11,000	16,713.64	183,850,118	14,855.00	163,405,000	1.27
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	22,400	8,792.37	196,949,088	7,262.00	162,668,800	1.27
日本	株式	任天堂	その他製品	2,800	50,306.55	140,858,340	58,020.00	162,456,000	1.27
日本	株式	キャノン	電気機器	59,900	2,563.04	153,526,096	2,698.50	161,640,150	1.26
日本	株式	オービック	情報・通信業	8,700	20,970.40	182,442,482	18,310.00	159,297,000	1.24
日本	株式	中外製薬	医薬品	41,600	4,228.85	175,920,160	3,800.00	158,080,000	1.23

（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 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	建設業	1.82
	食料品	5.44
	化学	6.05
	医薬品	9.33
	石油・石炭製品	0.42
	ゴム製品	1.50
	鉄鋼	0.62
	金属製品	0.50
	機械	2.49
	電気機器	12.41
	輸送用機器	2.69
	精密機器	3.26
	その他製品	1.94
	電気・ガス業	4.52
	陸運業	5.34
	情報・通信業	11.92
	卸売業	5.55
	小売業	8.10
	銀行業	6.15
	保険業	2.25
	その他金融業	0.31
	不動産業	0.26
	サービス業	6.39
小計		99.26
合計		99.26

（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 4年 2月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 22年03月限	買建	5	円	99,852,750	94,550,000	0.74

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

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	3,860,281,520	98.87
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	44,197,057	1.13
純資産総額		3,904,478,577	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 4年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	14,000	13,594.86	190,328,079	11,810.00	165,340,000	4.23
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	76,600	2,050.47	157,066,314	2,138.50	163,809,100	4.20
日本	株式	第一三共	医薬品	44,500	2,855.84	127,084,880	2,793.50	124,310,750	3.18
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	24,400	6,953.75	169,671,585	4,819.00	117,583,600	3.01
日本	株式	ウエストホールディングス	建設業	24,000	4,245.02	101,880,491	4,280.00	102,720,000	2.63
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	72,800	1,395.78	101,612,784	1,340.00	97,552,000	2.50
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	25,300	3,322.11	84,049,383	3,743.00	94,697,900	2.43
日本	株式	信越化学工業	化学	5,000	20,206.62	101,033,117	17,670.00	88,350,000	2.26
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	12,600	6,105.78	76,932,828	6,574.00	82,832,400	2.12
日本	株式	富士通	電気機器	4,700	19,475.30	91,533,921	16,565.00	77,855,500	1.99

日本	株式	東芝	電気機器	17,000	4,983.87	84,725,892	4,577.00	77,809,000	1.99
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	23,200	3,225.87	74,840,184	3,293.00	76,397,600	1.96
日本	株式	京成電鉄	陸運業	23,200	3,615.61	83,882,382	3,220.00	74,704,000	1.91
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	104,800	640.24	67,097,152	712.80	74,701,440	1.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	13,200	6,599.98	87,119,739	5,650.00	74,580,000	1.91
日本	株式	三菱商事	卸売業	17,000	3,658.51	62,194,670	3,871.00	65,807,000	1.69
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	9,000	8,828.77	79,458,987	7,262.00	65,358,000	1.67
日本	株式	エービーシー・マート	小売業	13,000	5,451.86	70,874,244	4,980.00	64,740,000	1.66
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,100	58,527.53	64,380,290	55,770.00	61,347,000	1.57
日本	株式	イビデン	電気機器	10,900	6,657.43	72,565,991	5,520.00	60,168,000	1.54
日本	株式	味の素	食料品	18,000	3,481.48	62,666,640	3,339.00	60,102,000	1.54
日本	株式	日本発條	金属製品	65,400	987.42	64,577,870	914.00	59,775,600	1.53
日本	株式	日鉄ソリューションズ	情報・通信業	16,300	3,686.16	60,084,408	3,635.00	59,250,500	1.52
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	2,800	18,142.59	50,799,252	21,130.00	59,164,000	1.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	11,500	6,129.57	70,490,055	5,125.00	58,937,500	1.51
日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	25,000	2,348.20	58,705,189	2,348.00	58,700,000	1.50
日本	株式	KDDI	情報・通信業	15,500	3,738.57	57,947,975	3,756.00	58,218,000	1.49
日本	株式	INPEX	鉱業	48,600	1,108.59	53,877,750	1,185.00	57,591,000	1.47
日本	株式	LIXIL	金属製品	22,500	2,881.67	64,837,575	2,555.00	57,487,500	1.47
日本	株式	東海カーボン	ガラス・土石製品	52,100	1,441.69	75,112,159	1,101.00	57,362,100	1.47

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	鉱業	1.47
	建設業	5.82
	食料品	2.49
	繊維製品	1.23
	化学	7.91
	医薬品	5.60
	ガラス・土石製品	1.47
	鉄鋼	1.24
	非鉄金属	1.00
	金属製品	3.00
	機械	4.28
	電気機器	18.24
	輸送用機器	4.95
	精密機器	1.43

その他製品	1.47
電気・ガス業	1.50
陸運業	2.92
倉庫・運輸関連業	0.50
情報・通信業	8.51
卸売業	4.11
小売業	4.14
銀行業	3.36
証券、商品先物取引業	0.97
保険業	3.52
その他金融業	1.20
不動産業	0.53
サービス業	6.00
小計	98.87
合計	98.87

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本株E S Gアクティブマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	1,237,692,100	96.78
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	41,160,272	3.22
純資産総額		1,278,852,372	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 3 0 銘柄

令和 4年 2月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	凸版印刷	その他製 品	31,300	1,804.25	56,473,292	2,257.00	70,644,100	5.52
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	5,200	14,260.00	74,152,000	11,810.00	61,412,000	4.80
日本	株式	日立製作所	電気機器	10,400	7,300.00	75,920,000	5,650.00	58,760,000	4.59
日本	株式	カブコン	情報・通 信業	20,100	2,917.91	58,650,026	2,775.00	55,777,500	4.36
日本	株式	セブン&アイ・ホールディ ングス	小売業	9,900	4,817.00	47,688,300	5,591.00	55,350,900	4.33
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機 器	25,300	2,097.30	53,061,777	2,138.50	54,104,050	4.23
日本	株式	富士通	電気機器	3,200	19,556.16	62,579,719	16,565.00	53,008,000	4.14
日本	株式	パンダイナムコホールディ ングス	その他製 品	6,100	9,250.27	56,426,707	8,370.00	51,057,000	3.99
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	10,300	4,857.00	50,027,100	4,725.00	48,667,500	3.81
日本	株式	第一三共	医薬品	17,300	3,035.00	52,505,500	2,793.50	48,327,550	3.78
日本	株式	東芝	電気機器	10,500	4,613.00	48,436,500	4,577.00	48,058,500	3.76
日本	株式	ディスコ	機械	1,400	32,200.00	45,080,000	32,150.00	45,010,000	3.52
日本	株式	三菱商事	卸売業	11,500	3,619.71	41,626,680	3,871.00	44,516,500	3.48
日本	株式	オリエンタルランド	サービス 業	2,100	19,260.00	40,446,000	21,130.00	44,373,000	3.47
日本	株式	日本瓦斯	小売業	24,100	1,467.00	35,354,700	1,729.00	41,668,900	3.26
日本	株式	リクルートホールディング ス	サービス 業	8,400	6,947.13	58,355,943	4,819.00	40,479,600	3.17
日本	株式	島津製作所	精密機器	9,800	4,825.00	47,285,000	4,105.00	40,229,000	3.15
日本	株式	ヤマハ	その他製 品	7,300	6,340.00	46,282,000	5,360.00	39,128,000	3.06
日本	株式	丸井グループ	小売業	15,700	2,318.00	36,392,600	2,255.00	35,403,500	2.77
日本	株式	リコー	電気機器	36,100	1,092.17	39,427,337	979.00	35,341,900	2.76
日本	株式	京セラ	電気機器	4,800	7,085.00	34,008,000	6,579.00	31,579,200	2.47
日本	株式	積水ハウス	建設業	13,200	2,367.50	31,251,000	2,346.00	30,967,200	2.42
日本	株式	NIPPON EXPRE SSホールディン	陸運業	4,400	6,940.00	30,536,000	6,980.00	30,712,000	2.40
日本	株式	南都銀行	銀行業	13,200	1,865.00	24,618,000	2,131.00	28,129,200	2.20
日本	株式	栗田工業	機械	5,600	5,550.00	31,080,000	4,700.00	26,320,000	2.06
日本	株式	ニフコ	化学	6,600	3,435.00	22,671,000	3,270.00	21,582,000	1.69
日本	株式	キトー	機械	10,700	1,867.00	19,976,900	1,686.00	18,040,200	1.41
日本	株式	オムロン	電気機器	2,300	11,115.00	25,564,500	7,760.00	17,848,000	1.40
日本	株式	セコム	サービス 業	1,800	8,045.00	14,481,000	8,422.00	15,159,600	1.19
日本	株式	カゴメ	食料品	3,700	2,892.00	10,700,400	3,070.00	11,359,000	0.89

(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 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	建設業	2.42

食料品	0.89
繊維製品	0.78
パルプ・紙	0.57
化学	1.69
医薬品	4.30
ゴム製品	3.81
機械	6.99
電気機器	24.78
輸送用機器	4.23
精密機器	3.15
その他製品	12.58
陸運業	2.40
情報・通信業	4.36
卸売業	3.48
小売業	10.35
銀行業	2.20
サービス業	7.82
小計	96.78
合計	96.78

（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

該当事項はありません。

ジャパンＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	1,826,618,540	97.40
投資証券	日本	30,764,200	1.64
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	17,979,569	0.96
純資産総額		1,875,362,309	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 4年 2月28日現在
(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	18,910,000	1.01

（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 4年 2月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	71,400	2,221.12	158,588,360	2,138.50	152,688,900	8.14
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	8,500	12,578.66	106,918,648	11,810.00	100,385,000	5.35
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	57,704.13	75,015,370	53,780.00	69,914,000	3.73
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,000	56,410.00	56,410,000	55,770.00	55,770,000	2.97
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	9,100	5,486.19	49,924,418	4,819.00	43,852,900	2.34
日本	株式	信越化学工業	化学	2,400	18,039.16	43,294,000	17,670.00	42,408,000	2.26
日本	株式	KDDI	情報・通信業	10,900	3,566.46	38,874,520	3,756.00	40,940,400	2.18
日本	株式	任天堂	その他製品	700	56,300.00	39,410,000	58,020.00	40,614,000	2.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	6,500	6,105.37	39,684,907	5,650.00	36,725,000	1.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	8,800	4,147.56	36,498,550	4,121.00	36,264,800	1.93
日本	株式	ダイキン工業	機械	1,700	23,924.11	40,671,000	21,205.00	36,048,500	1.92
日本	株式	第一三共	医薬品	11,800	2,598.57	30,663,209	2,793.50	32,963,300	1.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,900	8,370.87	32,646,399	7,787.00	30,369,300	1.62
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	8,000	3,635.96	29,087,741	3,743.00	29,944,000	1.60
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	19,300	1,443.33	27,856,358	1,450.50	27,994,650	1.49
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,200	6,788.19	28,510,422	6,574.00	27,610,800	1.47
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,300	18,500.00	24,050,000	21,130.00	27,469,000	1.46
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	8,000	3,223.55	25,788,400	3,293.00	26,344,000	1.40
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	400	67,620.00	27,048,000	61,830.00	24,732,000	1.32
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	12,500	1,886.20	23,577,517	1,918.50	23,981,250	1.28
日本	株式	デンソー	輸送用機器	2,900	8,506.73	24,669,540	8,047.00	23,336,300	1.24
日本	株式	富士通	電気機器	1,300	17,850.00	23,205,000	16,565.00	21,534,500	1.15
日本	株式	オリックス	その他金融業	8,200	2,348.25	19,255,655	2,283.00	18,720,600	1.00

日本	株式	パナソニック	電気機器	14,900	1,262.66	18,813,744	1,190.00	17,731,000	0.95
日本	株式	資生堂	化学	2,700	5,875.63	15,864,203	6,566.00	17,728,200	0.95
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	2,400	7,673.22	18,415,736	7,262.00	17,428,800	0.93
日本	株式	花王	化学	3,200	5,821.21	18,627,900	5,380.00	17,216,000	0.92
日本	株式	中外製薬	医薬品	4,500	3,703.52	16,665,857	3,800.00	17,100,000	0.91
日本	株式	三菱電機	電気機器	12,300	1,447.00	17,798,132	1,381.50	16,992,450	0.91
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	6,800	2,530.52	17,207,567	2,408.00	16,374,400	0.87

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.04
	鉱業	0.44
	建設業	2.47
	食料品	3.08
	繊維製品	0.45
	パルプ・紙	0.10
	化学	8.50
	医薬品	6.12
	石油・石炭製品	0.50
	ガラス・土石製品	0.58
	鉄鋼	0.15
	非鉄金属	0.73
	機械	5.38
	電気機器	22.61
	輸送用機器	9.88
	精密機器	1.38
	その他製品	2.88
	電気・ガス業	1.18
	陸運業	3.77
	海運業	0.63
	情報・通信業	6.52
	卸売業	2.07
	小売業	2.37
	銀行業	3.15
	証券、商品先物取引業	0.58
	保険業	3.86
	その他金融業	1.09
	不動産業	2.00
	サービス業	4.91

小計		97.40
投資証券	—	1.64
合計		99.04

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 4年 2月28日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 22年03月限	買建	1	円	18,910,000	18,910,000	1.01

（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。

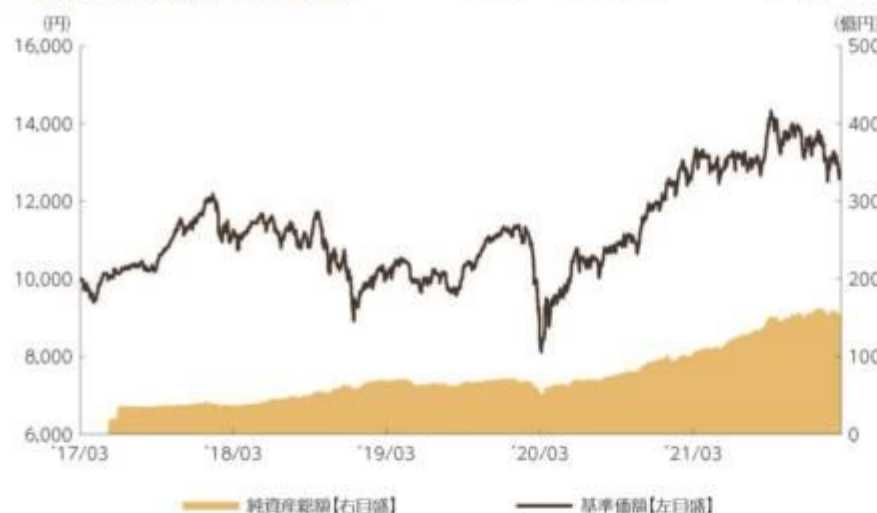
《参考情報》



運用実績

2022年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年3月13日(設定日)～2022年2月28日



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

■基準価額・純資産

基準価額	12,809円
純資産総額	154.3億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
2019年2月	0円
2018年2月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万円当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位銘柄	比率
1 TOPIXマザーファンド	36.7%
2 日本株インカム・マザーファンド	14.6%
3 日本株式最小分散インデックスマザーファンド	10.8%
4 日本・小型株・ファンド・マザーファンド	7.5%
5 JPX日経400インデックスマザーファンド	5.9%
6 日本株オープン[35]マザーファンド	4.9%
7 ジャパン・アクティブ・マザーファンド	4.9%
8 日本株ESGアクティブマザーファンド	4.9%
9 JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	3.9%
10 ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	3.9%

・比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2017年は設定日から年末までの、2022年は年初から2月28日までの収益率を表示
- ・ファンド内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。

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

⑧申込受付時間

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

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

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

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

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

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

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

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

⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の換金の制限等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2027年2月5日まで（2017年3月13日設定）

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

(4) 【計算期間】

毎年2月6日から翌年2月5日まで

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

(5) 【その他】

① ファンドの償還条件等

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

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

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

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

② 信託約款の変更等

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

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

③ ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の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発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権

の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤関係法人との契約の更改

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

⑥運用報告書

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

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨信託事務の再信託

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

⑩公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日

（原則として決算日から起算して５営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に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3年2月6日から令和4年2月7日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	241,095,309	472,706,915
親投資信託受益証券	9,600,851,907	15,245,821,397
流動資産合計	9,841,947,216	15,718,528,312
資産合計	9,841,947,216	15,718,528,312
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,475,958	24,457,634
未払受託者報酬	1,886,336	3,366,243
未払委託者報酬	17,920,181	31,979,262
未払利息	44	211
その他未払費用	146,133	260,820
流動負債合計	33,428,652	60,064,170
負債合計	33,428,652	60,064,170
純資産の部		
元本等		
元本	7,772,051,889	12,005,271,528
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,036,466,675	3,653,192,614
（分配準備積立金）	1,569,454,742	1,488,651,718
元本等合計	9,808,518,564	15,658,464,142
純資産合計	9,808,518,564	15,658,464,142
負債純資産合計	9,841,947,216	15,718,528,312

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 令和2年2月6日 至 令和3年2月5日	第5期 自 令和3年2月6日 至 令和4年2月7日
営業収益		
受取利息	1,446	1,057
有価証券売買等損益	1,352,336,779	313,499,490
営業収益合計	1,352,338,225	313,500,547
営業費用		
支払利息	61,297	69,149
受託者報酬	3,298,548	5,842,784
委託者報酬	31,336,156	55,506,254
その他費用	255,521	452,689
営業費用合計	34,951,522	61,870,876
営業利益又は営業損失（△）	1,317,386,703	251,629,671
経常利益又は経常損失（△）	1,317,386,703	251,629,671
当期純利益又は当期純損失（△）	1,317,386,703	251,629,671
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（△）	△20,715,505	98,530,869
期首剰余金又は期首欠損金（△）	678,460,693	2,036,466,675
剰余金増加額又は欠損金減少額	281,002,494	2,015,019,421
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	281,002,494	2,015,019,421
剰余金減少額又は欠損金増加額	261,098,720	551,392,284
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	261,098,720	551,392,284
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,036,466,675	3,653,192,614

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月5日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和 3年 2月 6日から令和 4年 2月 7日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首元本額	6,056,150,335円	7,772,051,889円
期中追加設定元本額	5,016,855,517円	6,234,909,350円
期中一部解約元本額	3,300,953,963円	2,001,689,711円
2. 受益権の総数	7,772,051,889口	12,005,271,528口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日			第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7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	159,042,229円	費用控除後の配当等収益額	A	210,303,165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	1,115,823,544円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	1,099,129,734円	収益調整金額	C	2,852,659,089円
分配準備積立金額	D	294,588,969円	分配準備積立金額	D	1,278,348,553円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,668,584,476円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,341,310,807円
当ファンドの期末残存口数	F	7,772,051,889口	当ファンドの期末残存口数	F	12,005,271,528口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,433円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,616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

第4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日	第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日

（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4期 自 令和 2年 2月 6日 至 令和 3年 2月 5日	第5期 自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引	（1）有価証券 同左 （2）デリバティブ取引

区分	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7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	デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価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 (3) 上記以外の金融商品 同左 同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7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	1,327,444,043	316,161,729
合計	1,327,444,043	316,161,729

（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4期 [令和 3年 2月 5日現在]	第5期 [令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	1.2620円	1.3043円
(1万口当たり純資産額)	(12,620円)	(13,043円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	J P X日経４００インデックスマザーファンド	489,542,764	916,277,191	
	J A P A N クオリティ１５０インデックスマザーファンド	380,283,599	605,981,915	
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	1,232,794,812	1,715,433,980	
	ジャパンＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	462,595,753	608,220,896	
	日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド	502,428,387	765,650,618	
	日本・小型株・ファンド・マザーファンド	142,912,866	1,102,758,547	
	T O P I Xマザーファンド	2,583,222,223	5,731,653,468	
	日本株オープン「３５」マザーファンド	176,356,791	720,082,413	
	ジャパン・アクティブ・マザーファンド	193,578,277	756,368,401	
	日本株インカム・マザーファンド	932,341,079	2,323,393,968	
合計		7,096,056,551	15,245,821,397	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

T O P I Xマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 4年 2月 7日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	57,334,176,830
株式	712,718,003,520
派生商品評価勘定	27,716,950
未収配当金	1,104,763,443
未収利息	1,036,412
前払金	17,680,000
その他未収収益	18,488,110
差入委託証拠金	310,620,000
流動資産合計	771,532,485,265
資産合計	
771,532,485,265	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,636,150
未払解約金	215,678,175
未払利息	25,619
受入担保金	51,904,949,158
流動負債合計	52,191,289,102
負債合計	
52,191,289,102	
純資産の部	
元本等	
元本	324,203,219,846
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	395,137,976,317
元本等合計	719,341,196,163
純資産合計	719,341,196,163
負債純資産合計	771,532,485,265

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	235,474,154,096円

	[令和 4年 2月 7日現在]
期中追加設定元本額	345,305,942,307円
期中一部解約元本額	256,576,876,557円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,571,263,448円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	977,999,734円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,734,588,094円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	3,393,133,233円
三菱UFJ トピックスオープン（確定拠出年金）	3,566,673,007円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	7,575,148,933円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	38,187,920,533円
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	39,427,578,858円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	117,625,263円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	283,690,589円
ファンド・マネジャー（国内株式）	862,560,093円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,524,023,716円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,174,656,494円
eMAXIS バランス（波乗り型）	131,235,495円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	2,500,498,739円
コアバランス	512,264円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	506,822,859円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	583,376,837円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	431,855,508円
eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）	20,453,717,275円
国内株式セレクション（ラップ向け）	2,583,222,223円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	7,277,665,357円
つみたて日本株式（TOPIX）	6,193,404,809円
つみたて8資産均等バランス	3,300,342,038円
つみたて4資産均等バランス	1,009,245,300円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,004,079円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,645,509円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,036,539円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	392,105,510円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	326,351,887円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	186,337,826円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	289,798,325円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	812,655,927円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	1,292,529,268円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	704,096,935円

	[令和 4年 2月 7日現在]
三菱UFJ DC年金インデックス（国内株式）	1,102,088,752円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	200,457,974円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	102,650,657円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	16,228,048,831円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	41,676,728円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3,532,715,152円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	58,625,317円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	336,534,606円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	195,150,673円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	1,110,514円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	3,239,023,944円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	178,547円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	550,366円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	124,757,392円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	20,539,362円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	124,717,775円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	540,748,188円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	132,705,403円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	159,400,281円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	512,160,328円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	429,185,049円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	829,640,784円
三菱UFJ トピックスオープン	1,035,775,432円
三菱UFJ DCトピックスオープン	9,037,118,105円
三菱UFJ トピックスオープンVA（適格機関投資家限定）	82,747,452円
三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA（適格機関投資家限定）	7,076,469,811円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）VA（適格機関投資家限定）	61,311円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	22,262,300円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	6,567,088,721円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	146,915,282円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	1,971,624,126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）	33,944,357,474円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	314,540,342円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	4,280,421円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	1,377,807円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	312,135,072円

	[令和 4年 2月 7日現在]
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	627,385,641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 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）	691,728,999円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	81,268,469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）	32,592,616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）	2,850,847,771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）	633,448,179円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	41,614円
日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	194,256,946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）	137,983,540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）	127,188,830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）	43,640,133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）	125,237,116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）	42,011,017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）	41,969,101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）	40,655,690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）	39,905,941円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	40,141,981円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）	518,181,691円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07（適格機関投資家限定）	39,760,908円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09（適格機関投資家限定）	38,386,516円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定）	38,804,680円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定）	41,396,338円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,429,691,245円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	3,598,697円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	12,179,021円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	5,345,349円

	[令和 4年 2月 7日現在]
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	7,551,391円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	671,837,633円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	139,914,090円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	7,960,148円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	75,229,200円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	5,700,934円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	46,259,813円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,631,422,462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）	429,350,652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）	1,758,894,637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）	1,584,580,367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）	1,373,426,628円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	52,771,974,425円
合計	324,203,219,846円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	49,403,184,740円
3. 受益権の総数	324,203,219,846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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、新株予約権証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△25,988,146,079
合計	△25,988,146,079

(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 4年 2月 7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	6,656,130,000	—	6,613,400,000	△42,730,000
合計		6,656,130,000	—	6,613,400,000	△42,730,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	2.2188円
(1万口当たり純資産額)	(22,188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	12,900	3,170.00	40,893,000	貸付有価証券 1,700株
1332	日本水産	367,600	520.00	191,152,000	
1333	マルハニチロ	57,500	2,499.00	143,692,500	貸付有価証券 8,700株
1375	雪国まいたけ	26,800	1,207.00	32,347,600	貸付有価証券 5,100株
1376	カネコ種苗	10,400	1,512.00	15,724,800	貸付有価証券 2,000株
1377	サカタのタネ	43,800	3,275.00	143,445,000	貸付有価証券 7,200株
1379	ホクト	30,800	1,960.00	60,368,000	貸付有価証券 1,700株
1384	ホクリヨウ	5,000	695.00	3,475,000	

1514	住石ホールディングス	64,300	136.00	8,744,800	貸付有価証券 12,200株
1515	日鉄鉱業	8,400	6,190.00	51,996,000	貸付有価証券 1,400株
1518	三井松島ホールディングス	15,400	1,523.00	23,454,200	貸付有価証券 300株
1605	I N P E X	1,474,800	1,174.00	1,731,415,200	貸付有価証券 340,400株
1662	石油資源開発	43,200	2,849.00	123,076,800	
1663	K&Oエナジーグループ	16,700	1,540.00	25,718,000	
1413	ヒノキヤグループ	8,000	2,065.00	16,520,000	
1414	ショーボンドホールディングス	52,500	5,050.00	265,125,000	貸付有価証券 11,800株
1417	ミライト・ホールディングス	118,400	1,883.00	222,947,200	貸付有価証券 8,300株
1419	タマホーム	22,300	2,456.00	54,768,800	
1420	サンヨーホームズ	4,200	731.00	3,070,200	貸付有価証券 900株
1429	日本アクア	14,600	626.00	9,139,600	貸付有価証券 2,800株
1430	ファーストコーポレーション	9,000	696.00	6,264,000	貸付有価証券 1,900株
1433	ベステラ	7,300	1,256.00	9,168,800	貸付有価証券 1,600株
1435	R o b o t H o m e	61,300	223.00	13,669,900	貸付有価証券 13,200株
1446	キャンディル	6,300	490.00	3,087,000	貸付有価証券 1,000株
1448	スペースバリューホールディングス	9,000	1,145.00	10,305,000	
1712	ダイセキ環境ソリューション	7,100	1,168.00	8,292,800	貸付有価証券 1,200株
1716	第一カッター興業	9,100	1,385.00	12,603,500	貸付有価証券 1,700株
1719	安藤・間	182,600	873.00	159,409,800	
1720	東急建設	107,700	686.00	73,882,200	
1721	コムシスホールディングス	118,500	2,728.00	323,268,000	
1726	ビーアールホールディングス	50,000	357.00	17,850,000	貸付有価証券 7,700株
1762	高松コンストラクショングループ	22,900	2,005.00	45,914,500	貸付有価証券 3,800株
1766	東建コーポレーション	10,200	9,210.00	93,942,000	貸付有価証券 1,800株
1768	ソネック	3,800	1,029.00	3,910,200	
1780	ヤマウラ	17,700	989.00	17,505,300	貸付有価証券 2,500株
1786	オリエンタル白石	123,600	241.00	29,787,600	貸付有価証券 21,900株
1801	大成建設	245,300	3,815.00	935,819,500	貸付有価証券 46,400株

1802	大林組	848,900	942.00	799,663,800	貸付有価証券 139,300株
1803	清水建設	795,200	783.00	622,641,600	貸付有価証券 174,000株
1805	飛鳥建設	22,700	1,070.00	24,289,000	貸付有価証券 1,900株
1808	長谷工コーポレーション	252,800	1,458.00	368,582,400	貸付有価証券 54,200株
1810	松井建設	33,400	711.00	23,747,400	貸付有価証券 5,500株
1811	銭高組	3,700	4,020.00	14,874,000	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	622,000	1,379.00	857,738,000	
1813	不動テトラ	18,000	1,559.00	28,062,000	
1814	大末建設	8,900	1,336.00	11,890,400	貸付有価証券 1,600株
1815	鉄建建設	18,400	1,825.00	33,580,000	貸付有価証券 600株
1820	西松建設	51,400	3,735.00	191,979,000	貸付有価証券 13,900株
1821	三井住友建設	191,400	428.00	81,919,200	
1822	大豊建設	12,400	3,690.00	45,756,000	貸付有価証券 400株
1826	佐田建設	18,300	468.00	8,564,400	
1827	ナカノフドー建設	20,300	343.00	6,962,900	貸付有価証券 3,800株
1833	奥村組	50,000	3,195.00	159,750,000	貸付有価証券 7,600株
1835	東鉄工業	39,400	2,441.00	96,175,400	貸付有価証券 4,300株
1847	イチケン	6,100	1,884.00	11,492,400	貸付有価証券 600株
1848	富士ピー・エス	10,900	490.00	5,341,000	貸付有価証券 2,000株
1852	浅沼組	9,500	5,410.00	51,395,000	
1860	戸田建設	352,500	744.00	262,260,000	貸付有価証券 79,600株
1861	熊谷組	43,300	2,972.00	128,687,600	
1866	北野建設	5,200	2,136.00	11,107,200	貸付有価証券 800株
1867	植木組	7,500	1,482.00	11,115,000	
1870	矢作建設工業	37,500	763.00	28,612,500	貸付有価証券 6,200株
1871	ピーエス三菱	27,900	620.00	17,298,000	貸付有価証券 7,300株
1873	日本ハウスホールディングス	57,900	453.00	26,228,700	貸付有価証券 13,700株
1878	大東建託	86,900	13,480.00	1,171,412,000	
1879	新日本建設	36,100	754.00	27,219,400	貸付有価証券 5,900株

1881	N I P P O	20,100	3,985.00	80,098,500	
1882	東亜道路工業	4,400	5,020.00	22,088,000	
1884	日本道路	8,200	8,300.00	68,060,000	
1885	東亜建設工業	20,800	2,429.00	50,523,200	貸付有価証券 2,100株
1887	日本国土開発	82,600	530.00	43,778,000	貸付有価証券 15,500株
1888	若築建設	14,200	1,716.00	24,367,200	貸付有価証券 2,500株
1890	東洋建設	95,200	578.00	55,025,600	貸付有価証券 11,500株
1893	五洋建設	336,500	639.00	215,023,500	
1898	世紀東急工業	40,800	815.00	33,252,000	貸付有価証券 3,400株
1899	福田組	9,100	4,390.00	39,949,000	貸付有価証券 100株
1911	住友林業	217,200	2,039.00	442,870,800	貸付有価証券 8,000株
1914	日本基礎技術	23,300	628.00	14,632,400	貸付有価証券 4,700株
1921	巴コーポレーション	37,700	486.00	18,322,200	貸付有価証券 6,200株
1925	大和ハウス工業	783,900	3,389.00	2,656,637,100	貸付有価証券 25,100株
1926	ライト工業	53,400	1,851.00	98,843,400	貸付有価証券 13,600株
1928	積水ハウス	920,700	2,329.00	2,144,310,300	
1929	日特建設	17,500	714.00	12,495,000	貸付有価証券 3,600株
1930	北陸電気工事	17,600	823.00	14,484,800	貸付有価証券 2,800株
1934	ユアテック	48,600	697.00	33,874,200	
1938	日本リーテック	17,800	1,403.00	24,973,400	貸付有価証券 4,200株
1939	四電工	9,200	1,608.00	14,793,600	貸付有価証券 1,600株
1941	中電工	39,100	2,123.00	83,009,300	貸付有価証券 8,600株
1942	関電工	138,000	870.00	120,060,000	
1944	きんでん	189,600	1,615.00	306,204,000	貸付有価証券 24,300株
1945	東京エネシス	28,200	970.00	27,354,000	
1946	トーエネック	8,500	3,215.00	27,327,500	
1949	住友電設	21,000	2,225.00	46,725,000	
1950	日本電設工業	46,500	1,462.00	67,983,000	貸付有価証券 11,200株
1951	エクシオグループ	127,600	2,327.00	296,925,200	
1952	新日本空調	22,400	2,032.00	45,516,800	貸付有価証券 6,500株

1959	九電工	65,500	3,075.00	201,412,500	
1961	三機工業	55,200	1,418.00	78,273,600	
1963	日揮ホールディングス	261,500	1,134.00	296,541,000	貸付有価証券 42,700株
1964	中外炉工業	8,500	1,609.00	13,676,500	貸付有価証券 100株
1967	ヤマト	24,900	709.00	17,654,100	貸付有価証券 4,400株
1968	太平電業	18,800	2,769.00	52,057,200	貸付有価証券 3,300株
1969	高砂熱学工業	76,700	1,897.00	145,499,900	貸付有価証券 12,000株
1972	三晃金属工業	3,300	2,492.00	8,223,600	
1975	朝日工業社	5,700	2,892.00	16,484,400	貸付有価証券 900株
1976	明星工業	54,900	702.00	38,539,800	貸付有価証券 9,000株
1979	大気社	41,300	2,822.00	116,548,600	貸付有価証券 11,200株
1980	ダイダン	18,800	2,258.00	42,450,400	貸付有価証券 3,300株
1982	日比谷総合設備	27,300	1,890.00	51,597,000	貸付有価証券 3,600株
3267	フィル・カンパニー	4,900	1,131.00	5,541,900	
5074	テスホールディングス	17,700	1,331.00	23,558,700	貸付有価証券 1,100株
5076	インフロニア・ホールディングス	362,000	1,054.00	381,548,000	貸付有価証券 73,900株
6330	東洋エンジニアリング	35,600	668.00	23,780,800	貸付有価証券 5,800株
6379	レイズネクスト	41,000	1,129.00	46,289,000	貸付有価証券 6,100株
2001	ニッポン	79,500	1,677.00	133,321,500	
2002	日清製粉グループ本社	307,000	1,636.00	502,252,000	貸付有価証券 74,100株
2003	日東富士製粉	3,900	3,995.00	15,580,500	
2004	昭和産業	25,700	2,670.00	68,619,000	
2009	鳥越製粉	24,100	647.00	15,592,700	貸付有価証券 4,000株
2053	中部飼料	30,600	1,017.00	31,120,200	
2060	フィード・ワン	36,500	718.00	26,207,000	貸付有価証券 5,900株
2107	東洋精糖	4,600	1,025.00	4,715,000	
2108	日本甜菜製糖	14,200	1,696.00	24,083,200	
2109	DM三井製糖ホールディングス	24,700	2,013.00	49,721,100	
2112	塩水港精糖	32,400	214.00	6,933,600	貸付有価証券 5,400株
2117	日新製糖	12,900	1,730.00	22,317,000	貸付有価証券 2,100株

2201	森永製菓	63,800	3,690.00	235,422,000	貸付有価証券 11,600株
2204	中村屋	6,500	3,350.00	21,775,000	貸付有価証券 700株
2206	江崎グリコ	74,800	3,780.00	282,744,000	貸付有価証券 1,800株
2207	名糖産業	12,000	1,661.00	19,932,000	
2209	井村屋グループ	15,400	2,229.00	34,326,600	貸付有価証券 1,900株
2211	不二家	15,200	2,279.00	34,640,800	
2212	山崎製パン	203,600	1,625.00	330,850,000	貸付有価証券 26,000株
2215	第一屋製パン	5,200	531.00	2,761,200	貸付有価証券 800株
2217	モロゾフ	8,600	2,750.00	23,650,000	貸付有価証券 600株
2220	亀田製菓	15,500	3,915.00	60,682,500	貸付有価証券 2,500株
2222	寿スピリッツ	26,200	5,480.00	143,576,000	
2229	カルビー	123,800	2,449.00	303,186,200	貸付有価証券 6,500株
2264	森永乳業	50,300	5,460.00	274,638,000	
2266	六甲バター	19,800	1,480.00	29,304,000	貸付有価証券 3,900株
2267	ヤクルト本社	201,300	5,790.00	1,165,527,000	貸付有価証券 30,700株
2269	明治ホールディングス	179,600	7,220.00	1,296,712,000	貸付有価証券 29,500株
2270	雪印メグミルク	65,400	2,062.00	134,854,800	貸付有価証券 10,700株
2281	プリマハム	34,000	2,409.00	81,906,000	貸付有価証券 3,600株
2282	日本ハム	103,800	4,210.00	436,998,000	
2286	林兼産業	8,200	505.00	4,141,000	貸付有価証券 1,500株
2288	丸大食品	26,700	1,524.00	40,690,800	貸付有価証券 4,800株
2292	S F o o d s	24,400	3,265.00	79,666,000	貸付有価証券 1,900株
2294	柿安本店	9,400	2,611.00	24,543,400	貸付有価証券 2,200株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	174,900	672.00	117,532,800	貸付有価証券 28,000株
2501	サッポロホールディングス	92,700	2,235.00	207,184,500	貸付有価証券 15,200株
2502	アサヒグループホールディングス	639,200	4,770.00	3,048,984,000	貸付有価証券 7,300株
2503	キリンホールディングス	998,600	1,882.00	1,879,365,200	
2531	宝ホールディングス	184,600	1,114.00	205,644,400	
2533	オエノンホールディングス	77,200	338.00	26,093,600	

2540	養命酒製造	8,300	1,761.00	14,616,300	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	190,700	1,367.00	260,686,900	
2587	サントリー食品インターナショナル	181,800	4,490.00	816,282,000	
2590	ダイドーグループホールディングス	13,900	4,850.00	67,415,000	貸付有価証券 1,200株
2593	伊藤園	82,500	6,220.00	513,150,000	貸付有価証券 18,000株
2594	キーコーヒー	26,700	2,063.00	55,082,100	貸付有価証券 1,600株
2597	ユニカフェ	8,200	958.00	7,855,600	貸付有価証券 1,100株
2599	ジャパンフーズ	3,900	1,206.00	4,703,400	
2602	日清オイリオグループ	34,000	3,010.00	102,340,000	貸付有価証券 2,300株
2607	不二製油グループ本社	58,900	2,330.00	137,237,000	
2612	かどや製油	3,000	4,010.00	12,030,000	貸付有価証券 200株
2613	Jーオイルミルズ	25,300	1,692.00	42,807,600	貸付有価証券 6,200株
2801	キッコーマン	195,500	8,770.00	1,714,535,000	貸付有価証券 33,000株
2802	味の素	600,000	3,239.00	1,943,400,000	
2804	ブルドックソース	11,400	1,957.00	22,309,800	
2809	キューピー	142,700	2,397.00	342,051,900	貸付有価証券 15,000株
2810	ハウス食品グループ本社	101,600	2,921.00	296,773,600	貸付有価証券 7,900株
2811	カゴメ	103,100	2,890.00	297,959,000	貸付有価証券 19,400株
2812	焼津水産化学工業	13,200	907.00	11,972,400	
2815	アリアケジャパン	24,800	5,750.00	142,600,000	貸付有価証券 6,000株
2818	ピエトロ	3,500	1,794.00	6,279,000	
2819	エバラ食品工業	5,900	2,830.00	16,697,000	
2820	やまみ	2,300	1,771.00	4,073,300	貸付有価証券 200株
2871	ニチレイ	123,900	2,616.00	324,122,400	
2875	東洋水産	130,500	4,820.00	629,010,000	
2882	イトアンドホールディングス	10,200	2,300.00	23,460,000	貸付有価証券 400株
2883	大冷	3,000	1,908.00	5,724,000	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	14,000	507.00	7,098,000	貸付有価証券 2,700株
2897	日清食品ホールディングス	106,600	8,960.00	955,136,000	
2899	永谷園ホールディングス	12,100	1,951.00	23,607,100	貸付有価証券 2,700株
2904	一正蒲鉾	11,700	776.00	9,079,200	貸付有価証券 1,700株

2908	フジッコ	25,300	1,949.00	49,309,700	貸付有価証券 4,800株
2910	ロック・フィールド	29,300	1,544.00	45,239,200	貸付有価証券 7,700株
2914	日本たばこ産業	1,456,800	2,340.00	3,408,912,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	15,200	1,355.00	20,596,000	貸付有価証券 2,900株
2918	わらべや日洋ホールディングス	17,800	1,900.00	33,820,000	貸付有価証券 2,900株
2922	なとり	15,200	2,000.00	30,400,000	
2924	イフジ産業	4,700	940.00	4,418,000	
2925	ピククルスコーポレーション	13,000	1,586.00	20,618,000	
2929	ファーマフーズ	25,700	1,632.00	41,942,400	
2931	ユーグレナ	138,400	730.00	101,032,000	貸付有価証券 28,400株
2933	紀文食品	15,800	952.00	15,041,600	
4404	ミヨシ油脂	10,400	1,108.00	11,523,200	貸付有価証券 2,300株
4526	理研ビタミン	28,200	1,705.00	48,081,000	貸付有価証券 4,300株
3001	片倉工業	29,600	2,398.00	70,980,800	
3002	グンゼ	17,800	3,855.00	68,619,000	貸付有価証券 3,200株
3101	東洋紡	104,800	1,305.00	136,764,000	貸付有価証券 17,200株
3103	ユニチカ	72,800	305.00	22,204,000	貸付有価証券 12,700株
3104	富士紡ホールディングス	11,800	3,795.00	44,781,000	貸付有価証券 400株
3106	倉敷紡績	22,700	1,917.00	43,515,900	貸付有価証券 2,900株
3109	シキボウ	13,900	917.00	12,746,300	貸付有価証券 4,100株
3201	日本毛織	79,900	897.00	71,670,300	
3202	ダイトウボウ	42,900	89.00	3,818,100	貸付有価証券 8,700株
3204	トーア紡コーポレーション	9,800	408.00	3,998,400	
3205	ダイドーリミテッド	34,900	140.00	4,886,000	貸付有価証券 7,100株
3302	帝国繊維	29,900	2,013.00	60,188,700	貸付有価証券 7,500株
3401	帝人	249,600	1,384.00	345,446,400	
3402	東レ	1,919,600	670.80	1,287,667,680	貸付有価証券 315,000株
3501	住江織物	5,200	1,913.00	9,947,600	貸付有価証券 1,700株
3512	日本フェルト	15,000	448.00	6,720,000	貸付有価証券 1,400株
3513	イチカワ	3,400	1,384.00	4,705,600	

3524	日東製網	2,800	1,447.00	4,051,600	貸付有価証券 500株
3529	アツギ	20,400	583.00	11,893,200	貸付有価証券 3,600株
3551	ダイニック	10,000	718.00	7,180,000	貸付有価証券 1,600株
3569	セーレン	54,300	2,093.00	113,649,900	貸付有価証券 10,600株
3571	ソトー	9,700	829.00	8,041,300	
3577	東海染工	3,000	1,147.00	3,441,000	
3580	小松マテーレ	43,500	1,266.00	55,071,000	貸付有価証券 9,100株
3591	ワコールホールディングス	66,100	2,054.00	135,769,400	貸付有価証券 6,500株
3593	ホギメディカル	35,700	3,150.00	112,455,000	貸付有価証券 7,200株
3607	クラウディアホールディングス	6,500	236.00	1,534,000	貸付有価証券 1,100株
3608	T S I ホールディングス	88,600	330.00	29,238,000	貸付有価証券 14,600株
3611	マツオカコーポレーション	8,500	1,176.00	9,996,000	貸付有価証券 1,200株
3612	ワールド	34,700	1,178.00	40,876,600	貸付有価証券 3,100株
8011	三陽商会	12,700	863.00	10,960,100	貸付有価証券 2,900株
8013	ナイガイ	9,000	283.00	2,547,000	
8016	オンワードホールディングス	159,300	297.00	47,312,100	
8029	ルックホールディングス	8,400	1,321.00	11,096,400	貸付有価証券 1,400株
8107	キムラタン	148,700	19.00	2,825,300	貸付有価証券 33,000株
8111	ゴールドウイン	47,900	6,090.00	291,711,000	貸付有価証券 9,900株
8114	デサント	51,700	3,455.00	178,623,500	貸付有価証券 8,600株
8118	キング	12,500	517.00	6,462,500	貸付有価証券 2,100株
8127	ヤマトインターナショナル	23,300	285.00	6,640,500	貸付有価証券 3,500株
3708	特種東海製紙	16,300	4,190.00	68,297,000	貸付有価証券 2,800株
3861	王子ホールディングス	1,108,300	604.00	669,413,200	
3863	日本製紙	127,000	1,177.00	149,479,000	
3864	三菱製紙	37,600	319.00	11,994,400	貸付有価証券 5,000株
3865	北越コーポレーション	173,900	784.00	136,337,600	
3877	中越パルプ工業	10,100	989.00	9,988,900	貸付有価証券 2,600株
3878	巴川製紙所	7,900	818.00	6,462,200	貸付有価証券 1,300株

3880	大王製紙	127,800	1,915.00	244,737,000	
3896	阿波製紙	6,800	331.00	2,250,800	貸付有価証券 1,100株
3941	レンゴー	250,600	864.00	216,518,400	貸付有価証券 41,200株
3946	トーモク	16,300	1,761.00	28,704,300	貸付有価証券 2,700株
3950	ザ・バック	20,100	2,721.00	54,692,100	貸付有価証券 3,300株
2930	北の達人コーポレーション	94,900	218.00	20,688,200	貸付有価証券 4,800株
3405	クラレ	387,700	1,035.00	401,269,500	
3407	旭化成	1,757,300	1,116.00	1,961,146,800	貸付有価証券 290,100株
3553	共和レザー	16,500	666.00	10,989,000	貸付有価証券 2,400株
4004	昭和電工	229,900	2,383.00	547,851,700	
4005	住友化学	1,947,800	586.00	1,141,410,800	貸付有価証券 319,600株
4008	住友精化	11,700	3,310.00	38,727,000	
4021	日産化学	144,200	6,590.00	950,278,000	貸付有価証券 14,100株
4022	ラサ工業	9,300	1,619.00	15,056,700	貸付有価証券 1,500株
4023	クレハ	21,000	9,040.00	189,840,000	貸付有価証券 5,800株
4025	多木化学	10,300	5,250.00	54,075,000	貸付有価証券 1,300株
4027	テイカ	19,500	1,375.00	26,812,500	貸付有価証券 3,200株
4028	石原産業	44,100	1,161.00	51,200,100	
4031	片倉コープアグリ	6,000	1,150.00	6,900,000	
4041	日本曹達	33,900	3,435.00	116,446,500	貸付有価証券 8,200株
4042	東ソー	382,500	1,907.00	729,427,500	
4043	トクヤマ	84,800	1,971.00	167,140,800	貸付有価証券 12,500株
4044	セントラル硝子	43,300	2,107.00	91,233,100	貸付有価証券 800株
4045	東亜合成	147,300	1,128.00	166,154,400	貸付有価証券 30,800株
4046	大阪ソーダ	24,700	3,005.00	74,223,500	貸付有価証券 4,400株
4047	関東電化工業	58,000	1,077.00	62,466,000	
4061	デンカ	96,800	3,635.00	351,868,000	貸付有価証券 15,900株
4063	信越化学工業	455,200	18,970.00	8,635,144,000	
4064	日本カーバイド工業	9,400	1,362.00	12,802,800	貸付有価証券 1,500株

4078	堺化学工業	18,600	2,031.00	37,776,600	貸付有価証券 2,800株
4082	第一稀元素化学工業	24,600	1,140.00	28,044,000	貸付有価証券 6,600株
4088	エア・ウォーター	251,000	1,750.00	439,250,000	
4091	日本酸素ホールディングス	254,800	2,283.00	581,708,400	貸付有価証券 41,400株
4092	日本化学工業	8,200	2,638.00	21,631,600	貸付有価証券 1,400株
4093	東邦アセチレン	4,400	1,270.00	5,588,000	貸付有価証券 600株
4095	日本パーカライジング	133,700	1,028.00	137,443,600	貸付有価証券 21,900株
4097	高圧ガス工業	42,000	748.00	31,416,000	貸付有価証券 6,900株
4098	チタン工業	3,100	1,632.00	5,059,200	貸付有価証券 600株
4099	四国化成工業	34,600	1,400.00	48,440,000	貸付有価証券 6,700株
4100	戸田工業	5,600	3,115.00	17,444,000	貸付有価証券 1,400株
4109	ステラ ケミファ	13,300	2,497.00	33,210,100	貸付有価証券 1,300株
4112	保土谷化学工業	8,500	5,220.00	44,370,000	貸付有価証券 1,600株
4114	日本触媒	44,600	5,980.00	266,708,000	貸付有価証券 1,400株
4116	大日精化工業	21,900	2,259.00	49,472,100	貸付有価証券 5,900株
4118	カネカ	68,600	3,910.00	268,226,000	
4182	三菱瓦斯化学	246,600	2,134.00	526,244,400	貸付有価証券 41,100株
4183	三井化学	240,800	3,040.00	732,032,000	貸付有価証券 40,200株
4185	J S R	247,100	3,450.00	852,495,000	
4186	東京応化工業	43,000	6,350.00	273,050,000	
4187	大阪有機化学工業	22,600	2,986.00	67,483,600	貸付有価証券 6,600株
4188	三菱ケミカルホールディングス	1,772,300	839.30	1,487,491,390	貸付有価証券 289,900株
4189	KHネオケム	43,700	3,065.00	133,940,500	貸付有価証券 8,800株
4202	ダイセル	381,900	876.00	334,544,400	貸付有価証券 37,100株
4203	住友ベークライト	41,700	5,340.00	222,678,000	貸付有価証券 7,400株
4204	積水化学工業	554,800	1,937.00	1,074,647,600	貸付有価証券 121,400株
4205	日本ゼオン	239,100	1,352.00	323,263,200	貸付有価証券 27,800株

4206	アイカ工業	73,800	3,175.00	234,315,000	貸付有価証券 12,700株
4208	宇部興産	125,000	2,169.00	271,125,000	貸付有価証券 12,000株
4212	積水樹脂	40,000	2,002.00	80,080,000	貸付有価証券 11,200株
4215	タキロンシーアイ	57,400	559.00	32,086,600	貸付有価証券 7,000株
4216	旭有機材	15,000	2,164.00	32,460,000	
4218	ニチバン	15,700	1,727.00	27,113,900	貸付有価証券 1,000株
4220	リケンテクノス	64,700	456.00	29,503,200	貸付有価証券 15,900株
4221	大倉工業	13,600	2,005.00	27,268,000	貸付有価証券 1,400株
4228	積水化成成品工業	35,500	449.00	15,939,500	貸付有価証券 5,900株
4229	群栄化学工業	6,100	3,450.00	21,045,000	貸付有価証券 1,000株
4231	タイガースポリマー	13,900	437.00	6,074,300	貸付有価証券 2,200株
4238	ミライアル	8,500	1,484.00	12,614,000	貸付有価証券 1,500株
4245	ダイキアクシス	10,300	701.00	7,220,300	貸付有価証券 1,600株
4246	ダイキョーニシカワ	55,900	609.00	34,043,100	貸付有価証券 11,500株
4248	竹本容器	9,500	793.00	7,533,500	貸付有価証券 1,700株
4249	森六ホールディングス	14,300	1,979.00	28,299,700	貸付有価証券 2,300株
4251	恵和	7,200	5,140.00	37,008,000	貸付有価証券 1,200株
4272	日本化薬	208,900	1,166.00	243,577,400	
4275	カーリットホールディングス	26,300	703.00	18,488,900	貸付有価証券 4,600株
4362	日本精化	21,300	2,075.00	44,197,500	貸付有価証券 3,500株
4368	扶桑化学工業	23,900	4,735.00	113,166,500	貸付有価証券 4,400株
4369	トリケミカル研究所	27,300	2,976.00	81,244,800	貸付有価証券 4,000株
4401	A D E K A	122,100	2,526.00	308,424,600	貸付有価証券 25,300株
4403	日油	90,500	5,140.00	465,170,000	
4406	新日本理化	43,900	251.00	11,018,900	貸付有価証券 7,200株
4410	ハリマ化成グループ	19,700	817.00	16,094,900	貸付有価証券 3,600株
4452	花王	598,800	5,254.00	3,146,095,200	

4461	第一工業製薬	9,900	2,900.00	28,710,000	貸付有価証券 1,000株
4462	石原ケミカル	13,400	1,322.00	17,714,800	貸付有価証券 2,200株
4463	日華化学	8,900	803.00	7,146,700	貸付有価証券 1,500株
4465	ニイタカ	5,500	2,283.00	12,556,500	貸付有価証券 700株
4471	三洋化成工業	15,800	5,130.00	81,054,000	貸付有価証券 4,100株
4531	有機合成薬品工業	18,500	273.00	5,050,500	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	32,500	812.00	26,390,000	貸付有価証券 4,900株
4612	日本ペイントホールディングス	996,100	849.00	845,688,900	
4613	関西ペイント	274,900	2,296.00	631,170,400	
4615	神東塗料	20,800	154.00	3,203,200	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	62,500	902.00	56,375,000	貸付有価証券 17,900株
4619	日本特殊塗料	19,800	840.00	16,632,000	貸付有価証券 2,700株
4620	藤倉化成	33,000	482.00	15,906,000	
4626	太陽ホールディングス	39,100	3,215.00	125,706,500	
4631	D I C	112,000	2,997.00	335,664,000	
4633	サカタインクス	52,600	982.00	51,653,200	貸付有価証券 13,700株
4634	東洋インキＳＣホールディングス	56,000	1,925.00	107,800,000	貸付有価証券 4,900株
4636	T & K T O K A	21,400	865.00	18,511,000	貸付有価証券 4,700株
4901	富士フイルムホールディングス	475,800	7,612.00	3,621,789,600	
4911	資生堂	504,300	5,997.00	3,024,287,100	
4912	ライオン	326,800	1,513.00	494,448,400	貸付有価証券 38,000株
4914	高砂香料工業	18,600	2,811.00	52,284,600	貸付有価証券 2,800株
4917	マンダム	56,800	1,283.00	72,874,400	貸付有価証券 15,600株
4919	ミルボン	33,400	5,450.00	182,030,000	貸付有価証券 5,700株
4921	ファンケル	109,600	3,110.00	340,856,000	貸付有価証券 800株
4922	コーセー	50,900	10,980.00	558,882,000	貸付有価証券 10,800株
4923	コタ	17,200	1,566.00	26,935,200	貸付有価証券 2,600株
4926	シーボン	3,500	1,804.00	6,314,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	115,500	1,734.00	200,277,000	貸付有価証券 21,400株

4928	ノエビアホールディングス	23,000	5,020.00	115,460,000	貸付有価証券 300株
4929	アジュバンホールディングス	6,100	1,099.00	6,703,900	貸付有価証券 1,100株
4931	新日本製薬	7,300	1,325.00	9,672,500	貸付有価証券 1,300株
4951	エステー	17,400	1,537.00	26,743,800	貸付有価証券 1,700株
4955	アグロ カネショウ	9,000	1,303.00	11,727,000	貸付有価証券 1,700株
4956	コニシ	44,500	1,586.00	70,577,000	貸付有価証券 11,200株
4958	長谷川香料	46,700	2,423.00	113,154,100	貸付有価証券 2,200株
4963	星光PMC	15,300	655.00	10,021,500	貸付有価証券 2,500株
4967	小林製薬	75,900	9,470.00	718,773,000	貸付有価証券 6,400株
4968	荒川化学工業	22,600	1,126.00	25,447,600	貸付有価証券 5,400株
4971	メック	20,200	3,080.00	62,216,000	貸付有価証券 1,800株
4973	日本高純度化学	7,400	2,578.00	19,077,200	
4974	タカラバイオ	70,800	2,293.00	162,344,400	
4975	J C U	30,500	4,555.00	138,927,500	貸付有価証券 5,400株
4977	新田ゼラチン	17,000	650.00	11,050,000	貸付有価証券 2,800株
4979	O A Tアグリオ	5,600	2,008.00	11,244,800	貸付有価証券 800株
4980	デクセリアルズ	70,400	3,100.00	218,240,000	
4985	アース製薬	22,300	5,870.00	130,901,000	貸付有価証券 3,300株
4992	北興化学工業	25,200	788.00	19,857,600	貸付有価証券 1,600株
4994	大成ラミック	8,300	2,818.00	23,389,400	
4996	クミアイ化学工業	100,700	807.00	81,264,900	貸付有価証券 14,700株
4997	日本農薬	48,200	531.00	25,594,200	貸付有価証券 7,900株
5142	アキレス	17,300	1,238.00	21,417,400	貸付有価証券 3,100株
5208	有沢製作所	39,500	996.00	39,342,000	貸付有価証券 9,500株
6988	日東電工	163,600	8,710.00	1,424,956,000	
7874	レック	35,300	948.00	33,464,400	
7888	三光合成	31,000	372.00	11,532,000	貸付有価証券 5,100株
7908	きもと	41,400	212.00	8,776,800	貸付有価証券 7,500株

7917	藤森工業	24,300	4,165.00	101,209,500	貸付有価証券 6,300株
7925	前澤化成工業	17,200	1,241.00	21,345,200	貸付有価証券 500株
7931	未来工業	9,700	1,541.00	14,947,700	貸付有価証券 2,400株
7940	ウェーブロックホールディングス	10,300	702.00	7,230,600	貸付有価証券 1,500株
7942	J S P	15,800	1,573.00	24,853,400	貸付有価証券 2,600株
7947	エフピコ	49,800	3,375.00	168,075,000	貸付有価証券 11,600株
7958	天馬	21,300	2,604.00	55,465,200	貸付有価証券 2,100株
7970	信越ポリマー	48,600	1,114.00	54,140,400	
7971	東リ	67,400	224.00	15,097,600	貸付有価証券 11,000株
7988	ニフコ	90,400	3,430.00	310,072,000	貸付有価証券 1,600株
7995	バルカー	22,000	2,528.00	55,616,000	貸付有価証券 4,500株
8113	ユニ・チャーム	521,800	4,405.00	2,298,529,000	貸付有価証券 1,500株
9385	ショーエイコーポレーション	7,300	662.00	4,832,600	貸付有価証券 500株
4151	協和キリン	317,700	2,923.00	928,637,100	
4502	武田薬品工業	2,127,700	3,443.00	7,325,671,100	
4503	アステラス製薬	2,347,100	2,021.50	4,744,662,650	
4506	大日本住友製薬	167,200	1,242.00	207,662,400	貸付有価証券 32,800株
4507	塩野義製薬	340,400	7,984.00	2,717,753,600	貸付有価証券 56,600株
4512	わかもと製薬	32,200	303.00	9,756,600	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	70,900	7,640.00	541,676,000	貸付有価証券 500株
4519	中外製薬	846,700	4,059.00	3,436,755,300	
4521	科研製薬	42,500	4,105.00	174,462,500	貸付有価証券 12,700株
4523	エーザイ	324,000	5,752.00	1,863,648,000	
4527	ロート製薬	138,900	3,205.00	445,174,500	貸付有価証券 8,400株
4528	小野薬品工業	621,700	2,830.50	1,759,721,850	貸付有価証券 104,500株
4530	久光製薬	71,600	3,680.00	263,488,000	
4534	持田製薬	34,100	3,720.00	126,852,000	
4536	参天製薬	504,800	1,321.00	666,840,800	
4538	扶桑薬品工業	9,500	2,246.00	21,337,000	貸付有価証券 1,400株

4539	日本ケミファ	3,200	2,123.00	6,793,600	貸付有価証券 600株
4540	ツムラ	83,900	3,360.00	281,904,000	貸付有価証券 1,500株
4541	日医工	84,000	747.00	62,748,000	貸付有価証券 18,100株
4547	キッセイ薬品工業	47,900	2,359.00	112,996,100	貸付有価証券 10,300株
4548	生化学工業	47,700	950.00	45,315,000	貸付有価証券 12,400株
4549	栄研化学	47,600	1,788.00	85,108,800	貸付有価証券 1,900株
4550	日水製薬	9,900	987.00	9,771,300	貸付有価証券 1,900株
4551	鳥居薬品	14,500	3,140.00	45,530,000	
4552	J C R ファーマ	76,300	2,032.00	155,041,600	貸付有価証券 6,800株
4553	東和薬品	39,000	2,930.00	114,270,000	貸付有価証券 5,700株
4554	富士製薬工業	16,600	999.00	16,583,400	貸付有価証券 1,200株
4559	ゼリア新薬工業	49,100	1,908.00	93,682,800	貸付有価証券 12,900株
4568	第一三共	2,127,300	2,360.50	5,021,491,650	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	54,300	1,857.00	100,835,100	貸付有価証券 12,000株
4574	大幸薬品	40,800	643.00	26,234,400	貸付有価証券 5,100株
4577	ダイト	17,500	2,817.00	49,297,500	貸付有価証券 2,600株
4578	大塚ホールディングス	562,600	4,091.00	2,301,596,600	
4581	大正製薬ホールディングス	64,400	5,690.00	366,436,000	貸付有価証券 12,100株
4587	ペプチドリーム	142,000	2,020.00	286,840,000	
4886	あすか製薬ホールディングス	30,800	1,037.00	31,939,600	貸付有価証券 5,100株
4887	サワイグループホールディングス	59,300	4,505.00	267,146,500	
3315	日本コークス工業	228,700	140.00	32,018,000	貸付有価証券 17,900株
5011	ニチレキ	34,600	1,290.00	44,634,000	貸付有価証券 2,600株
5013	ユシロ化学工業	14,000	1,076.00	15,064,000	貸付有価証券 2,500株
5015	ビーピー・カストロール	9,700	1,301.00	12,619,700	貸付有価証券 1,700株
5017	富士石油	72,300	256.00	18,508,800	貸付有価証券 11,800株
5018	MORESCO	9,000	1,176.00	10,584,000	貸付有価証券 1,700株
5019	出光興産	300,400	3,075.00	923,730,000	貸付有価証券 49,900株

5020	ENEOSホールディングス	4,072,300	468.70	1,908,687,010	貸付有価証券 186,600株
5021	コスモエネルギーホールディングス	78,400	2,376.00	186,278,400	
5101	横浜ゴム	156,700	1,710.00	267,957,000	
5105	TOYO TIRE	142,500	1,633.00	232,702,500	貸付有価証券 800株
5108	ブリヂストン	779,800	5,198.00	4,053,400,400	
5110	住友ゴム工業	243,200	1,188.00	288,921,600	貸付有価証券 39,800株
5121	藤倉コンポジット	21,700	813.00	17,642,100	貸付有価証券 3,800株
5122	オカモト	16,100	4,110.00	66,171,000	貸付有価証券 2,700株
5185	フコク	11,800	963.00	11,363,400	貸付有価証券 1,900株
5186	ニッタ	28,000	2,816.00	78,848,000	貸付有価証券 5,000株
5191	住友理工	52,500	600.00	31,500,000	
5192	三ツ星ベルト	32,900	2,136.00	70,274,400	貸付有価証券 5,800株
5195	バンドー化学	43,600	884.00	38,542,400	貸付有価証券 10,800株
3110	日東紡績	40,300	2,939.00	118,441,700	
5201	A G C	248,500	5,040.00	1,252,440,000	貸付有価証券 16,400株
5202	日本板硝子	129,900	466.00	60,533,400	貸付有価証券 21,200株
5204	石塚硝子	4,600	2,043.00	9,397,800	
5210	日本山村硝子	10,300	785.00	8,085,500	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	108,700	2,811.00	305,555,700	貸付有価証券 3,700株
5218	オハラ	10,700	1,110.00	11,877,000	貸付有価証券 1,900株
5232	住友大阪セメント	50,100	3,535.00	177,103,500	貸付有価証券 12,200株
5233	太平洋セメント	153,800	2,307.00	354,816,600	
5262	日本ヒューム	27,100	691.00	18,726,100	貸付有価証券 2,600株
5269	日本コンクリート工業	53,400	283.00	15,112,200	貸付有価証券 9,500株
5273	三谷セキサン	12,600	6,520.00	82,152,000	貸付有価証券 2,500株
5288	アジアパイルホールディングス	41,600	442.00	18,387,200	貸付有価証券 6,300株
5301	東海カーボン	226,900	1,147.00	260,254,300	
5302	日本カーボン	13,900	3,990.00	55,461,000	貸付有価証券 2,200株
5310	東洋炭素	17,600	2,901.00	51,057,600	貸付有価証券 4,000株

5331	ノリタケカンパニーリミテド	15,000	4,510.00	67,650,000	貸付有価証券 1,400株
5332	TOTO	193,400	4,885.00	944,759,000	
5333	日本碍子	293,300	1,862.00	546,124,600	貸付有価証券 1,500株
5334	日本特殊陶業	205,900	2,205.00	454,009,500	貸付有価証券 17,900株
5337	ダントーホールディングス	17,600	352.00	6,195,200	貸付有価証券 3,300株
5344	MARUWA	9,400	13,820.00	129,908,000	貸付有価証券 1,700株
5351	品川リフラクトリーズ	6,300	3,935.00	24,790,500	
5352	黒崎播磨	4,600	4,425.00	20,355,000	貸付有価証券 900株
5357	ヨータイ	17,200	1,287.00	22,136,400	
5358	イソライト工業	11,900	1,198.00	14,256,200	貸付有価証券 3,400株
5363	東京窯業	34,400	308.00	10,595,200	貸付有価証券 5,600株
5367	ニッカトー	12,200	613.00	7,478,600	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	21,700	6,650.00	144,305,000	貸付有価証券 4,000株
5388	クニミネ工業	8,500	1,003.00	8,525,500	貸付有価証券 1,800株
5391	エーアンドエーマテリアル	4,600	900.00	4,140,000	貸付有価証券 800株
5393	ニチアス	62,700	2,595.00	162,706,500	貸付有価証券 12,100株
7943	ニチハ	37,600	2,618.00	98,436,800	貸付有価証券 3,300株
5401	日本製鉄	1,198,000	1,967.00	2,356,466,000	
5406	神戸製鋼所	499,700	569.00	284,329,300	
5408	中山製鋼所	42,400	451.00	19,122,400	貸付有価証券 6,100株
5410	合同製鐵	14,400	1,349.00	19,425,600	貸付有価証券 2,400株
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	723,000	1,535.00	1,109,805,000	貸付有価証券 182,000株
5423	東京製鐵	91,200	1,147.00	104,606,400	貸付有価証券 35,800株
5440	共英製鋼	30,200	1,563.00	47,202,600	貸付有価証券 6,800株
5444	大和工業	51,200	3,720.00	190,464,000	貸付有価証券 16,900株
5445	東京鐵鋼	11,800	1,352.00	15,953,600	貸付有価証券 3,000株
5449	大阪製鐵	14,200	1,222.00	17,352,400	貸付有価証券 2,400株
5451	淀川製鋼所	35,100	2,610.00	91,611,000	貸付有価証券 8,500株

5463	丸一銅管	94,800	2,642.00	250,461,600	貸付有価証券 14,300株
5464	モリ工業	7,900	2,534.00	20,018,600	貸付有価証券 1,300株
5471	大同特殊鋼	43,800	4,300.00	188,340,000	貸付有価証券 7,200株
5476	日本高周波鋼業	9,900	340.00	3,366,000	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	19,500	2,960.00	57,720,000	貸付有価証券 3,600株
5481	山陽特殊製鋼	27,500	2,209.00	60,747,500	貸付有価証券 3,300株
5482	愛知製鋼	15,000	2,585.00	38,775,000	貸付有価証券 2,500株
5486	日立金属	288,400	2,088.00	602,179,200	
5491	日本金属	6,800	1,078.00	7,330,400	貸付有価証券 1,000株
5541	大太平洋金属	16,500	2,991.00	49,351,500	貸付有価証券 2,100株
5563	新日本電工	172,800	326.00	56,332,800	貸付有価証券 12,000株
5602	栗本鐵工所	12,100	1,560.00	18,876,000	貸付有価証券 2,200株
5603	虹技	3,700	947.00	3,503,900	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	2,800	1,001.00	2,802,800	貸付有価証券 500株
5632	三菱製鋼	17,200	1,255.00	21,586,000	貸付有価証券 4,800株
5658	日亜鋼業	34,800	277.00	9,639,600	貸付有価証券 6,400株
5659	日本精線	4,400	4,480.00	19,712,000	貸付有価証券 700株
5698	エンビプロ・ホールディングス	8,900	1,670.00	14,863,000	貸付有価証券 2,000株
6319	シンニッタン	32,400	235.00	7,614,000	貸付有価証券 6,800株
7305	新家工業	6,600	1,692.00	11,167,200	貸付有価証券 1,000株
5702	大紀アルミニウム工業所	40,300	1,463.00	58,958,900	貸付有価証券 7,200株
5703	日本軽金属ホールディングス	67,700	1,787.00	120,979,900	貸付有価証券 7,500株
5706	三井金属鉱業	72,200	3,260.00	235,372,000	貸付有価証券 11,800株
5707	東邦亜鉛	14,800	2,427.00	35,919,600	貸付有価証券 4,000株
5711	三菱マテリアル	176,800	2,085.00	368,628,000	
5713	住友金属鉱山	342,200	5,373.00	1,838,640,600	貸付有価証券 56,200株
5714	DOWAホールディングス	72,900	5,180.00	377,622,000	貸付有価証券 11,100株

5715	古河機械金属	44,200	1,263.00	55,824,600	貸付有価証券 9,200株
5721	エス・サイエンス	130,400	23.00	2,999,200	貸付有価証券 25,700株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	30,900	859.00	26,543,100	貸付有価証券 6,900株
5727	東邦チタニウム	47,900	914.00	43,780,600	貸付有価証券 7,100株
5741	U A C J	40,600	2,316.00	94,029,600	貸付有価証券 6,600株
5757	C Kサンエツ	5,600	4,015.00	22,484,000	貸付有価証券 900株
5801	古河電気工業	83,100	2,205.00	183,235,500	貸付有価証券 8,500株
5802	住友電気工業	1,000,900	1,561.00	1,562,404,900	
5803	フジクラ	298,400	620.00	185,008,000	貸付有価証券 35,100株
5805	昭和電線ホールディングス	23,300	1,899.00	44,246,700	
5807	東京特殊電線	4,000	2,895.00	11,580,000	貸付有価証券 600株
5809	タツタ電線	47,200	451.00	21,287,200	貸付有価証券 8,600株
5819	カナレ電気	4,000	1,519.00	6,076,000	
5821	平河ヒューテック	14,800	1,169.00	17,301,200	貸付有価証券 1,600株
5851	リョービ	32,900	1,122.00	36,913,800	貸付有価証券 5,400株
5852	アーレスティ	28,500	379.00	10,801,500	貸付有価証券 5,700株
5857	アサヒホールディングス	107,200	2,202.00	236,054,400	貸付有価証券 22,900株
3421	稲葉製作所	15,100	1,285.00	19,403,500	貸付有価証券 3,400株
3431	宮地エンジニアリンググループ	8,100	3,180.00	25,758,000	
3433	トーカロ	69,100	1,320.00	91,212,000	貸付有価証券 12,100株
3434	アルファC o	10,300	1,103.00	11,360,900	貸付有価証券 1,600株
3436	SUMCO	412,000	1,984.00	817,408,000	貸付有価証券 52,400株
3443	川田テクノロジーズ	5,500	3,970.00	21,835,000	貸付有価証券 900株
3445	R S T e c h n o l o g i e s	8,700	5,650.00	49,155,000	貸付有価証券 1,500株
3446	ジェイテックコーポレーション	3,400	1,581.00	5,375,400	貸付有価証券 500株
3447	信和	16,600	829.00	13,761,400	貸付有価証券 2,800株
5901	東洋製罐グループホールディングス	170,500	1,519.00	258,989,500	
5902	ホッカンホールディングス	14,700	1,418.00	20,844,600	貸付有価証券 2,400株

5909	コロナ	14,800	899.00	13,305,200	貸付有価証券 2,400株
5911	横河ブリッジホールディングス	46,000	2,040.00	93,840,000	貸付有価証券 8,200株
5915	駒井ハルテック	5,000	2,372.00	11,860,000	貸付有価証券 800株
5923	高田機工	2,400	2,842.00	6,820,800	
5929	三和ホールディングス	252,400	1,202.00	303,384,800	
5930	文化シャッター	84,900	1,028.00	87,277,200	
5932	三協立山	34,500	615.00	21,217,500	
5933	アルインコ	19,500	910.00	17,745,000	貸付有価証券 1,400株
5936	東洋シャッター	5,900	543.00	3,203,700	
5938	L I X I L	421,300	2,516.00	1,059,990,800	貸付有価証券 64,600株
5942	日本ファイルコン	18,600	535.00	9,951,000	貸付有価証券 3,300株
5943	ノーリツ	51,200	1,635.00	83,712,000	貸付有価証券 14,100株
5946	長府製作所	27,200	1,945.00	52,904,000	貸付有価証券 4,500株
5947	リンナイ	50,400	10,110.00	509,544,000	貸付有価証券 8,500株
5951	ダイニチ工業	12,800	713.00	9,126,400	貸付有価証券 2,400株
5957	日東精工	33,600	520.00	17,472,000	貸付有価証券 6,100株
5958	三洋工業	3,300	1,809.00	5,969,700	
5959	岡部	51,100	749.00	38,273,900	貸付有価証券 8,900株
5970	ジーテクト	33,200	1,433.00	47,575,600	貸付有価証券 4,300株
5975	東プレ	49,900	1,231.00	61,426,900	貸付有価証券 13,400株
5976	高周波熱錬	47,800	591.00	28,249,800	貸付有価証券 12,800株
5981	東京製綱	16,400	886.00	14,530,400	
5985	サンコール	22,900	558.00	12,778,200	貸付有価証券 3,000株
5986	モリテック スチール	20,900	324.00	6,771,600	貸付有価証券 4,500株
5988	パイオラックス	38,400	1,794.00	68,889,600	貸付有価証券 6,500株
5989	エイチワン	26,200	655.00	17,161,000	
5991	日本発條	246,100	900.00	221,490,000	貸付有価証券 70,800株
5992	中央発條	12,900	795.00	10,255,500	
5998	アドバネクス	3,500	1,482.00	5,187,000	貸付有価証券 800株

7989	立川ブラインド工業	11,800	1,100.00	12,980,000	貸付有価証券 1,900株
8155	三益半導体工業	20,900	2,380.00	49,742,000	貸付有価証券 5,800株
1909	日本ドライケミカル	6,600	1,743.00	11,503,800	
5631	日本製鋼所	81,300	3,750.00	304,875,000	貸付有価証券 13,300株
6005	三浦工業	115,800	3,295.00	381,561,000	貸付有価証券 13,300株
6013	タクマ	90,700	1,424.00	129,156,800	貸付有価証券 14,900株
6101	ツガミ	58,800	1,305.00	76,734,000	貸付有価証券 10,700株
6103	オークマ	31,200	4,820.00	150,384,000	貸付有価証券 1,700株
6104	芝浦機械	30,200	3,085.00	93,167,000	貸付有価証券 900株
6113	アマダ	422,500	1,097.00	463,482,500	
6118	アイダエンジニアリング	70,000	1,034.00	72,380,000	貸付有価証券 11,800株
6121	滝澤鉄工所	7,700	1,193.00	9,186,100	貸付有価証券 2,000株
6134	F U J I	123,300	2,509.00	309,359,700	貸付有価証券 19,200株
6135	牧野フライス製作所	29,300	3,770.00	110,461,000	貸付有価証券 400株
6136	オーエスジー	123,800	2,029.00	251,190,200	
6138	ダイジェット工業	3,000	985.00	2,955,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	70,200	604.00	42,400,800	
6141	DMG森精機	158,800	1,733.00	275,200,400	貸付有価証券 14,900株
6143	ソディック	58,800	795.00	46,746,000	貸付有価証券 4,400株
6146	ディスコ	39,400	32,250.00	1,270,650,000	貸付有価証券 6,000株
6151	日東工器	14,700	1,608.00	23,637,600	
6157	日進工具	21,000	1,429.00	30,009,000	貸付有価証券 2,600株
6165	パンチ工業	22,300	491.00	10,949,300	貸付有価証券 3,900株
6167	富士ダイス	13,400	615.00	8,241,000	貸付有価証券 1,900株
6203	豊和工業	13,700	830.00	11,371,000	貸付有価証券 2,400株
6205	ＯＫＫ	9,600	758.00	7,276,800	貸付有価証券 1,800株
6208	石川製作所	7,000	1,475.00	10,325,000	貸付有価証券 1,000株
6210	東洋機械金属	17,400	567.00	9,865,800	
6217	津田駒工業	5,100	581.00	2,963,100	貸付有価証券 800株

6218	エンシュウ	5,900	654.00	3,858,600	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	39,100	1,749.00	68,385,900	貸付有価証券 10,700株
6235	オプトラン	33,600	2,296.00	77,145,600	貸付有価証券 8,000株
6236	ＮＣホールディングス	7,500	1,617.00	12,127,500	貸付有価証券 1,400株
6237	イワキポンプ	17,000	1,003.00	17,051,000	貸付有価証券 2,100株
6238	フリーー	23,800	1,287.00	30,630,600	
6240	ヤマシンフィルタ	54,000	383.00	20,682,000	
6247	日阪製作所	33,000	823.00	27,159,000	貸付有価証券 5,400株
6250	やまびこ	51,900	1,058.00	54,910,200	貸付有価証券 8,500株
6254	野村マイクロ・サイエンス	7,000	4,175.00	29,225,000	貸付有価証券 1,400株
6258	平田機工	12,700	5,660.00	71,882,000	貸付有価証券 2,100株
6262	ペガサスミシン製造	27,100	571.00	15,474,100	
6264	マルマエ	11,000	2,378.00	26,158,000	貸付有価証券 1,800株
6266	タツモ	12,500	1,405.00	17,562,500	貸付有価証券 100株
6268	ナブテスコ	152,600	3,505.00	534,863,000	貸付有価証券 25,800株
6269	三井海洋開発	28,400	1,206.00	34,250,400	
6272	レオン自動機	28,600	1,043.00	29,829,800	貸付有価証券 5,800株
6273	SMC	79,300	63,910.00	5,068,063,000	貸付有価証券 5,600株
6277	ホソカワミクロン	18,800	2,867.00	53,899,600	
6278	ユニオンツール	10,000	3,710.00	37,100,000	貸付有価証券 3,400株
6282	オイレス工業	37,500	1,613.00	60,487,500	貸付有価証券 5,700株
6284	日精エー・エス・ビー機械	9,000	2,924.00	26,316,000	
6287	サトーホールディングス	35,200	2,027.00	71,350,400	貸付有価証券 3,300株
6289	技研製作所	23,700	3,890.00	92,193,000	
6291	日本エアーテック	12,300	1,097.00	13,493,100	貸付有価証券 1,300株
6292	カワタ	8,500	1,066.00	9,061,000	貸付有価証券 1,300株
6293	日精樹脂工業	18,700	1,024.00	19,148,800	貸付有価証券 6,100株
6294	オカダアイヨン	8,500	1,470.00	12,495,000	貸付有価証券 1,700株
6298	ワイエイシイホールディングス	10,700	1,232.00	13,182,400	貸付有価証券 1,900株

6301	小松製作所	1,226,800	2,819.50	3,458,962,600	
6302	住友重機械工業	154,900	2,965.00	459,278,500	貸付有価証券 13,400株
6305	日立建機	108,500	2,930.00	317,905,000	
6306	日工	37,000	610.00	22,570,000	貸付有価証券 3,600株
6309	巴工業	10,600	2,211.00	23,436,600	貸付有価証券 500株
6310	井関農機	25,100	1,336.00	33,533,600	貸付有価証券 3,300株
6315	TOWA	23,100	2,442.00	56,410,200	貸付有価証券 4,400株
6316	丸山製作所	5,500	1,498.00	8,239,000	貸付有価証券 1,700株
6317	北川鉄工所	12,200	1,401.00	17,092,200	貸付有価証券 2,000株
6323	ローツェ	13,300	10,260.00	136,458,000	貸付有価証券 1,900株
6325	タカキタ	9,400	610.00	5,734,000	貸付有価証券 1,700株
6326	クボタ	1,311,400	2,396.50	3,142,770,100	貸付有価証券 224,600株
6328	荏原実業	12,400	2,179.00	27,019,600	貸付有価証券 2,300株
6331	三菱化工機	8,600	2,020.00	17,372,000	貸付有価証券 1,500株
6332	月島機械	49,800	1,037.00	51,642,600	貸付有価証券 13,200株
6333	帝国電機製作所	18,900	1,315.00	24,853,500	貸付有価証券 1,000株
6335	東京機械製作所	11,000	766.00	8,426,000	
6339	新東工業	59,600	696.00	41,481,600	貸付有価証券 14,500株
6340	澁谷工業	23,700	2,520.00	59,724,000	貸付有価証券 4,100株
6345	アイチ コーポレーション	38,500	828.00	31,878,000	貸付有価証券 9,200株
6349	小森コーポレーション	68,600	696.00	47,745,600	貸付有価証券 14,000株
6351	鶴見製作所	20,800	1,707.00	35,505,600	貸付有価証券 1,600株
6355	住友精密工業	4,000	1,885.00	7,540,000	
6356	日本ギア工業	9,600	263.00	2,524,800	
6358	酒井重工業	4,800	2,830.00	13,584,000	貸付有価証券 700株
6361	荏原製作所	112,400	5,540.00	622,696,000	
6362	石井鐵工所	3,800	2,987.00	11,350,600	
6363	西島製作所	24,500	921.00	22,564,500	
6364	北越工業	25,400	900.00	22,860,000	貸付有価証券 3,900株

6367	ダイキン工業	344,900	22,385.00	7,720,586,500	貸付有価証券 78,500株
6368	オルガノ	7,800	7,750.00	60,450,000	貸付有価証券 1,000株
6369	トーヨーカネツ	10,200	2,558.00	26,091,600	
6370	栗田工業	146,500	4,765.00	698,072,500	貸付有価証券 31,800株
6371	椿本チエイン	35,400	3,240.00	114,696,000	貸付有価証券 6,300株
6373	大同工業	11,900	930.00	11,067,000	貸付有価証券 2,100株
6378	木村化工機	22,500	743.00	16,717,500	貸付有価証券 4,300株
6381	アネスト岩田	42,100	811.00	34,143,100	貸付有価証券 11,100株
6383	ダイフク	149,000	8,530.00	1,270,970,000	貸付有価証券 22,700株
6387	サムコ	6,800	2,241.00	15,238,800	貸付有価証券 1,200株
6390	加藤製作所	12,800	846.00	10,828,800	貸付有価証券 2,400株
6393	油研工業	4,500	1,732.00	7,794,000	貸付有価証券 800株
6395	タダノ	141,500	974.00	137,821,000	貸付有価証券 9,900株
6406	フジテック	100,400	2,700.00	271,080,000	貸付有価証券 25,100株
6407	C K D	79,900	2,058.00	164,434,200	貸付有価証券 17,800株
6409	キトー	23,000	1,687.00	38,801,000	
6412	平和	75,500	1,900.00	143,450,000	
6413	理想科学工業	22,700	2,229.00	50,598,300	貸付有価証券 4,700株
6417	SANKYO	58,500	3,035.00	177,547,500	貸付有価証券 4,300株
6418	日本金銭機械	27,400	644.00	17,645,600	貸付有価証券 6,000株
6419	マースグループホールディングス	17,200	1,617.00	27,812,400	
6420	フクシマガリレイ	18,500	4,185.00	77,422,500	貸付有価証券 2,700株
6428	オーイズミ	9,500	395.00	3,752,500	貸付有価証券 1,900株
6430	ダイコク電機	12,400	1,244.00	15,425,600	貸付有価証券 3,000株
6432	竹内製作所	41,200	2,822.00	116,266,400	
6436	アマノ	70,900	2,187.00	155,058,300	貸付有価証券 7,900株
6440	J U K I	37,700	767.00	28,915,900	貸付有価証券 11,400株
6444	サンデン	37,500	194.00	7,275,000	貸付有価証券 9,300株

6445	ジャノメ	23,000	725.00	16,675,000	貸付有価証券 6,600株
6454	マックス	36,000	1,774.00	63,864,000	貸付有価証券 11,100株
6457	グローリー	69,500	2,089.00	145,185,500	貸付有価証券 16,800株
6458	新晃工業	25,200	1,831.00	46,141,200	
6459	大和冷機工業	39,100	1,131.00	44,222,100	貸付有価証券 6,400株
6460	セガサミーホールディングス	268,500	2,071.00	556,063,500	
6461	日本ピストンリング	9,900	1,338.00	13,246,200	貸付有価証券 1,600株
6462	リケン	11,600	2,703.00	31,354,800	貸付有価証券 2,800株
6463	T P R	36,400	1,489.00	54,199,600	貸付有価証券 6,000株
6464	ツバキ・ナカシマ	59,400	1,449.00	86,070,600	貸付有価証券 10,700株
6465	ホンザキ	79,100	8,680.00	686,588,000	貸付有価証券 3,700株
6470	大豊工業	22,100	716.00	15,823,600	貸付有価証券 3,600株
6471	日本精工	509,600	747.00	380,671,200	貸付有価証券 83,700株
6472	N T N	581,800	233.00	135,559,400	
6473	ジェイテクト	259,700	1,048.00	272,165,600	
6474	不二越	23,000	4,215.00	96,945,000	貸付有価証券 6,300株
6480	日本トムソン	74,100	621.00	46,016,100	貸付有価証券 13,100株
6481	T H K	152,800	2,819.00	430,743,200	貸付有価証券 25,800株
6482	ユーシン精機	21,000	697.00	14,637,000	貸付有価証券 3,500株
6485	前澤給装工業	20,300	978.00	19,853,400	貸付有価証券 900株
6486	イーグル工業	33,500	1,071.00	35,878,500	
6489	前澤工業	18,000	667.00	12,006,000	貸付有価証券 3,100株
6490	日本ピラー工業	27,400	3,100.00	84,940,000	貸付有価証券 4,400株
6498	キッツ	91,200	664.00	60,556,800	貸付有価証券 28,400株
6586	マキタ	329,500	3,977.00	1,310,421,500	
7003	三井E & Sホールディングス	97,800	370.00	36,186,000	貸付有価証券 16,000株
7004	日立造船	228,900	743.00	170,072,700	貸付有価証券 15,500株
7011	三菱重工業	425,300	3,193.00	1,357,982,900	貸付有価証券 74,200株
7013	I H I	169,000	2,335.00	394,615,000	

7022	サノヤスホールディングス	33,400	131.00	4,375,400	貸付有価証券 5,400株
7718	スター精密	40,800	1,460.00	59,568,000	
3105	日清紡ホールディングス	165,500	989.00	163,679,500	貸付有価証券 29,500株
4062	イビデン	142,100	6,030.00	856,863,000	貸付有価証券 27,100株
4902	コニカミノルタ	591,400	498.00	294,517,200	
6448	ブラザー工業	330,600	2,220.00	733,932,000	貸付有価証券 54,200株
6479	ミネベアミツミ	466,600	2,671.00	1,246,288,600	貸付有価証券 20,000株
6501	日立製作所	1,302,000	5,888.00	7,666,176,000	貸付有価証券 212,000株
6502	東芝	473,100	4,800.00	2,270,880,000	
6503	三菱電機	2,706,900	1,410.00	3,816,729,000	貸付有価証券 546,300株
6504	富士電機	163,100	5,940.00	968,814,000	貸付有価証券 14,600株
6505	東洋電機製造	9,800	959.00	9,398,200	貸付有価証券 2,600株
6506	安川電機	291,400	4,800.00	1,398,720,000	貸付有価証券 51,400株
6507	シンフォニアテクノロジー	32,500	1,261.00	40,982,500	貸付有価証券 8,200株
6508	明電舎	45,900	2,454.00	112,638,600	貸付有価証券 8,200株
6513	オリジン	6,800	1,258.00	8,554,400	貸付有価証券 1,200株
6516	山洋電気	12,000	4,970.00	59,640,000	貸付有価証券 2,200株
6517	デンヨー	23,100	1,674.00	38,669,400	貸付有価証券 3,800株
6523	PHCホールディングス	31,100	1,605.00	49,915,500	
6588	東芝テック	29,100	4,945.00	143,899,500	
6590	芝浦メカトロニクス	4,800	8,320.00	39,936,000	貸付有価証券 1,200株
6592	マブチモーター	62,700	3,600.00	225,720,000	貸付有価証券 10,300株
6594	日本電産	701,600	9,981.00	7,002,669,600	貸付有価証券 159,200株
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,900	384.00	4,569,600	貸付有価証券 2,500株
6616	トレックス・セミコンダクター	13,600	2,632.00	35,795,200	貸付有価証券 2,500株
6617	東光高岳	15,000	1,437.00	21,555,000	貸付有価証券 3,600株
6619	ダブル・スコープ	77,800	784.00	60,995,200	貸付有価証券 7,600株
6622	ダイヘン	29,600	3,995.00	118,252,000	貸付有価証券 4,800株

6630	ヤーマン	44,100	894.00	39,425,400	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	220,500	187.00	41,233,500	貸付有価証券 57,900株
6638	ミマキエンジニアリング	24,200	780.00	18,876,000	
6640	IPEX	12,600	1,718.00	21,646,800	貸付有価証券 1,800株
6641	日新電機	63,400	1,461.00	92,627,400	貸付有価証券 3,600株
6644	大崎電気工業	49,700	478.00	23,756,600	貸付有価証券 5,000株
6645	オムロン	225,300	8,227.00	1,853,543,100	
6651	日東工業	36,100	1,573.00	56,785,300	貸付有価証券 10,800株
6652	IDEC	33,500	2,330.00	78,055,000	貸付有価証券 9,000株
6653	正興電機製作所	8,500	1,038.00	8,823,000	貸付有価証券 1,200株
6654	不二電機工業	5,000	1,080.00	5,400,000	貸付有価証券 600株
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	88,100	2,270.00	199,987,000	貸付有価証券 26,200株
6675	サクサホールディングス	6,300	1,318.00	8,303,400	貸付有価証券 1,000株
6676	メルコホールディングス	6,000	3,785.00	22,710,000	
6678	テクノメディカ	6,100	1,581.00	9,644,100	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	7,500	1,067.00	8,002,500	貸付有価証券 300株
6701	日本電気	344,000	5,080.00	1,747,520,000	
6702	富士通	243,600	16,115.00	3,925,614,000	貸付有価証券 42,700株
6703	沖電気工業	110,000	895.00	98,450,000	貸付有価証券 18,100株
6704	岩崎通信機	11,000	815.00	8,965,000	貸付有価証券 1,600株
6706	電気興業	14,200	2,312.00	32,830,400	貸付有価証券 3,700株
6707	サンケン電気	25,300	4,730.00	119,669,000	
6715	ナカヨ	4,800	1,134.00	5,443,200	
6718	アイホン	15,300	2,136.00	32,680,800	貸付有価証券 3,700株
6723	ルネサスエレクトロニクス	1,469,000	1,256.00	1,845,064,000	貸付有価証券 210,900株
6724	セイコーエプソン	335,900	1,842.00	618,727,800	貸付有価証券 98,100株
6727	ワコム	210,000	892.00	187,320,000	貸付有価証券 16,600株
6728	アルバック	53,900	5,900.00	318,010,000	貸付有価証券 1,600株
6730	アクセル	11,300	1,039.00	11,740,700	貸付有価証券 2,800株

6737	E I Z O	21,000	3,690.00	77,490,000	貸付有価証券 3,500株
6740	ジャパンディスプレイ	924,500	38.00	35,131,000	貸付有価証券 6,400株
6741	日本信号	68,900	906.00	62,423,400	貸付有価証券 11,300株
6742	京三製作所	58,100	420.00	24,402,000	貸付有価証券 9,100株
6744	能美防災	35,800	2,079.00	74,428,200	貸付有価証券 3,300株
6745	ホーチキ	19,600	1,209.00	23,696,400	貸付有価証券 3,200株
6748	星和電機	12,200	544.00	6,636,800	貸付有価証券 2,200株
6750	エレコム	62,000	1,365.00	84,630,000	貸付有価証券 3,200株
6752	パナソニック	2,887,300	1,201.50	3,469,090,950	貸付有価証券 523,700株
6753	シャープ	308,600	1,247.00	384,824,200	貸付有価証券 57,700株
6754	アンリツ	174,400	1,581.00	275,726,400	
6755	富士通ゼネラル	73,500	2,456.00	180,516,000	貸付有価証券 7,400株
6758	ソニーグループ	1,695,800	12,660.00	21,468,828,000	
6762	T D K	392,100	4,555.00	1,786,015,500	貸付有価証券 64,500株
6763	帝国通信工業	11,900	1,360.00	16,184,000	貸付有価証券 2,600株
6768	タムラ製作所	104,300	647.00	67,482,100	貸付有価証券 24,200株
6770	アルプスアルパイン	239,600	1,268.00	303,812,800	貸付有価証券 39,500株
6771	池上通信機	8,000	643.00	5,144,000	貸付有価証券 1,400株
6779	日本電波工業	24,400	1,252.00	30,548,800	貸付有価証券 5,400株
6785	鈴木	13,300	865.00	11,504,500	貸付有価証券 2,400株
6787	メイコー	22,000	3,725.00	81,950,000	
6788	日本トリム	5,100	3,040.00	15,504,000	貸付有価証券 100株
6789	ローランド ディー．ジー．	16,000	2,642.00	42,272,000	貸付有価証券 1,000株
6794	フォスター電機	27,300	806.00	22,003,800	貸付有価証券 3,500株
6798	SMK	6,300	2,163.00	13,626,900	貸付有価証券 1,900株
6800	ヨコオ	20,000	2,629.00	52,580,000	貸付有価証券 3,700株
6803	ティアック	43,800	133.00	5,825,400	貸付有価証券 3,400株

6804	ホンデン	65,300	1,200.00	78,360,000	貸付有価証券 12,100株
6806	ヒロセ電機	41,700	17,280.00	720,576,000	貸付有価証券 3,500株
6807	日本航空電子工業	62,100	1,832.00	113,767,200	貸付有価証券 15,600株
6809	ＴＯＡ	29,000	777.00	22,533,000	貸付有価証券 4,500株
6810	マクセル	53,800	1,230.00	66,174,000	
6814	古野電気	32,200	1,054.00	33,938,800	貸付有価証券 8,500株
6815	ユニデンホールディングス	5,900	3,610.00	21,299,000	貸付有価証券 1,000株
6817	スミダコーポレーション	25,400	974.00	24,739,600	
6820	アイコム	10,000	2,360.00	23,600,000	貸付有価証券 1,500株
6823	リオン	10,300	2,193.00	22,587,900	貸付有価証券 1,000株
6826	本多通信工業	21,000	480.00	10,080,000	貸付有価証券 5,400株
6841	横河電機	270,900	1,868.00	506,041,200	貸付有価証券 40,800株
6844	新電元工業	10,400	3,375.00	35,100,000	貸付有価証券 1,600株
6845	アズビル	158,600	4,165.00	660,569,000	貸付有価証券 44,100株
6848	東亜ディーケーケー	13,400	905.00	12,127,000	貸付有価証券 2,200株
6849	日本光電工業	111,900	3,100.00	346,890,000	
6850	チノー	8,600	1,638.00	14,086,800	貸付有価証券 2,200株
6853	共和電業	25,900	378.00	9,790,200	貸付有価証券 4,600株
6855	日本電子材料	13,800	2,294.00	31,657,200	
6856	堀場製作所	50,000	6,050.00	302,500,000	貸付有価証券 5,800株
6857	アドバンテスト	201,200	9,220.00	1,855,064,000	貸付有価証券 32,800株
6858	小野測器	11,300	480.00	5,424,000	貸付有価証券 2,800株
6859	エスベック	22,000	2,014.00	44,308,000	
6861	キーエンス	245,300	58,760.00	14,413,828,000	貸付有価証券 1,600株
6866	日置電機	13,000	6,320.00	82,160,000	貸付有価証券 800株
6869	シスメックス	229,000	10,585.00	2,423,965,000	
6871	日本マイクロニクス	47,100	1,503.00	70,791,300	貸付有価証券 7,700株
6875	メガチップス	25,200	4,155.00	104,706,000	貸付有価証券 1,200株

6877	O B A R A G R O U P	12,300	3,270.00	40,221,000	貸付有価証券 3,600株
6901	澤藤電機	3,300	1,472.00	4,857,600	貸付有価証券 500株
6904	原田工業	12,800	981.00	12,556,800	貸付有価証券 2,100株
6905	コーセル	30,000	811.00	24,330,000	貸付有価証券 9,200株
6908	イリソ電子工業	22,700	4,240.00	96,248,000	貸付有価証券 5,100株
6914	オプテックスグループ	44,400	1,469.00	65,223,600	貸付有価証券 7,300株
6915	千代田インテグレ	11,400	1,865.00	21,261,000	貸付有価証券 2,000株
6916	アイ・オー・データ機器	8,700	857.00	7,455,900	貸付有価証券 2,200株
6920	レーザーテック	118,900	22,255.00	2,646,119,500	貸付有価証券 20,700株
6923	スタンレー電気	189,000	2,666.00	503,874,000	貸付有価証券 52,400株
6924	岩崎電気	9,900	2,249.00	22,265,100	貸付有価証券 1,700株
6925	ウシオ電機	138,800	1,847.00	256,363,600	
6926	岡谷電機産業	19,300	315.00	6,079,500	貸付有価証券 3,500株
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	23,000	288.00	6,624,000	貸付有価証券 4,100株
6928	エノモト	7,500	1,602.00	12,015,000	貸付有価証券 1,300株
6929	日本セラミック	25,200	2,508.00	63,201,600	貸付有価証券 2,000株
6932	遠藤照明	12,400	988.00	12,251,200	貸付有価証券 2,200株
6937	古河電池	19,300	1,231.00	23,758,300	貸付有価証券 4,200株
6938	双信電機	12,900	581.00	7,494,900	貸付有価証券 3,100株
6941	山一電機	19,600	2,188.00	42,884,800	貸付有価証券 1,400株
6947	図研	17,600	2,987.00	52,571,200	
6951	日本電子	56,300	6,250.00	351,875,000	
6952	カシオ計算機	195,900	1,397.00	273,672,300	貸付有価証券 39,000株
6954	ファナック	237,600	22,270.00	5,291,352,000	
6958	日本シイエムケイ	53,000	562.00	29,786,000	貸付有価証券 15,000株
6961	エンプラス	6,700	2,633.00	17,641,100	貸付有価証券 1,600株
6962	大真空	36,500	1,221.00	44,566,500	
6963	ローム	121,200	9,180.00	1,112,616,000	
6965	浜松ホトニクス	194,200	5,810.00	1,128,302,000	

6966	三井ハイテック	26,500	8,500.00	225,250,000	貸付有価証券 4,900株
6967	新光電気工業	79,500	4,975.00	395,512,500	
6971	京セラ	380,800	6,846.00	2,606,956,800	
6976	太陽誘電	131,300	5,290.00	694,577,000	貸付有価証券 19,600株
6981	村田製作所	795,200	8,234.00	6,547,676,800	貸付有価証券 130,500株
6986	双葉電子工業	46,400	673.00	31,227,200	貸付有価証券 7,000株
6989	北陸電気工業	10,100	1,254.00	12,665,400	貸付有価証券 1,800株
6996	ニチコン	85,200	1,198.00	102,069,600	貸付有価証券 14,900株
6997	日本ケミコン	25,600	1,863.00	47,692,800	
6999	K O A	40,800	1,448.00	59,078,400	貸付有価証券 10,000株
7244	市光工業	32,400	512.00	16,588,800	貸付有価証券 7,700株
7276	小糸製作所	148,600	5,850.00	869,310,000	貸付有価証券 26,500株
7280	ミツバ	49,800	415.00	20,667,000	貸付有価証券 8,200株
7735	S C R E E Nホールディングス	47,000	11,250.00	528,750,000	貸付有価証券 7,600株
7739	キャノン電子	24,800	1,612.00	39,977,600	
7751	キャノン	1,345,100	2,798.00	3,763,589,800	
7752	リコー	751,300	982.00	737,776,600	
7965	象印マホービン	73,200	1,473.00	107,823,600	貸付有価証券 13,000株
7999	M U T O Hホールディングス	3,400	2,092.00	7,112,800	貸付有価証券 600株
8035	東京エレクトロン	171,800	55,270.00	9,495,386,000	
3116	トヨタ紡織	110,400	2,180.00	240,672,000	貸付有価証券 20,800株
3526	芦森工業	5,100	897.00	4,574,700	貸付有価証券 900株
5949	ユニプレス	40,300	819.00	33,005,700	貸付有価証券 8,600株
6201	豊田自動織機	219,100	8,900.00	1,949,990,000	
6455	モリタホールディングス	43,400	1,265.00	54,901,000	
6584	三櫻工業	37,400	834.00	31,191,600	貸付有価証券 9,000株
6902	デンソー	596,000	8,500.00	5,066,000,000	貸付有価証券 97,500株
6995	東海理化電機製作所	71,300	1,545.00	110,158,500	貸付有価証券 17,000株
7012	川崎重工業	197,600	2,172.00	429,187,200	貸付有価証券 34,400株

7014	名村造船所	81,300	202.00	16,422,600	貸付有価証券 21,000株
7102	日本車輛製造	9,900	2,000.00	19,800,000	貸付有価証券 1,600株
7105	三菱ロジスネクスト	35,800	1,022.00	36,587,600	貸付有価証券 4,000株
7122	近畿車輛	4,100	1,087.00	4,456,700	貸付有価証券 700株
7201	日産自動車	3,192,500	598.90	1,911,988,250	
7202	いすゞ自動車	849,400	1,491.00	1,266,455,400	
7203	トヨタ自動車	13,711,800	2,275.50	31,201,200,900	貸付有価証券 989,300株
7205	日野自動車	338,000	1,060.00	358,280,000	
7211	三菱自動車工業	1,002,000	316.00	316,632,000	貸付有価証券 46,300株
7212	エフテック	18,900	540.00	10,206,000	貸付有価証券 3,100株
7213	レシップホールディングス	10,700	560.00	5,992,000	貸付有価証券 1,300株
7214	GMB	4,900	815.00	3,993,500	
7215	ファルテック	4,700	726.00	3,412,200	貸付有価証券 700株
7220	武蔵精密工業	60,400	1,756.00	106,062,400	貸付有価証券 9,900株
7222	日産車体	39,600	711.00	28,155,600	貸付有価証券 3,800株
7224	新明和工業	76,500	913.00	69,844,500	貸付有価証券 12,200株
7226	極東開発工業	50,300	1,453.00	73,085,900	貸付有価証券 13,300株
7231	トピー工業	22,300	1,113.00	24,819,900	貸付有価証券 3,600株
7236	ティラド	7,700	2,838.00	21,852,600	
7238	曙ブレーキ工業	148,600	172.00	25,559,200	貸付有価証券 41,300株
7239	タチエス	47,400	1,211.00	57,401,400	貸付有価証券 7,300株
7240	NOK	131,000	1,281.00	167,811,000	貸付有価証券 23,800株
7241	フタバ産業	67,800	411.00	27,865,800	貸付有価証券 12,300株
7242	KYB	28,100	3,060.00	85,986,000	貸付有価証券 5,400株
7245	大同メタル工業	51,900	636.00	33,008,400	貸付有価証券 4,100株
7246	プレス工業	134,100	381.00	51,092,100	貸付有価証券 44,000株
7247	ミクニ	34,300	458.00	15,709,400	貸付有価証券 5,600株
7250	太平洋工業	56,700	1,076.00	61,009,200	貸付有価証券 14,900株

7256	河西工業	33,200	314.00	10,424,800	貸付有価証券 6,000株
7259	アイシン	198,100	4,525.00	896,402,500	
7261	マツダ	849,600	882.00	749,347,200	貸付有価証券 130,600株
7266	今仙電機製作所	17,800	595.00	10,591,000	貸付有価証券 4,100株
7267	本田技研工業	2,131,400	3,403.00	7,253,154,200	貸付有価証券 122,100株
7269	スズキ	619,100	4,803.00	2,973,537,300	貸付有価証券 122,000株
7270	S U B A R U	775,700	2,012.50	1,561,096,250	貸付有価証券 60,000株
7271	安永	13,000	872.00	11,336,000	貸付有価証券 2,500株
7272	ヤマハ発動機	353,200	2,777.00	980,836,400	
7277	T B K	29,700	410.00	12,177,000	貸付有価証券 5,200株
7278	エクセディ	40,800	1,689.00	68,911,200	貸付有価証券 4,300株
7282	豊田合成	87,400	2,247.00	196,387,800	貸付有価証券 14,300株
7283	愛三工業	42,400	740.00	31,376,000	貸付有価証券 6,900株
7284	盟和産業	3,800	1,014.00	3,853,200	貸付有価証券 700株
7291	日本プラスト	21,200	559.00	11,850,800	貸付有価証券 3,500株
7294	ヨロズ	25,300	1,008.00	25,502,400	貸付有価証券 6,000株
7296	エフ・シー・シー	44,200	1,427.00	63,073,400	貸付有価証券 7,300株
7309	シマノ	108,700	25,940.00	2,819,678,000	
7313	テイ・エス テック	114,300	1,562.00	178,536,600	貸付有価証券 24,200株
7408	ジャムコ	15,800	831.00	13,129,800	貸付有価証券 3,000株
4543	テルモ	766,000	4,145.00	3,175,070,000	
5187	クリエートメディック	8,100	969.00	7,848,900	貸付有価証券 1,300株
6376	日機装	81,200	851.00	69,101,200	貸付有価証券 4,500株
7600	日本エム・ディ・エム	15,600	1,609.00	25,100,400	貸付有価証券 4,500株
7701	島津製作所	348,400	4,120.00	1,435,408,000	貸付有価証券 11,600株
7702	J M S	22,900	616.00	14,106,400	貸付有価証券 1,600株
7709	クボテック	5,800	260.00	1,508,000	貸付有価証券 1,600株

7715	長野計器	19,600	1,338.00	26,224,800	貸付有価証券 3,200株
7717	ブイ・テクノロジー	11,800	3,400.00	40,120,000	貸付有価証券 400株
7721	東京計器	17,200	1,017.00	17,492,400	
7723	愛知時計電機	11,700	1,912.00	22,370,400	貸付有価証券 600株
7725	インターアクション	13,500	1,958.00	26,433,000	貸付有価証券 3,600株
7727	オーバル	24,200	268.00	6,485,600	貸付有価証券 4,000株
7729	東京精密	45,700	4,540.00	207,478,000	貸付有価証券 8,000株
7730	マニー	107,800	1,653.00	178,193,400	貸付有価証券 6,300株
7731	ニコン	413,400	1,305.00	539,487,000	貸付有価証券 94,100株
7732	トプコン	127,300	1,486.00	189,167,800	
7733	オリンパス	1,419,600	2,263.00	3,212,554,800	貸付有価証券 245,800株
7734	理研計器	21,900	5,250.00	114,975,000	貸付有価証券 3,900株
7740	タムロン	21,000	2,514.00	52,794,000	貸付有価証券 4,800株
7741	HOYA	528,200	15,470.00	8,171,254,000	
7743	シード	12,600	523.00	6,589,800	貸付有価証券 1,900株
7744	ノーリツ銅機	24,300	2,084.00	50,641,200	貸付有価証券 3,000株
7745	エー・アンド・デイ	24,700	950.00	23,465,000	貸付有価証券 6,100株
7747	朝日インテック	296,800	1,940.00	575,792,000	貸付有価証券 9,800株
7762	シチズン時計	317,000	505.00	160,085,000	貸付有価証券 51,600株
7769	リズム	8,500	1,310.00	11,135,000	貸付有価証券 1,400株
7775	大研医器	21,400	527.00	11,277,800	貸付有価証券 3,100株
7780	メニコン	89,700	2,716.00	243,625,200	貸付有価証券 5,200株
7782	シンシア	2,900	532.00	1,542,800	
7979	松風	11,300	1,917.00	21,662,100	貸付有価証券 2,500株
8050	セイコーホールディングス	38,300	2,203.00	84,374,900	貸付有価証券 1,200株
8086	ニプロ	201,700	1,068.00	215,415,600	貸付有価証券 22,800株
7811	中本パックス	7,600	1,732.00	13,163,200	貸付有価証券 1,100株

7816	スノーピーク	35,300	2,308.00	81,472,400	貸付有価証券 5,000株
7817	パラマウントベッドホールディングス	51,900	1,934.00	100,374,600	
7818	トランザクション	14,800	1,018.00	15,066,400	貸付有価証券 2,900株
7819	粧美堂	7,900	413.00	3,262,700	
7820	ニホンフラッシュ	23,200	1,063.00	24,661,600	貸付有価証券 5,600株
7821	前田工織	29,800	3,155.00	94,019,000	貸付有価証券 6,900株
7822	永大産業	35,400	307.00	10,867,800	貸付有価証券 5,800株
7823	アートネイチャー	23,100	693.00	16,008,300	貸付有価証券 1,300株
7832	バンダイナムコホールディングス	242,600	8,531.00	2,069,620,600	
7833	アイフィスジャパン	6,900	673.00	4,643,700	貸付有価証券 1,100株
7838	共立印刷	45,300	144.00	6,523,200	貸付有価証券 7,400株
7839	SHOEI	25,400	4,375.00	111,125,000	貸付有価証券 6,000株
7840	フランスベッドホールディングス	34,800	903.00	31,424,400	貸付有価証券 7,700株
7846	パイロットコーポレーション	45,700	4,210.00	192,397,000	貸付有価証券 7,700株
7856	萩原工業	17,500	1,201.00	21,017,500	貸付有価証券 3,300株
7864	フジシールインターナショナル	65,700	2,144.00	140,860,800	貸付有価証券 3,600株
7867	タカラトミー	113,300	1,164.00	131,881,200	貸付有価証券 19,800株
7868	広済堂ホールディングス	16,800	777.00	13,053,600	貸付有価証券 3,100株
7872	エステールホールディングス	6,500	638.00	4,147,000	
7885	タカノ	9,200	696.00	6,403,200	貸付有価証券 1,700株
7893	プロネクサス	21,000	1,082.00	22,722,000	貸付有価証券 3,800株
7897	ホクシン	19,100	155.00	2,960,500	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	8,300	998.00	8,283,400	貸付有価証券 1,400株
7905	大建工業	15,900	2,145.00	34,105,500	
7911	凸版印刷	411,500	2,184.00	898,716,000	貸付有価証券 112,200株
7912	大日本印刷	319,900	2,739.00	876,206,100	貸付有価証券 61,700株
7914	共同印刷	7,700	2,713.00	20,890,100	貸付有価証券 2,300株
7915	N I S S H A	55,600	1,486.00	82,621,600	貸付有価証券 3,900株

7916	光村印刷	2,300	1,410.00	3,243,000	
7921	TAKARA & COMPANY	16,600	1,880.00	31,208,000	
7936	アシックス	239,400	2,392.00	572,644,800	貸付有価証券 9,700株
7937	ツツミ	6,800	1,863.00	12,668,400	貸付有価証券 1,400株
7944	ローランド	18,800	4,355.00	81,874,000	貸付有価証券 4,700株
7949	小松ウオール工業	8,200	1,847.00	15,145,400	
7951	ヤマハ	157,400	5,370.00	845,238,000	
7952	河合楽器製作所	7,600	2,978.00	22,632,800	
7955	クリナップ	25,200	533.00	13,431,600	貸付有価証券 4,100株
7956	ビジョン	163,600	2,201.00	360,083,600	
7961	兼松サステック	1,700	1,650.00	2,805,000	
7962	キングジム	23,800	874.00	20,801,200	貸付有価証券 3,600株
7966	リンテック	58,000	2,579.00	149,582,000	貸付有価証券 5,400株
7972	イトーキ	49,900	348.00	17,365,200	貸付有価証券 12,500株
7974	任天堂	152,800	58,490.00	8,937,272,000	
7976	三菱鉛筆	44,600	1,229.00	54,813,400	貸付有価証券 3,600株
7981	タカラスタANDARD	55,900	1,362.00	76,135,800	貸付有価証券 9,100株
7984	コクヨ	129,800	1,700.00	220,660,000	
7987	ナカバヤシ	24,200	516.00	12,487,200	貸付有価証券 7,800株
7990	グローブライド	24,200	2,725.00	65,945,000	貸付有価証券 4,000株
7994	オカムラ	93,000	1,196.00	111,228,000	貸付有価証券 15,400株
8022	美津濃	26,800	2,261.00	60,594,800	貸付有価証券 4,000株
9501	東京電力ホールディングス	2,025,900	357.00	723,246,300	貸付有価証券 513,300株
9502	中部電力	828,200	1,122.00	929,240,400	
9503	関西電力	1,025,600	1,070.00	1,097,392,000	
9504	中国電力	423,000	873.00	369,279,000	貸付有価証券 61,200株
9505	北陸電力	247,500	532.00	131,670,000	貸付有価証券 42,800株
9506	東北電力	634,000	725.00	459,650,000	貸付有価証券 110,300株
9507	四国電力	243,700	784.00	191,060,800	
9508	九州電力	557,900	823.00	459,151,700	
9509	北海道電力	235,200	503.00	118,305,600	

9511	沖縄電力	57,400	1,405.00	80,647,000	貸付有価証券 13,800株
9513	電源開発	230,800	1,970.00	454,676,000	貸付有価証券 17,900株
9514	エフオン	16,400	542.00	8,888,800	貸付有価証券 2,100株
9517	イーレックス	39,800	1,469.00	58,466,200	貸付有価証券 7,300株
9519	レノバ	52,900	1,495.00	79,085,500	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	518,900	2,299.00	1,192,951,100	貸付有価証券 85,200株
9532	大阪瓦斯	490,300	2,037.00	998,741,100	
9533	東邦瓦斯	124,300	3,150.00	391,545,000	
9534	北海道瓦斯	13,400	1,498.00	20,073,200	
9535	広島ガス	51,600	358.00	18,472,800	貸付有価証券 4,300株
9536	西部ガスホールディングス	30,500	2,180.00	66,490,000	貸付有価証券 5,000株
9543	静岡ガス	70,400	996.00	70,118,400	貸付有価証券 12,600株
9551	メタウォーター	28,100	2,019.00	56,733,900	貸付有価証券 2,200株
2384	SBSホールディングス	20,000	3,270.00	65,400,000	
9001	東武鉄道	264,500	2,839.00	750,915,500	貸付有価証券 13,900株
9003	相鉄ホールディングス	86,600	2,134.00	184,804,400	貸付有価証券 17,500株
9005	東急	682,700	1,564.00	1,067,742,800	
9006	京浜急行電鉄	347,600	1,185.00	411,906,000	貸付有価証券 57,000株
9007	小田急電鉄	402,600	2,032.00	818,083,200	
9008	京王電鉄	140,500	5,150.00	723,575,000	貸付有価証券 23,100株
9009	京成電鉄	188,400	3,200.00	602,880,000	
9010	富士急行	32,300	3,895.00	125,808,500	貸付有価証券 100株
9014	新京成電鉄	6,300	2,003.00	12,618,900	
9020	東日本旅客鉄道	476,400	6,955.00	3,313,362,000	貸付有価証券 112,700株
9021	西日本旅客鉄道	328,100	4,938.00	1,620,157,800	貸付有価証券 25,700株
9022	東海旅客鉄道	225,100	14,950.00	3,365,245,000	貸付有価証券 49,000株
9024	西武ホールディングス	353,400	1,186.00	419,132,400	貸付有価証券 82,700株
9025	鴻池運輸	43,100	1,171.00	50,470,100	貸付有価証券 7,100株
9031	西日本鉄道	75,000	2,538.00	190,350,000	貸付有価証券 14,300株

9037	ハマキョウレックス	19,200	2,867.00	55,046,400	貸付有価証券 1,800株
9039	サカイ引越センター	12,400	4,390.00	54,436,000	貸付有価証券 1,000株
9041	近鉄グループホールディングス	256,400	3,415.00	875,606,000	貸付有価証券 41,900株
9042	阪急阪神ホールディングス	320,600	3,450.00	1,106,070,000	貸付有価証券 55,900株
9044	南海電気鉄道	114,400	2,308.00	264,035,200	
9045	京阪ホールディングス	114,100	2,771.00	316,171,100	
9046	神戸電鉄	6,100	3,255.00	19,855,500	
9048	名古屋鉄道	210,800	1,829.00	385,553,200	
9052	山陽電気鉄道	19,700	2,000.00	39,400,000	貸付有価証券 3,700株
9055	アルプス物流	17,900	1,014.00	18,150,600	貸付有価証券 200株
9064	ヤマトホールディングス	359,200	2,483.00	891,893,600	
9065	山九	67,500	4,075.00	275,062,500	
9067	丸運	14,600	242.00	3,533,200	貸付有価証券 2,400株
9068	丸全昭和運輸	20,800	3,185.00	66,248,000	貸付有価証券 3,500株
9069	センコーグループホールディングス	128,500	924.00	118,734,000	貸付有価証券 12,000株
9070	トナミホールディングス	6,200	3,690.00	22,878,000	貸付有価証券 1,000株
9072	ニッコンホールディングス	86,000	2,120.00	182,320,000	
9074	日本石油輸送	2,800	2,641.00	7,394,800	
9075	福山通運	42,200	3,650.00	154,030,000	貸付有価証券 7,400株
9076	セイノーホールディングス	174,500	1,145.00	199,802,500	貸付有価証券 52,600株
9078	エスライン	7,700	897.00	6,906,900	貸付有価証券 1,300株
9081	神奈川中央交通	6,400	3,360.00	21,504,000	
9086	日立物流	49,500	5,360.00	265,320,000	貸付有価証券 7,800株
9090	丸和運輸機関	54,100	1,160.00	62,756,000	貸付有価証券 8,800株
9099	C＆Fロジホールディングス	25,900	1,353.00	35,042,700	貸付有価証券 4,200株
9142	九州旅客鉄道	198,300	2,433.00	482,463,900	
9143	S Gホールディングス	484,400	2,364.00	1,145,121,600	
9147	N I P P O N E X P R E S S ホール ディン	88,800	6,750.00	599,400,000	
9101	日本郵船	214,400	9,280.00	1,989,632,000	貸付有価証券 35,100株
9104	商船三井	141,900	8,690.00	1,233,111,000	貸付有価証券 26,400株

9107	川崎汽船	78,900	6,730.00	530,997,000	貸付有価証券 12,900株
9110	N S ユナイテッド海運	14,100	3,555.00	50,125,500	貸付有価証券 2,300株
9115	明治海運	30,300	815.00	24,694,500	貸付有価証券 8,700株
9119	飯野海運	119,000	553.00	65,807,000	貸付有価証券 19,800株
9130	共栄タンカー	4,500	924.00	4,158,000	貸付有価証券 1,300株
9308	乾汽船	17,500	2,349.00	41,107,500	貸付有価証券 4,300株
9201	日本航空	587,800	2,290.00	1,346,062,000	貸付有価証券 76,800株
9202	A N A ホールディングス	651,200	2,586.00	1,684,003,200	貸付有価証券 155,100株
9232	パスコ	4,800	1,317.00	6,321,600	貸付有価証券 800株
9058	トランコム	7,200	7,420.00	53,424,000	貸付有価証券 1,200株
9066	日新	20,400	1,666.00	33,986,400	貸付有価証券 3,600株
9301	三菱倉庫	81,300	2,810.00	228,453,000	貸付有価証券 8,000株
9302	三井倉庫ホールディングス	27,200	2,369.00	64,436,800	貸付有価証券 1,200株
9303	住友倉庫	90,600	2,083.00	188,719,800	貸付有価証券 21,500株
9304	澁澤倉庫	15,300	2,132.00	32,619,600	貸付有価証券 2,300株
9306	東陽倉庫	43,000	316.00	13,588,000	貸付有価証券 7,600株
9310	日本トランスシティ	56,400	639.00	36,039,600	貸付有価証券 9,200株
9312	ケイヒン	4,400	1,384.00	6,089,600	貸付有価証券 800株
9319	中央倉庫	15,600	971.00	15,147,600	貸付有価証券 2,600株
9322	川西倉庫	4,700	1,093.00	5,137,100	
9324	安田倉庫	21,100	960.00	20,256,000	貸付有価証券 3,400株
9325	ファイズホールディングス	5,500	611.00	3,360,500	貸付有価証券 900株
9351	東洋埠頭	7,800	1,462.00	11,403,600	貸付有価証券 1,300株
9364	上組	141,000	2,242.00	316,122,000	
9366	サンリツ	7,100	840.00	5,964,000	貸付有価証券 400株
9368	キムラユニティー	6,700	1,359.00	9,105,300	貸付有価証券 1,100株
9369	キューソー流通システム	12,800	900.00	11,520,000	

9375	近鉄エクスプレス	48,400	2,980.00	144,232,000	貸付有価証券 13,700株
9380	東海運	14,600	306.00	4,467,600	貸付有価証券 2,000株
9381	エーアイテイー	16,100	1,453.00	23,393,300	貸付有価証券 3,800株
9384	内外トランスライン	9,900	1,941.00	19,215,900	貸付有価証券 1,500株
9386	日本コンセプト	8,200	1,341.00	10,996,200	貸付有価証券 1,300株
1973	NECネットエスアイ	87,800	1,732.00	152,069,600	
2307	クロスキャット	7,000	1,651.00	11,557,000	貸付有価証券 1,100株
2317	システナ	378,900	360.00	136,404,000	
2326	デジタルアーツ	14,300	6,520.00	93,236,000	貸付有価証券 2,500株
2327	日鉄ソリューションズ	38,500	3,605.00	138,792,500	
2335	キューブシステム	13,400	931.00	12,475,400	貸付有価証券 2,300株
2352	WOW WORLD	3,800	1,181.00	4,487,800	貸付有価証券 800株
2359	コア	11,200	1,545.00	17,304,000	貸付有価証券 2,100株
3031	ラクーンホールディングス	22,600	1,196.00	27,029,600	貸付有価証券 2,100株
3040	ソリトンシステムズ	13,300	1,274.00	16,944,200	貸付有価証券 3,300株
3371	ソフトクリエイイトホールディングス	11,600	3,770.00	43,732,000	貸付有価証券 1,900株
3626	T I S	253,300	2,759.00	698,854,700	
3627	J N Sホールディングス	12,200	413.00	5,038,600	貸付有価証券 2,400株
3632	グリー	120,900	847.00	102,402,300	貸付有価証券 48,400株
3633	GMOペパボ	2,800	2,285.00	6,398,000	貸付有価証券 700株
3635	コーエーテクモホールディングス	84,700	4,135.00	350,234,500	貸付有価証券 11,500株
3636	三菱総合研究所	11,400	3,845.00	43,833,000	貸付有価証券 1,000株
3639	ボルテージ	7,100	328.00	2,328,800	貸付有価証券 900株
3640	電算	2,900	2,251.00	6,527,900	
3648	A G S	13,500	806.00	10,881,000	貸付有価証券 2,400株
3649	ファインデックス	22,400	929.00	20,809,600	貸付有価証券 4,300株
3655	ブレインパッド	22,500	1,136.00	25,560,000	貸付有価証券 600株
3656	K L a b	48,700	435.00	21,184,500	貸付有価証券 2,200株

3657	ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	38,500	987.00	37,999,500	貸付有価証券 6,000株
3659	ネクソン	599,300	2,339.00	1,401,762,700	
3660	アイスタイル	68,500	203.00	13,905,500	
3661	エムアップホールディングス	30,700	790.00	24,253,000	貸付有価証券 1,000株
3662	エイチーム	18,300	744.00	13,615,200	貸付有価証券 3,600株
3665	エニグモ	28,700	641.00	18,396,700	貸付有価証券 4,200株
3666	テクノスジャパン	20,600	454.00	9,352,400	貸付有価証券 3,400株
3667	e n i s h	16,300	361.00	5,884,300	貸付有価証券 1,900株
3668	コロプラ	87,300	678.00	59,189,400	貸付有価証券 29,000株
3672	オルトプラス	20,500	317.00	6,498,500	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	131,600	349.00	45,928,400	貸付有価証券 8,800株
3675	クロス・マーケティンググループ	10,100	860.00	8,686,000	貸付有価証券 2,400株
3676	デジタルハーツホールディングス	12,000	1,798.00	21,576,000	貸付有価証券 1,300株
3677	システム情報	19,900	939.00	18,686,100	貸付有価証券 3,600株
3678	メディアドゥ	9,300	2,546.00	23,677,800	
3679	じげん	75,100	308.00	23,130,800	
3681	ブイキューブ	27,000	806.00	21,762,000	貸付有価証券 1,000株
3682	エンカレッジ・テクノロジー	5,800	543.00	3,149,400	貸付有価証券 700株
3683	サイバーリンクス	8,900	885.00	7,876,500	貸付有価証券 3,400株
3686	ディー・エル・イー	17,800	223.00	3,969,400	貸付有価証券 3,300株
3687	フィックスターズ	28,300	726.00	20,545,800	貸付有価証券 4,600株
3688	CARTA HOLDINGS	10,800	1,939.00	20,941,200	貸付有価証券 2,800株
3694	オプティム	18,500	1,003.00	18,555,500	貸付有価証券 800株
3696	セレス	9,900	1,897.00	18,780,300	貸付有価証券 1,800株
3697	S H I F T	13,400	20,500.00	274,700,000	貸付有価証券 800株
3738	ティーガイア	23,600	1,675.00	39,530,000	
3741	セック	3,900	2,218.00	8,650,200	貸付有価証券 600株
3762	テクマトリックス	44,900	1,568.00	70,403,200	貸付有価証券 1,200株

3763	プロシップ	8,800	1,350.00	11,880,000	貸付有価証券 1,200株
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	69,000	2,443.00	168,567,000	貸付有価証券 4,500株
3769	GMOペイメントゲートウェイ	51,500	9,960.00	512,940,000	貸付有価証券 9,700株
3770	ザッパラス	10,300	477.00	4,913,100	貸付有価証券 3,000株
3771	システムリサーチ	7,700	1,760.00	13,552,000	
3774	インターネットイニシアティブ	70,700	3,890.00	275,023,000	
3778	さくらインターネット	28,500	506.00	14,421,000	貸付有価証券 4,700株
3784	ヴィンクス	7,400	825.00	6,105,000	貸付有価証券 1,300株
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,900	3,550.00	20,945,000	貸付有価証券 1,200株
3817	S R Aホールディングス	12,800	2,934.00	37,555,200	貸付有価証券 2,300株
3826	システムインテグレータ	8,400	553.00	4,645,200	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	24,200	620.00	15,004,000	貸付有価証券 3,100株
3835	e B A S E	31,700	565.00	17,910,500	貸付有価証券 6,200株
3836	アバント	28,500	1,139.00	32,461,500	貸付有価証券 3,700株
3837	アドソル日進	9,500	1,656.00	15,732,000	貸付有価証券 1,700株
3839	ODKソリューションズ	5,500	637.00	3,503,500	
3843	フリービット	13,800	908.00	12,530,400	貸付有価証券 1,300株
3844	コムチュア	29,800	2,961.00	88,237,800	貸付有価証券 6,700株
3852	サイバーコム	4,000	1,089.00	4,356,000	貸付有価証券 800株
3853	アステリア	19,100	896.00	17,113,600	貸付有価証券 2,600株
3854	アイル	14,700	1,255.00	18,448,500	貸付有価証券 2,200株
3901	マークライNZ	13,300	2,421.00	32,199,300	貸付有価証券 100株
3902	メディカル・データ・ビジョン	33,600	1,022.00	34,339,200	貸付有価証券 4,500株
3903	g u m i	36,800	586.00	21,564,800	貸付有価証券 10,000株
3909	ショーケース	5,800	458.00	2,656,400	貸付有価証券 1,000株
3912	モバイルファクトリー	6,000	1,028.00	6,168,000	貸付有価証券 1,200株
3915	テラスカイ	9,700	1,469.00	14,249,300	貸付有価証券 3,700株

3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	11,700	1,212.00	14,180,400	貸付有価証券 400株
3918	P C I ホールディングス	11,900	1,046.00	12,447,400	貸付有価証券 2,300株
3919	パイプドHD	4,800	2,575.00	12,360,000	
3920	アイビーシー	4,300	660.00	2,838,000	貸付有価証券 800株
3921	ネオジャパン	7,500	1,075.00	8,062,500	貸付有価証券 1,000株
3922	P R T I M E S	5,700	2,811.00	16,022,700	貸付有価証券 1,000株
3923	ラクス	91,400	2,192.00	200,348,800	
3924	ランドコンピュータ	6,000	821.00	4,926,000	貸付有価証券 900株
3925	ダブルスタンダード	8,000	2,467.00	19,736,000	貸付有価証券 200株
3926	オーブンドア	15,800	1,658.00	26,196,400	貸付有価証券 2,200株
3928	マイネット	9,500	503.00	4,778,500	貸付有価証券 2,000株
3932	アカツキ	11,800	2,943.00	34,727,400	貸付有価証券 800株
3934	ベネフィットジャパン	2,000	2,116.00	4,232,000	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	7,000	2,270.00	15,890,000	貸付有価証券 1,000株
3939	カナミックネットワーク	28,300	453.00	12,819,900	貸付有価証券 4,800株
3940	ノムラシステムコーポレーション	13,600	255.00	3,468,000	貸付有価証券 2,000株
3962	チェンジ	49,000	1,422.00	69,678,000	貸付有価証券 5,400株
3963	シンクロ・フード	13,600	313.00	4,256,800	貸付有価証券 1,900株
3964	オークネット	14,100	1,521.00	21,446,100	貸付有価証券 400株
3965	キャピタル・アセット・プランニング	5,300	791.00	4,192,300	貸付有価証券 900株
3968	セグエグループ	6,800	579.00	3,937,200	貸付有価証券 800株
3969	エイトレッド	3,800	2,109.00	8,014,200	貸付有価証券 500株
3978	マクロミル	57,700	1,102.00	63,585,400	貸付有価証券 11,700株
3981	ビーグリー	6,300	1,150.00	7,245,000	貸付有価証券 1,500株
3983	オロ	8,400	2,330.00	19,572,000	貸付有価証券 1,700株
3984	ユーザーローカル	8,000	1,460.00	11,680,000	貸付有価証券 1,400株
3985	テモナ	5,700	425.00	2,422,500	貸付有価証券 1,000株

3992	ニーズウェル	6,000	611.00	3,666,000	貸付有価証券 500株
3994	マネーフォワード	40,400	4,970.00	200,788,000	貸付有価証券 7,100株
3996	サインポスト	8,600	899.00	7,731,400	貸付有価証券 400株
4072	電算システムホールディングス	10,900	2,628.00	28,645,200	貸付有価証券 2,200株
4284	ソルクシーズ	22,500	418.00	9,405,000	貸付有価証券 4,000株
4295	フェイス	7,000	666.00	4,662,000	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	28,200	1,260.00	35,532,000	貸付有価証券 3,900株
4299	ハイマックス	7,000	1,197.00	8,379,000	貸付有価証券 1,200株
4307	野村総合研究所	513,300	4,040.00	2,073,732,000	
4312	サイバネットシステム	18,900	632.00	11,944,800	貸付有価証券 5,800株
4320	C Eホールディングス	14,000	481.00	6,734,000	貸付有価証券 2,500株
4323	日本システム技術	5,200	2,187.00	11,372,400	貸付有価証券 900株
4326	インテージホールディングス	30,600	1,861.00	56,946,600	貸付有価証券 8,600株
4333	東邦システムサイエンス	7,000	930.00	6,510,000	貸付有価証券 300株
4344	ソースネクスト	114,500	159.00	18,205,500	貸付有価証券 20,400株
4348	インフォコム	29,000	1,945.00	56,405,000	貸付有価証券 1,900株
4373	シンプレクス・ホールディングス	31,000	2,072.00	64,232,000	貸付有価証券 4,700株
4382	HEROZ	7,600	927.00	7,045,200	貸付有価証券 1,100株
4384	ラクスル	29,100	3,640.00	105,924,000	貸付有価証券 4,800株
4390	I P S	7,300	1,839.00	13,424,700	貸付有価証券 1,100株
4392	F I G	28,800	283.00	8,150,400	貸付有価証券 5,000株
4396	システムサポート	9,600	962.00	9,235,200	貸付有価証券 1,100株
4420	イーソル	16,200	544.00	8,812,800	貸付有価証券 3,300株
4423	アルテリア・ネットワークス	33,600	1,376.00	46,233,600	貸付有価証券 1,900株
4427	E d u L a b	2,500	751.00	1,877,500	
4430	東海ソフト	4,100	916.00	3,755,600	貸付有価証券 700株
4432	ウイングアーク 1 s t	15,100	1,393.00	21,034,300	

4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	6,000	1,945.00	11,670,000	貸付有価証券 800株
4434	サーバーワークス	4,500	2,356.00	10,602,000	貸付有価証券 500株
4439	東名	2,500	951.00	2,377,500	貸付有価証券 500株
4440	ヴィッツ	2,400	1,296.00	3,110,400	貸付有価証券 400株
4441	トビラシシステムズ	5,300	819.00	4,340,700	貸付有価証券 900株
4443	S a n s a n	94,400	1,225.00	115,640,000	貸付有価証券 16,400株
4446	L i n k－U	4,800	753.00	3,614,400	貸付有価証券 1,100株
4449	ギフティ	24,200	1,092.00	26,426,400	貸付有価証券 1,800株
4481	ベース	4,500	4,390.00	19,755,000	貸付有価証券 800株
4483	J M D C	24,900	4,955.00	123,379,500	
4662	フォーカスシステムズ	17,800	931.00	16,571,800	貸付有価証券 2,700株
4674	クレスコ	19,300	1,695.00	32,713,500	貸付有価証券 700株
4676	フジ・メディア・ホールディングス	255,900	1,253.00	320,642,700	
4684	オービック	83,700	18,840.00	1,576,908,000	貸付有価証券 15,000株
4686	ジャストシステム	37,800	4,930.00	186,354,000	貸付有価証券 7,000株
4687	T D Cソフト	23,200	1,044.00	24,220,800	貸付有価証券 3,800株
4689	Zホールディングス	3,860,800	579.10	2,235,789,280	貸付有価証券 698,900株
4704	トレンドマイクロ	141,900	6,130.00	869,847,000	貸付有価証券 3,200株
4709	I Dホールディングス	16,700	849.00	14,178,300	貸付有価証券 2,400株
4716	日本オラクル	43,100	8,360.00	360,316,000	
4719	アルファシステムズ	7,100	3,725.00	26,447,500	貸付有価証券 2,400株
4722	フューチャー	56,100	1,461.00	81,962,100	貸付有価証券 15,400株
4725	C A C H o l d i n g s	15,500	1,345.00	20,847,500	貸付有価証券 2,700株
4726	S Bテクノロジー	11,500	2,423.00	27,864,500	貸付有価証券 200株
4728	トーセ	7,200	723.00	5,205,600	
4733	オービックビジネスコンサルタント	25,300	4,345.00	109,928,500	貸付有価証券 2,600株
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	121,000	2,946.00	356,466,000	貸付有価証券 29,400株

4743	アイティフォー	32,200	777.00	25,019,400	貸付有価証券 5,200株
4746	東計電算	3,100	4,775.00	14,802,500	貸付有価証券 100株
4762	エックスネット	4,200	963.00	4,044,600	
4768	大塚商会	143,700	4,275.00	614,317,500	貸付有価証券 10,700株
4776	サイボウズ	35,500	1,434.00	50,907,000	貸付有価証券 8,300株
4812	電通国際情報サービス	38,300	3,495.00	133,858,500	貸付有価証券 4,000株
4813	A C C E S S	30,000	587.00	17,610,000	
4819	デジタルガレージ	43,900	3,730.00	163,747,000	貸付有価証券 600株
4820	EMシステムズ	43,800	654.00	28,645,200	貸付有価証券 3,200株
4825	ウェザーニューズ	9,000	7,920.00	71,280,000	貸付有価証券 1,800株
4826	C I J	17,200	811.00	13,949,200	貸付有価証券 3,200株
4828	ビジネスエンジニアリング	3,000	3,455.00	10,365,000	貸付有価証券 600株
4829	日本エンタープライズ	27,000	171.00	4,617,000	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	12,700	1,739.00	22,085,300	貸付有価証券 1,800株
4845	スカラ	22,300	670.00	14,941,000	貸付有価証券 3,600株
4847	インテリジェント ウェイブ	13,300	557.00	7,408,100	貸付有価証券 2,300株
6879	I M A G I C A G R O U P	22,600	583.00	13,175,800	貸付有価証券 5,100株
7518	ネットワンシステムズ	101,200	2,733.00	276,579,600	
7527	システムソフト	57,000	103.00	5,871,000	貸付有価証券 14,500株
7595	アルゴグラフィックス	20,700	3,110.00	64,377,000	貸付有価証券 2,700株
7844	マーベラス	41,800	724.00	30,263,200	貸付有価証券 4,300株
7860	エイベックス	45,800	1,338.00	61,280,400	
8056	日本ユニシス	82,900	3,135.00	259,891,500	
8096	兼松エレクトロニクス	14,400	3,850.00	55,440,000	貸付有価証券 2,400株
8157	都築電気	13,600	1,402.00	19,067,200	貸付有価証券 1,400株
9401	T B Sホールディングス	161,500	1,823.00	294,414,500	貸付有価証券 27,000株
9404	日本テレビホールディングス	221,700	1,328.00	294,417,600	貸付有価証券 16,500株
9405	朝日放送グループホールディングス	26,400	708.00	18,691,200	

9409	テレビ朝日ホールディングス	63,800	1,609.00	102,654,200	貸付有価証券 3,900株
9412	スカパーＪＳＡＴホールディングス	225,000	451.00	101,475,000	貸付有価証券 19,500株
9413	テレビ東京ホールディングス	19,000	2,035.00	38,665,000	
9414	日本ＢＳ放送	9,000	1,095.00	9,855,000	貸付有価証券 100株
9416	ビジョン	45,400	1,044.00	47,397,600	貸付有価証券 1,200株
9417	スマートバリュー	6,000	473.00	2,838,000	貸付有価証券 1,400株
9418	USEN-NEXT HOLDING S	25,200	2,523.00	63,579,600	貸付有価証券 1,600株
9419	ワイヤレスゲート	10,900	332.00	3,618,800	貸付有価証券 2,100株
9422	コネクシオ	18,800	1,409.00	26,489,200	
9424	日本通信	220,900	199.00	43,959,100	貸付有価証券 41,000株
9428	クロップス	4,800	879.00	4,219,200	貸付有価証券 800株
9432	日本電信電話	2,778,900	3,349.00	9,306,536,100	
9433	KDDI	1,936,500	3,745.00	7,252,192,500	
9434	ソフトバンク	4,023,300	1,441.00	5,797,575,300	
9435	光通信	30,600	14,130.00	432,378,000	貸付有価証券 500株
9438	エムティーアイ	25,700	566.00	14,546,200	貸付有価証券 6,900株
9449	GMOインターネット	94,000	2,494.00	234,436,000	貸付有価証券 21,300株
9450	ファイバーゲート	12,100	1,202.00	14,544,200	貸付有価証券 1,400株
9466	アイドママーケティングコミュニケー ション	5,700	287.00	1,635,900	貸付有価証券 1,300株
9468	KADOKAWA	145,000	2,283.00	331,035,000	
9470	学研ホールディングス	37,500	1,069.00	40,087,500	貸付有価証券 5,200株
9474	ゼンリン	43,300	1,036.00	44,858,800	貸付有価証券 10,100株
9475	昭文社ホールディングス	10,700	438.00	4,686,600	貸付有価証券 2,000株
9479	インプレスホールディングス	22,000	211.00	4,642,000	貸付有価証券 3,600株
9600	アイネット	13,700	1,283.00	17,577,100	貸付有価証券 2,200株
9601	松竹	17,600	12,060.00	212,256,000	貸付有価証券 2,900株
9602	東宝	156,700	4,765.00	746,675,500	貸付有価証券 2,600株
9605	東映	8,700	17,600.00	153,120,000	貸付有価証券 100株

9613	エヌ・ティ・ティ・データ	707,200	2,256.00	1,595,443,200	貸付有価証券 115,700株
9629	ピー・シー・エー	15,500	1,542.00	23,901,000	貸付有価証券 2,400株
9658	ビジネスブレイン太田昭和	9,100	1,731.00	15,752,100	貸付有価証券 1,800株
9682	D T S	50,900	2,590.00	131,831,000	貸付有価証券 16,100株
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	123,600	5,930.00	732,948,000	
9692	シーイーシー	28,400	1,088.00	30,899,200	貸付有価証券 4,700株
9697	カプコン	250,400	2,893.00	724,407,200	貸付有価証券 40,800株
9702	アイ・エス・ビー	12,400	924.00	11,457,600	貸付有価証券 2,000株
9717	ジャステック	15,400	1,043.00	16,062,200	貸付有価証券 4,500株
9719	S C S K	183,900	1,956.00	359,708,400	貸付有価証券 14,200株
9739	日本システムウエア	10,000	2,129.00	21,290,000	
9742	アイネス	24,100	1,501.00	36,174,100	貸付有価証券 5,100株
9746	T K C	44,900	2,976.00	133,622,400	貸付有価証券 1,300株
9749	富士ソフト	28,300	5,000.00	141,500,000	貸付有価証券 3,200株
9759	N S D	85,400	2,075.00	177,205,000	貸付有価証券 21,800株
9766	コナミホールディングス	96,500	7,000.00	675,500,000	貸付有価証券 25,400株
9790	福井コンピュータホールディングス	12,200	2,985.00	36,417,000	
9889	J B C Cホールディングス	17,900	1,502.00	26,885,800	
9928	ミロク情報サービス	23,400	1,287.00	30,115,800	貸付有価証券 1,500株
9984	ソフトバンクグループ	1,592,800	5,350.00	8,521,480,000	
1352	ハウスイ	2,100	836.00	1,755,600	
2676	高千穂交易	10,300	1,595.00	16,428,500	貸付有価証券 1,700株
2689	オルバヘルスケアホールディングス	4,300	1,472.00	6,329,600	
2692	伊藤忠食品	6,400	4,945.00	31,648,000	
2715	エレマテック	21,300	1,051.00	22,386,300	貸付有価証券 4,100株
2729	J A L U X	7,500	2,558.00	19,185,000	
2733	あらた	21,200	3,850.00	81,620,000	貸付有価証券 3,500株
2737	トーマンデバイス	4,000	6,420.00	25,680,000	貸付有価証券 600株
2760	東京エレクトロン デバイス	7,900	5,390.00	42,581,000	貸付有価証券 1,600株

2767	フィールズ	23,300	505.00	11,766,500	
2768	双日	294,500	1,916.00	564,262,000	貸付有価証券 7,400株
2784	アルフレッサ ホールディングス	296,300	1,697.00	502,821,100	
2874	横浜冷凍	74,700	863.00	64,466,100	貸付有価証券 13,400株
3004	神栄	3,700	897.00	3,318,900	貸付有価証券 600株
3023	ラサ商事	14,100	1,036.00	14,607,600	貸付有価証券 2,300株
3036	アルコニックス	33,100	1,354.00	44,817,400	
3038	神戸物産	207,000	3,525.00	729,675,000	貸付有価証券 38,000株
3054	ハイパー	6,600	479.00	3,161,400	貸付有価証券 1,100株
3076	あい ホールディングス	38,000	1,779.00	67,602,000	貸付有価証券 6,200株
3079	ディーブイエックス	9,100	1,040.00	9,464,000	貸付有価証券 1,700株
3107	ダイワボウホールディングス	129,600	1,642.00	212,803,200	貸付有価証券 18,500株
3132	マクニカ・富士エレホールディングス	63,600	2,697.00	171,529,200	
3139	ラクト・ジャパン	9,200	1,979.00	18,206,800	貸付有価証券 900株
3150	グリムス	11,800	2,126.00	25,086,800	貸付有価証券 1,900株
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	46,300	805.00	37,271,500	
3153	八洲電機	19,200	957.00	18,374,400	
3154	メディアスホールディングス	15,200	889.00	13,512,800	貸付有価証券 2,500株
3156	レスターホールディングス	25,300	1,952.00	49,385,600	
3157	ジュテックホールディングス	6,100	1,163.00	7,094,300	貸付有価証券 1,000株
3160	大光	11,300	674.00	7,616,200	貸付有価証券 1,800株
3166	OCHIホールディングス	7,700	1,321.00	10,171,700	貸付有価証券 1,300株
3167	TOKAIホールディングス	129,100	898.00	115,931,800	貸付有価証券 6,900株
3168	黒谷	7,200	637.00	4,586,400	貸付有価証券 1,000株
3173	Cominix	4,600	732.00	3,367,200	
3176	三洋貿易	26,800	1,034.00	27,711,200	貸付有価証券 4,400株
3180	ビューティガレージ	4,300	3,120.00	13,416,000	貸付有価証券 800株
3183	ウイン・パートナーズ	19,200	993.00	19,065,600	貸付有価証券 500株
3321	ミタチ産業	6,700	901.00	6,036,700	貸付有価証券 1,300株

3360	シップヘルスケアホールディングス	85,400	2,571.00	219,563,400	
3388	明治電機工業	8,400	1,225.00	10,290,000	貸付有価証券 1,300株
3392	デリカフーズホールディングス	10,300	537.00	5,531,100	
3393	スターティアホールディングス	6,000	762.00	4,572,000	貸付有価証券 1,400株
3543	コメダホールディングス	58,200	2,145.00	124,839,000	貸付有価証券 3,100株
3559	ピーバンドットコム	3,700	634.00	2,345,800	貸付有価証券 600株
3565	アセンテック	9,100	709.00	6,451,900	貸付有価証券 1,000株
5009	富士興産	6,600	971.00	6,408,600	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	2,700	1,540.00	4,158,000	貸付有価証券 500株
7128	フルサト・マルカホールディングス	25,600	2,194.00	56,166,400	貸付有価証券 1,500株
7130	ヤマエグループホールディングス	17,900	1,041.00	18,633,900	貸付有価証券 3,200株
7414	小野建	25,800	1,695.00	43,731,000	貸付有価証券 3,900株
7417	南陽	5,400	1,945.00	10,503,000	貸付有価証券 1,000株
7420	佐島電機	16,600	923.00	15,321,800	貸付有価証券 3,200株
7427	エコートレーディング	5,600	594.00	3,326,400	
7433	伯東	16,200	2,274.00	36,838,800	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	20,500	1,033.00	21,176,500	
7442	中山福	14,000	409.00	5,726,000	貸付有価証券 2,500株
7447	ナガイレーベン	35,300	2,120.00	74,836,000	貸付有価証券 1,000株
7451	三菱食品	25,600	3,190.00	81,664,000	貸付有価証券 7,100株
7456	松田産業	19,400	2,356.00	45,706,400	貸付有価証券 3,200株
7458	第一興商	50,600	3,340.00	169,004,000	貸付有価証券 3,500株
7459	メディパルホールディングス	287,700	2,172.00	624,884,400	貸付有価証券 46,500株
7466	S P K	10,500	1,278.00	13,419,000	
7467	萩原電気ホールディングス	9,900	1,977.00	19,572,300	貸付有価証券 1,600株
7476	アズワン	38,300	6,120.00	234,396,000	貸付有価証券 5,800株
7480	スズデン	9,200	2,025.00	18,630,000	貸付有価証券 1,500株
7481	尾家産業	7,000	995.00	6,965,000	貸付有価証券 1,600株

7482	シモジマ	16,300	1,013.00	16,511,900	
7483	ドウシシャ	25,100	1,516.00	38,051,600	貸付有価証券 2,300株
7487	小津産業	5,800	1,968.00	11,414,400	
7504	高速	15,900	1,471.00	23,388,900	貸付有価証券 2,600株
7510	たけびし	10,000	1,445.00	14,450,000	貸付有価証券 1,500株
7525	リックス	6,000	1,550.00	9,300,000	貸付有価証券 1,000株
7537	丸文	23,600	729.00	17,204,400	貸付有価証券 3,900株
7552	ハピネット	22,200	1,525.00	33,855,000	
7570	橋本総業ホールディングス	5,400	2,009.00	10,848,600	貸付有価証券 900株
7575	日本ライフライン	79,000	1,001.00	79,079,000	
7590	タカショー	20,200	661.00	13,352,200	貸付有価証券 3,500株
7599	I D O M	80,800	673.00	54,378,400	貸付有価証券 5,300株
7607	進和	15,700	2,040.00	32,028,000	
7608	エスケイジャパン	6,400	419.00	2,681,600	貸付有価証券 1,100株
7609	ダイトロン	11,300	2,034.00	22,984,200	
7613	シークス	38,100	1,313.00	50,025,300	貸付有価証券 8,900株
7619	田中商事	8,200	645.00	5,289,000	貸付有価証券 1,300株
7628	オーハシテクニカ	14,300	1,426.00	20,391,800	貸付有価証券 2,500株
7637	白銅	8,600	2,660.00	22,876,000	貸付有価証券 1,600株
7673	ダイコー通産	3,100	1,184.00	3,670,400	貸付有価証券 100株
8001	伊藤忠商事	1,864,800	3,719.00	6,935,191,200	
8002	丸紅	2,630,000	1,179.50	3,102,085,000	
8007	高島	3,800	2,367.00	8,994,600	貸付有価証券 700株
8012	長瀬産業	146,400	1,820.00	266,448,000	貸付有価証券 25,800株
8014	蝶理	14,900	1,790.00	26,671,000	貸付有価証券 2,800株
8015	豊田通商	267,800	4,940.00	1,322,932,000	
8018	三共生興	35,300	565.00	19,944,500	
8020	兼松	99,400	1,295.00	128,723,000	
8025	ツカモトコーポレーション	4,400	1,308.00	5,755,200	
8031	三井物産	2,070,500	2,965.00	6,139,032,500	
8032	日本紙パルプ商事	13,900	3,985.00	55,391,500	貸付有価証券 2,000株

8037	カメイ	31,600	1,035.00	32,706,000	貸付有価証券 5,700株
8038	東都水産	1,400	3,935.00	5,509,000	貸付有価証券 100株
8041	ＯＵＧホールディングス	3,900	2,685.00	10,471,500	
8043	スターゼン	19,700	2,098.00	41,330,600	貸付有価証券 3,700株
8051	山善	112,100	999.00	111,987,900	貸付有価証券 17,000株
8052	椿本興業	5,500	4,125.00	22,687,500	貸付有価証券 800株
8053	住友商事	1,682,800	1,836.50	3,090,462,200	
8057	内田洋行	11,400	4,595.00	52,383,000	貸付有価証券 1,600株
8058	三菱商事	1,997,900	3,953.00	7,897,698,700	
8059	第一実業	12,100	4,260.00	51,546,000	貸付有価証券 2,400株
8060	キャノンマーケティングジャパン	66,100	2,502.00	165,382,200	貸付有価証券 12,600株
8061	西華産業	14,000	1,606.00	22,484,000	貸付有価証券 400株
8065	佐藤商事	22,000	1,159.00	25,498,000	貸付有価証券 3,600株
8068	菱洋エレクトロ	15,800	2,023.00	31,963,400	貸付有価証券 6,400株
8070	東京産業	24,100	715.00	17,231,500	貸付有価証券 4,000株
8074	ユアサ商事	25,300	2,900.00	73,370,000	貸付有価証券 3,300株
8075	神鋼商事	6,000	3,750.00	22,500,000	貸付有価証券 300株
8077	トルク	14,100	212.00	2,989,200	貸付有価証券 2,400株
8078	阪和興業	53,400	3,300.00	176,220,000	貸付有価証券 8,100株
8079	正栄食品工業	17,200	4,080.00	70,176,000	貸付有価証券 3,900株
8081	カナデン	21,600	1,005.00	21,708,000	貸付有価証券 3,400株
8084	菱電商事	21,100	1,743.00	36,777,300	貸付有価証券 3,200株
8088	岩谷産業	64,000	5,280.00	337,920,000	
8089	ナイス	9,200	1,805.00	16,606,000	貸付有価証券 100株
8091	ニチモウ	3,800	2,576.00	9,788,800	貸付有価証券 900株
8093	極東貿易	7,600	2,657.00	20,193,200	貸付有価証券 2,000株
8095	アステナホールディングス	37,600	412.00	15,491,200	貸付有価証券 900株

8097	三愛石油	65,600	919.00	60,286,400	貸付有価証券 16,800株
8098	稲畑産業	58,700	2,032.00	119,278,400	
8101	G S I クレオス	12,700	1,122.00	14,249,400	貸付有価証券 2,400株
8103	明和産業	24,600	1,117.00	27,478,200	貸付有価証券 7,100株
8104	クワザワホールディングス	10,500	623.00	6,541,500	貸付有価証券 1,800株
8125	ワキタ	56,800	1,014.00	57,595,200	
8129	東邦ホールディングス	85,500	1,879.00	160,654,500	貸付有価証券 21,800株
8130	サンゲツ	70,500	1,572.00	110,826,000	貸付有価証券 9,900株
8131	ミツウロコグループホールディングス	39,300	1,029.00	40,439,700	貸付有価証券 6,400株
8132	シナネンホールディングス	9,900	3,275.00	32,422,500	貸付有価証券 2,300株
8133	伊藤忠エネクス	58,900	1,042.00	61,373,800	
8136	サンリオ	82,300	2,345.00	192,993,500	貸付有価証券 1,900株
8137	サンワテクノス	16,200	1,354.00	21,934,800	貸付有価証券 2,200株
8140	リョーサン	29,400	2,286.00	67,208,400	貸付有価証券 4,800株
8141	新光商事	39,900	871.00	34,752,900	貸付有価証券 6,900株
8142	トーヨー	12,000	1,072.00	12,864,000	貸付有価証券 1,900株
8150	三信電気	12,200	1,637.00	19,971,400	貸付有価証券 1,200株
8151	東陽テクニカ	26,300	1,050.00	27,615,000	貸付有価証券 6,200株
8153	モスフードサービス	35,000	3,025.00	105,875,000	
8154	加賀電子	24,100	3,270.00	78,807,000	貸付有価証券 4,400株
8158	ソーダニッカ	26,200	889.00	23,291,800	貸付有価証券 4,500株
8159	立花エレテック	21,300	1,584.00	33,739,200	貸付有価証券 3,800株
8275	フォーバル	11,700	936.00	10,951,200	貸付有価証券 1,900株
8283	P A L T A C	37,400	4,415.00	165,121,000	貸付有価証券 2,500株
8285	三谷産業	31,100	306.00	9,516,600	貸付有価証券 5,700株
8835	太平洋興発	9,800	654.00	6,409,200	貸付有価証券 1,800株
9260	西本W i s m e t t a c ホールディングス	6,000	3,130.00	18,780,000	

9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	2,400	1,962.00	4,708,800	貸付有価証券 300株
9273	コア商事ホールディングス	16,600	616.00	10,225,600	貸付有価証券 3,500株
9274	国際紙パルプ商事	55,400	315.00	17,451,000	貸付有価証券 10,500株
9305	ヤマタネ	12,400	1,609.00	19,951,600	
9763	丸紅建材リース	2,300	1,789.00	4,114,700	
9810	日鉄物産	19,000	5,310.00	100,890,000	貸付有価証券 5,200株
9824	泉州電業	7,300	6,330.00	46,209,000	貸付有価証券 1,000株
9830	トラスコ中山	55,500	2,495.00	138,472,500	
9832	オートバックスセブン	89,600	1,413.00	126,604,800	
9837	モリト	19,400	730.00	14,162,000	貸付有価証券 3,200株
9869	加藤産業	38,500	3,290.00	126,665,000	貸付有価証券 6,800株
9872	北恵	6,700	868.00	5,815,600	貸付有価証券 1,100株
9880	イノテック	16,100	1,473.00	23,715,300	貸付有価証券 1,600株
9882	イエローハット	46,200	1,674.00	77,338,800	貸付有価証券 8,200株
9896	J Kホールディングス	21,400	994.00	21,271,600	貸付有価証券 4,000株
9902	日伝	22,100	2,158.00	47,691,800	貸付有価証券 4,000株
9930	北沢産業	18,000	227.00	4,086,000	貸付有価証券 3,300株
9932	杉本商事	12,500	2,158.00	26,975,000	貸付有価証券 1,600株
9934	因幡電機産業	71,100	2,583.00	183,651,300	貸付有価証券 12,400株
9960	東テク	8,800	2,423.00	21,322,400	貸付有価証券 1,400株
9962	ミスミグループ本社	334,600	3,470.00	1,161,062,000	
9972	アルテック	17,900	307.00	5,495,300	貸付有価証券 3,200株
9982	タキヒヨー	8,000	1,410.00	11,280,000	貸付有価証券 1,900株
9986	蔵王産業	5,100	1,835.00	9,358,500	
9987	スズケン	104,200	3,545.00	369,389,000	
9991	ジェコス	18,400	800.00	14,720,000	貸付有価証券 3,000株
9995	グローセル	31,100	445.00	13,839,500	貸付有価証券 4,300株
2651	ローソン	59,000	4,805.00	283,495,000	貸付有価証券 2,100株
2659	サンエー	20,200	4,085.00	82,517,000	貸付有価証券 100株

2664	カワチ薬品	20,700	2,352.00	48,686,400	貸付有価証券 1,900株
2670	エービーシー・マート	41,600	5,200.00	216,320,000	
2674	ハードオフコーポレーション	11,700	771.00	9,020,700	貸付有価証券 1,700株
2678	アスクル	60,300	1,659.00	100,037,700	
2681	ゲオホールディングス	35,600	1,157.00	41,189,200	
2685	アダストリア	28,700	1,750.00	50,225,000	
2686	ジーフット	16,100	317.00	5,103,700	貸付有価証券 3,900株
2687	シー・ヴィ・エス・バイエリア	3,800	378.00	1,436,400	
2695	くら寿司	27,800	3,650.00	101,470,000	貸付有価証券 6,600株
2698	キャンドゥ	9,900	2,034.00	20,136,600	
2722	アイケイ	8,400	386.00	3,242,400	貸付有価証券 1,400株
2726	バルグループホールディングス	23,300	1,657.00	38,608,100	
2730	エディオン	122,400	1,115.00	136,476,000	貸付有価証券 38,400株
2734	サーラコーポレーション	54,100	634.00	34,299,400	
2735	ワッツ	12,900	689.00	8,888,100	貸付有価証券 2,800株
2742	ハローズ	12,200	2,821.00	34,416,200	貸付有価証券 1,600株
2752	フジオフードグループ本社	22,500	1,350.00	30,375,000	貸付有価証券 5,000株
2753	あみやき亭	6,300	2,900.00	18,270,000	貸付有価証券 500株
2764	ひらまつ	56,500	189.00	10,678,500	貸付有価証券 7,800株
2791	大黒天物産	8,500	4,770.00	40,545,000	貸付有価証券 1,100株
2792	ハニーズホールディングス	23,400	1,033.00	24,172,200	
2796	ファーマライズホールディングス	6,500	715.00	4,647,500	貸付有価証券 1,000株
3028	アルペン	19,800	2,142.00	42,411,600	貸付有価証券 2,400株
3030	ハブ	8,600	591.00	5,082,600	貸付有価証券 1,900株
3034	クオールホールディングス	32,700	1,334.00	43,621,800	貸付有価証券 6,400株
3046	ジンスホールディングス	18,100	6,720.00	121,632,000	貸付有価証券 1,200株
3048	ビックカメラ	158,100	1,030.00	162,843,000	貸付有価証券 25,900株
3050	DCMホールディングス	164,500	1,104.00	181,608,000	
3053	ベッパーフードサービス	36,400	352.00	12,812,800	貸付有価証券 7,000株
3064	Monotaro	337,000	1,841.00	620,417,000	貸付有価証券 76,600株

3067	東京一番フーズ	6,800	593.00	4,032,400	
3073	ＤＤホールディングス	13,900	567.00	7,881,300	貸付有価証券 1,900株
3082	きちりホールディングス	7,100	355.00	2,520,500	貸付有価証券 1,200株
3085	アークランドサービスホールディングス	19,500	2,197.00	42,841,500	貸付有価証券 4,000株
3086	J. フロント リテイリング	318,400	1,076.00	342,598,400	
3087	ドトール・日レスホールディングス	46,000	1,605.00	73,830,000	
3088	マツキヨココカラ＆カンパニー	164,000	4,080.00	669,120,000	
3091	ブロンコビリー	15,200	2,225.00	33,820,000	
3092	Z O Z O	183,300	3,070.00	562,731,000	
3093	トレジャー・ファクトリー	7,800	951.00	7,417,800	貸付有価証券 1,700株
3097	物語コーポレーション	13,200	6,280.00	82,896,000	貸付有価証券 2,200株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	466,700	934.00	435,897,800	
3134	Hame e	9,600	1,082.00	10,387,200	貸付有価証券 1,300株
3135	マーケットエンタープライズ	2,000	782.00	1,564,000	貸付有価証券 400株
3141	ウエルシアホールディングス	140,900	3,130.00	441,017,000	貸付有価証券 9,600株
3148	クリエイトＳＤホールディングス	39,300	3,145.00	123,598,500	
3159	丸善ＣＨＩホールディングス	31,100	365.00	11,351,500	貸付有価証券 600株
3169	ミサワ	5,400	655.00	3,537,000	貸付有価証券 900株
3172	ティーライフ	3,600	1,315.00	4,734,000	貸付有価証券 600株
3175	エー・ピーホールディングス	5,200	439.00	2,282,800	
3178	チムニー	8,100	1,163.00	9,420,300	貸付有価証券 2,100株
3179	シュッピン	22,200	1,079.00	23,953,800	貸付有価証券 5,900株
3182	オイシックス・ラ・大地	38,300	2,557.00	97,933,100	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	53,900	2,932.00	158,034,800	貸付有価証券 900株
3191	ジョイフル本田	80,100	1,525.00	122,152,500	貸付有価証券 12,800株
3193	鳥貴族ホールディングス	9,800	1,833.00	17,963,400	貸付有価証券 1,900株
3196	ホットランド	19,900	1,279.00	25,452,100	貸付有価証券 3,400株
3197	すかいらーくホールディングス	344,200	1,501.00	516,644,200	貸付有価証券 11,700株
3198	S F Pホールディングス	13,000	1,415.00	18,395,000	貸付有価証券 400株

3199	綿半ホールディングス	20,000	1,299.00	25,980,000	貸付有価証券 4,000株
3221	ヨシックスホールディングス	5,200	2,156.00	11,211,200	貸付有価証券 700株
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	77,500	1,080.00	83,700,000	貸付有価証券 12,700株
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	13,800	1,067.00	14,724,600	貸付有価証券 500株
3328	B E E N O S	13,400	1,827.00	24,481,800	貸付有価証券 1,600株
3333	あさひ	22,100	1,426.00	31,514,600	貸付有価証券 5,000株
3341	日本調剤	16,200	1,464.00	23,716,800	貸付有価証券 1,600株
3349	コスモス薬品	26,900	14,100.00	379,290,000	
3361	トーエル	13,000	862.00	11,206,000	貸付有価証券 2,100株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	1,043,000	5,794.00	6,043,142,000	
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	142,000	760.00	107,920,000	貸付有価証券 23,400株
3391	ツルハホールディングス	58,200	9,120.00	530,784,000	貸付有価証券 4,500株
3395	サンマルクホールディングス	21,100	1,590.00	33,549,000	貸付有価証券 800株
3396	フェリシモ	5,900	1,286.00	7,587,400	貸付有価証券 500株
3397	トリドールホールディングス	66,300	2,331.00	154,545,300	貸付有価証券 5,300株
3415	T O K Y O B A S E	24,500	448.00	10,976,000	
3538	ウイルプラスホールディングス	5,000	970.00	4,850,000	貸付有価証券 700株
3539	J M ホールディングス	17,900	1,713.00	30,662,700	
3544	サツドラホールディングス	12,000	633.00	7,596,000	
3546	アレンザホールディングス	20,300	1,090.00	22,127,000	
3547	串カツ田中ホールディングス	7,100	2,061.00	14,633,100	貸付有価証券 700株
3548	バロックジャパンリミテッド	18,500	897.00	16,594,500	貸付有価証券 4,400株
3549	クスリのアオキホールディングス	26,500	6,870.00	182,055,000	貸付有価証券 6,400株
3561	力の源ホールディングス	13,600	561.00	7,629,600	貸付有価証券 1,900株
3563	F O O D & L I F E C O M P A N I E	156,100	3,550.00	554,155,000	
4350	メディカルシステムネットワーク	25,800	540.00	13,932,000	貸付有価証券 3,400株
7127	一家ホールディングス	5,600	527.00	2,951,200	貸付有価証券 1,000株
7135	藤久ホールディングス	8,300	768.00	6,374,400	貸付有価証券 200株

7416	はるやまホールディングス	12,500	510.00	6,375,000	貸付有価証券 2,300株
7419	ノジマ	43,100	2,484.00	107,060,400	
7421	カップ・クリエイト	37,400	1,347.00	50,377,800	貸付有価証券 7,000株
7445	ライトオン	19,900	720.00	14,328,000	
7453	良品計画	306,800	1,763.00	540,888,400	
7455	三城ホールディングス	33,000	251.00	8,283,000	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	27,100	948.00	25,690,800	貸付有価証券 6,600株
7475	アルビス	8,600	2,188.00	18,816,800	貸付有価証券 1,600株
7494	コナカ	31,400	353.00	11,084,200	貸付有価証券 5,100株
7506	ハウス オブ ローゼ	3,300	1,689.00	5,573,700	
7508	G－7ホールディングス	29,600	1,514.00	44,814,400	貸付有価証券 700株
7512	イオン北海道	46,900	1,144.00	53,653,600	貸付有価証券 5,200株
7513	コジマ	45,800	540.00	24,732,000	貸付有価証券 7,500株
7514	ヒマラヤ	9,300	1,026.00	9,541,800	貸付有価証券 2,100株
7516	コーナン商事	37,900	3,535.00	133,976,500	貸付有価証券 6,200株
7520	エコス	9,800	2,099.00	20,570,200	
7522	ワタミ	32,300	922.00	29,780,600	貸付有価証券 5,200株
7524	マルシェ	6,500	440.00	2,860,000	貸付有価証券 400株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	533,100	1,661.00	885,479,100	貸付有価証券 40,600株
7545	西松屋チェーン	58,500	1,491.00	87,223,500	貸付有価証券 9,600株
7550	ゼンショーホールディングス	130,200	2,767.00	360,263,400	貸付有価証券 27,400株
7554	幸楽苑ホールディングス	16,900	1,358.00	22,950,200	貸付有価証券 2,700株
7561	ハークスレイ	11,100	480.00	5,328,000	
7581	サイゼリヤ	39,500	2,760.00	109,020,000	貸付有価証券 7,700株
7593	V Tホールディングス	100,300	456.00	45,736,800	貸付有価証券 18,100株
7596	魚力	7,400	2,046.00	15,140,400	貸付有価証券 300株
7601	ポプラ	6,900	141.00	972,900	貸付有価証券 1,100株
7605	フジ・コーポレーション	14,100	1,183.00	16,680,300	貸付有価証券 2,300株

7606	ユナイテッドアローズ	27,900	1,804.00	50,331,600	貸付有価証券 4,600株
7611	ハイデイ日高	38,500	1,719.00	66,181,500	貸付有価証券 10,500株
7615	YU-WA Creation Holdi	15,600	200.00	3,120,000	貸付有価証券 2,700株
7616	コロワイド	109,600	1,688.00	185,004,800	貸付有価証券 24,000株
7618	ピーシーデポコーポレーション	31,000	288.00	8,928,000	貸付有価証券 8,300株
7630	壱番屋	18,800	4,665.00	87,702,000	貸付有価証券 1,500株
7640	トップカルチャー	9,600	281.00	2,697,600	貸付有価証券 1,600株
7646	P L A N T	6,800	664.00	4,515,200	貸付有価証券 1,100株
7649	スギホールディングス	53,200	6,740.00	358,568,000	貸付有価証券 14,200株
7679	薬王堂ホールディングス	13,300	2,407.00	32,013,100	貸付有価証券 1,900株
7918	ヴィア・ホールディングス	34,700	153.00	5,309,100	貸付有価証券 5,300株
8005	スクロール	41,000	904.00	37,064,000	貸付有価証券 6,700株
8008	ヨンドシーホールディングス	24,500	1,757.00	43,046,500	貸付有価証券 2,500株
8160	木曽路	35,800	2,222.00	79,547,600	貸付有価証券 8,400株
8163	S R Sホールディングス	36,800	813.00	29,918,400	貸付有価証券 900株
8165	千趣会	48,100	371.00	17,845,100	貸付有価証券 7,800株
8166	タカキュー	20,600	107.00	2,204,200	貸付有価証券 3,300株
8167	リテールパートナーズ	32,300	1,295.00	41,828,500	
8168	ケーヨー	49,300	852.00	42,003,600	貸付有価証券 11,700株
8173	上新電機	30,600	2,125.00	65,025,000	
8174	日本瓦斯	129,600	1,662.00	215,395,200	
8179	ロイヤルホールディングス	45,800	1,886.00	86,378,800	貸付有価証券 9,400株
8181	東天紅	1,900	938.00	1,782,200	
8182	いなげや	33,000	1,412.00	46,596,000	貸付有価証券 5,400株
8185	チヨダ	26,000	762.00	19,812,000	貸付有価証券 3,600株
8194	ライフコーポレーション	24,900	3,055.00	76,069,500	
8200	リンガーハット	32,900	2,271.00	74,715,900	貸付有価証券 6,700株
8203	MrMa xHD	33,300	613.00	20,412,900	貸付有価証券 6,000株

8207	テンアライド	25,800	311.00	8,023,800	貸付有価証券 6,300株
8214	A O K I ホールディングス	51,600	602.00	31,063,200	
8217	オークワ	41,800	943.00	39,417,400	貸付有価証券 6,800株
8218	コメリ	41,200	2,733.00	112,599,600	
8219	青山商事	55,100	693.00	38,184,300	貸付有価証券 14,200株
8227	しまむら	31,000	10,530.00	326,430,000	
8230	はせがわ	14,100	301.00	4,244,100	貸付有価証券 2,300株
8233	高島屋	194,200	1,118.00	217,115,600	貸付有価証券 43,400株
8237	松屋	53,700	727.00	39,039,900	貸付有価証券 9,600株
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	126,300	832.00	105,081,600	貸付有価証券 20,700株
8244	近鉄百貨店	10,200	2,683.00	27,366,600	貸付有価証券 2,400株
8252	丸井グループ	210,400	2,274.00	478,449,600	貸付有価証券 39,900株
8255	アクシアル リテイリング	20,600	3,320.00	68,392,000	貸付有価証券 5,300株
8260	井筒屋	12,500	396.00	4,950,000	貸付有価証券 3,300株
8267	イオン	1,025,900	2,659.00	2,727,868,100	貸付有価証券 258,300株
8273	イズミ	48,200	3,285.00	158,337,000	
8276	平和堂	49,200	1,958.00	96,333,600	貸付有価証券 8,900株
8278	フジ	32,200	1,871.00	60,246,200	貸付有価証券 8,600株
8279	ヤオコー	30,300	6,640.00	201,192,000	貸付有価証券 2,600株
8281	ゼビオホールディングス	36,200	917.00	33,195,400	貸付有価証券 3,100株
8282	ケーズホールディングス	245,800	1,239.00	304,546,200	貸付有価証券 55,600株
8289	O l y m p i c グループ	13,700	710.00	9,727,000	貸付有価証券 2,200株
8291	日産東京販売ホールディングス	39,200	228.00	8,937,600	貸付有価証券 6,400株
9262	シルバーライフ	5,400	1,088.00	5,875,200	貸付有価証券 1,000株
9267	Genky DrugStores	11,700	3,570.00	41,769,000	貸付有価証券 2,200株
9275	ナルミヤ・インターナショナル	6,000	1,150.00	6,900,000	貸付有価証券 700株
9278	ブックオフグループホールディングス	15,500	1,041.00	16,135,500	
9279	ギフト	4,200	2,460.00	10,332,000	貸付有価証券 700株

9627	アインホールディングス	35,700	5,970.00	213,129,000	貸付有価証券 9,300株
9828	元気寿司	7,500	2,550.00	19,125,000	貸付有価証券 2,100株
9831	ヤマダホールディングス	974,900	398.00	388,010,200	
9842	アークランドサカモト	41,700	1,530.00	63,801,000	貸付有価証券 6,800株
9843	ニトリホールディングス	105,800	16,250.00	1,719,250,000	貸付有価証券 19,800株
9850	グルメ杵屋	21,200	1,012.00	21,454,400	貸付有価証券 3,100株
9854	愛眼	19,500	175.00	3,412,500	貸付有価証券 6,400株
9856	ケーユーホールディングス	13,900	1,028.00	14,289,200	貸付有価証券 2,300株
9861	吉野家ホールディングス	93,100	2,392.00	222,695,200	貸付有価証券 8,500株
9887	松屋フーズホールディングス	12,800	3,625.00	46,400,000	貸付有価証券 3,400株
9900	サガミホールディングス	40,700	1,079.00	43,915,300	貸付有価証券 8,100株
9919	関西フードマーケット	20,100	1,046.00	21,024,600	貸付有価証券 4,900株
9936	王将フードサービス	17,600	5,950.00	104,720,000	貸付有価証券 3,700株
9945	プレナス	29,800	2,014.00	60,017,200	貸付有価証券 3,000株
9946	ミニストップ	19,700	1,473.00	29,018,100	
9948	アークス	50,900	2,200.00	111,980,000	貸付有価証券 8,800株
9956	パローホールディングス	59,000	2,250.00	132,750,000	貸付有価証券 7,400株
9974	ベルク	11,800	5,390.00	63,602,000	
9979	大庄	14,300	1,032.00	14,757,600	貸付有価証券 3,900株
9983	ファーストリテイリング	35,700	64,050.00	2,286,585,000	
9989	サンドラッグ	100,300	2,984.00	299,295,200	
9990	サックスパー ホールディングス	25,100	516.00	12,951,600	貸付有価証券 4,400株
9993	ヤマザワ	6,200	1,634.00	10,130,800	
9994	やまや	5,500	2,494.00	13,717,000	
9997	ベルーナ	57,200	753.00	43,071,600	貸付有価証券 13,700株
7150	島根銀行	8,500	563.00	4,785,500	
7161	じもとホールディングス	19,000	688.00	13,072,000	貸付有価証券 2,900株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,387,300	277.00	384,282,100	貸付有価証券 16,200株
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	33,500	1,678.00	56,213,000	貸付有価証券 5,900株

7180	九州フィナンシャルグループ	545,200	458.00	249,701,600	貸付有価証券 87,500株
7182	ゆうちょ銀行	630,300	1,174.00	739,972,200	貸付有価証券 174,400株
7184	富山第一銀行	63,600	320.00	20,352,000	貸付有価証券 10,400株
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,524,900	503.00	767,024,700	貸付有価証券 257,600株
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	174,400	854.00	148,937,600	貸付有価証券 29,600株
7322	三十三フィナンシャルグループ	24,700	1,558.00	38,482,600	貸付有価証券 2,600株
7327	第四北越フィナンシャルグループ	43,400	2,779.00	120,608,600	貸付有価証券 12,700株
7337	ひろぎんホールディングス	393,800	703.00	276,841,400	貸付有価証券 77,600株
7350	おきなわフィナンシャルグループ	24,100	2,322.00	55,960,200	貸付有価証券 2,300株
7380	十六フィナンシャルグループ	35,900	2,438.00	87,524,200	貸付有価証券 5,500株
7381	北國フィナンシャルホールディングス	24,800	3,200.00	79,360,000	貸付有価証券 4,500株
8303	新生銀行	174,200	2,341.00	407,802,200	貸付有価証券 3,800株
8304	あおぞら銀行	149,100	2,752.00	410,323,200	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,744,100	740.30	12,395,657,230	
8308	りそなホールディングス	3,055,900	543.20	1,659,964,880	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	504,700	4,240.00	2,139,928,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	1,848,100	4,336.00	8,013,361,600	
8331	千葉銀行	891,000	789.00	702,999,000	貸付有価証券 150,200株
8334	群馬銀行	512,900	404.00	207,211,600	貸付有価証券 109,300株
8336	武蔵野銀行	39,800	1,933.00	76,933,400	貸付有価証券 10,800株
8337	千葉興業銀行	62,800	290.00	18,212,000	貸付有価証券 12,200株
8338	筑波銀行	104,100	207.00	21,548,700	貸付有価証券 19,300株
8341	七十七銀行	83,800	1,608.00	134,750,400	貸付有価証券 20,700株
8342	青森銀行	20,700	1,969.00	40,758,300	貸付有価証券 4,500株
8343	秋田銀行	17,100	1,845.00	31,549,500	貸付有価証券 2,800株
8344	山形銀行	30,000	1,003.00	30,090,000	貸付有価証券 7,100株
8345	岩手銀行	17,500	1,978.00	34,615,000	貸付有価証券 2,900株
8346	東邦銀行	222,800	222.00	49,461,600	貸付有価証券 65,100株

8349	東北銀行	12,800	1,073.00	13,734,400	貸付有価証券 2,500株
8350	みちのく銀行	17,100	899.00	15,372,900	貸付有価証券 3,700株
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	224,900	2,369.00	532,788,100	
8355	静岡銀行	650,200	916.00	595,583,200	貸付有価証券 108,100株
8358	スルガ銀行	234,100	501.00	117,284,100	貸付有価証券 44,700株
8359	八十二銀行	601,400	443.00	266,420,200	貸付有価証券 146,200株
8360	山梨中央銀行	28,900	967.00	27,946,300	貸付有価証券 5,100株
8361	大垣共立銀行	52,700	2,094.00	110,353,800	貸付有価証券 8,700株
8362	福井銀行	22,800	1,487.00	33,903,600	貸付有価証券 1,200株
8364	清水銀行	11,000	1,668.00	18,348,000	貸付有価証券 1,900株
8365	富山銀行	4,800	2,190.00	10,512,000	貸付有価証券 1,400株
8366	滋賀銀行	50,200	2,302.00	115,560,400	貸付有価証券 8,700株
8367	南都銀行	41,600	2,044.00	85,030,400	貸付有価証券 7,200株
8368	百五銀行	256,300	367.00	94,062,100	貸付有価証券 48,300株
8369	京都銀行	95,600	5,690.00	543,964,000	貸付有価証券 15,700株
8370	紀陽銀行	90,500	1,512.00	136,836,000	貸付有価証券 15,400株
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	166,600	962.00	160,269,200	貸付有価証券 29,000株
8381	山陰合同銀行	158,300	679.00	107,485,700	貸付有価証券 25,900株
8382	中国銀行	213,300	951.00	202,848,300	貸付有価証券 37,600株
8383	鳥取銀行	8,500	1,236.00	10,506,000	貸付有価証券 300株
8385	伊予銀行	353,700	629.00	222,477,300	貸付有価証券 95,100株
8386	百十四銀行	28,400	1,771.00	50,296,400	貸付有価証券 4,600株
8387	四国銀行	40,600	826.00	33,535,600	貸付有価証券 8,600株
8388	阿波銀行	40,900	2,372.00	97,014,800	貸付有価証券 11,500株
8392	大分銀行	15,400	2,009.00	30,938,600	貸付有価証券 3,900株
8393	宮崎銀行	16,700	2,213.00	36,957,100	
8395	佐賀銀行	15,100	1,550.00	23,405,000	貸付有価証券 1,100株

8399	琉球銀行	58,000	852.00	49,416,000	貸付有価証券 10,100株
8410	セブン銀行	792,900	254.00	201,396,600	貸付有価証券 76,700株
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,414,500	1,618.50	5,526,368,250	
8416	高知銀行	9,700	788.00	7,643,600	貸付有価証券 1,600株
8418	山口フィナンシャルグループ	311,000	739.00	229,829,000	貸付有価証券 54,500株
8521	長野銀行	8,800	1,315.00	11,572,000	貸付有価証券 1,600株
8522	名古屋銀行	19,900	3,210.00	63,879,000	貸付有価証券 3,500株
8524	北洋銀行	402,500	266.00	107,065,000	貸付有価証券 65,900株
8527	愛知銀行	9,700	4,860.00	47,142,000	貸付有価証券 1,600株
8530	中京銀行	9,600	1,741.00	16,713,600	貸付有価証券 1,800株
8537	大光銀行	9,100	1,562.00	14,214,200	貸付有価証券 2,400株
8541	愛媛銀行	37,300	975.00	36,367,500	貸付有価証券 8,300株
8542	トマト銀行	9,600	1,091.00	10,473,600	貸付有価証券 1,700株
8544	京葉銀行	113,800	522.00	59,403,600	貸付有価証券 31,600株
8550	栃木銀行	129,000	238.00	30,702,000	貸付有価証券 21,200株
8551	北日本銀行	8,300	1,776.00	14,740,800	貸付有価証券 2,400株
8558	東和銀行	46,900	575.00	26,967,500	貸付有価証券 7,700株
8562	福島銀行	30,600	252.00	7,711,200	貸付有価証券 5,000株
8563	大東銀行	12,800	760.00	9,728,000	貸付有価証券 3,000株
8600	トモニホールディングス	206,400	347.00	71,620,800	貸付有価証券 57,800株
8713	フィデアホールディングス	24,400	1,439.00	35,111,600	貸付有価証券 3,500株
8714	池田泉州ホールディングス	307,000	198.00	60,786,000	貸付有価証券 50,000株
7148	F P G	89,800	896.00	80,460,800	
7172	ジャパンインベストメントアドバイ ザー	20,700	1,165.00	24,115,500	貸付有価証券 2,500株
7347	マーキュリアホールディングス	10,600	547.00	5,798,200	貸付有価証券 1,600株
8473	S B I ホールディングス	329,400	3,040.00	1,001,376,000	貸付有価証券 42,400株
8518	日本アジア投資	21,000	179.00	3,759,000	貸付有価証券 3,700株

8595	ジャフコ グループ	102,000	1,735.00	176,970,000	
8601	大和証券グループ本社	1,999,500	716.10	1,431,841,950	貸付有価証券 180,600株
8604	野村ホールディングス	4,076,400	541.50	2,207,370,600	
8609	岡三証券グループ	210,000	389.00	81,690,000	貸付有価証券 53,200株
8613	丸三証券	79,300	546.00	43,297,800	貸付有価証券 22,500株
8614	東洋証券	88,100	158.00	13,919,800	貸付有価証券 22,600株
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	306,600	419.00	128,465,400	貸付有価証券 74,100株
8617	光世証券	5,600	477.00	2,671,200	貸付有価証券 1,500株
8622	水戸証券	71,300	281.00	20,035,300	貸付有価証券 21,000株
8624	いちよし証券	49,900	681.00	33,981,900	貸付有価証券 14,200株
8628	松井証券	130,700	817.00	106,781,900	貸付有価証券 40,000株
8698	マネックスグループ	217,700	531.00	115,598,700	貸付有価証券 33,300株
8706	極東証券	35,800	765.00	27,387,000	貸付有価証券 6,600株
8707	岩井コスモホールディングス	25,200	1,408.00	35,481,600	貸付有価証券 4,100株
8708	アイザワ証券グループ	43,900	919.00	40,344,100	貸付有価証券 10,800株
8732	マネーパートナーズグループ	28,400	217.00	6,162,800	貸付有価証券 4,600株
8739	スパークス・グループ	123,300	260.00	32,058,000	貸付有価証券 25,300株
8742	小林洋行	7,600	212.00	1,611,200	貸付有価証券 1,300株
7181	かんぽ生命保険	268,700	2,162.00	580,929,400	
8630	SOMPOホールディングス	438,300	5,620.00	2,463,246,000	
8715	アニコム ホールディングス	82,000	766.00	62,812,000	貸付有価証券 4,800株
8725	MS & ADインシュアランスグループ ホール	598,700	4,150.00	2,484,605,000	
8750	第一生命ホールディングス	1,314,200	2,765.50	3,634,420,100	貸付有価証券 28,900株
8766	東京海上ホールディングス	879,300	7,087.00	6,231,599,100	
8795	T & Dホールディングス	693,000	1,826.00	1,265,418,000	貸付有価証券 135,100株
8798	アドバンスクリエイト	12,800	1,023.00	13,094,400	貸付有価証券 2,000株
7164	全国保証	63,700	5,090.00	324,233,000	貸付有価証券 5,000株
7183	あんしん保証	7,900	285.00	2,251,500	貸付有価証券 1,600株

7187	ジェイリース	9,000	1,626.00	14,634,000	貸付有価証券 1,800株
7191	イントラスト	11,300	618.00	6,983,400	貸付有価証券 2,000株
7192	日本モーゲージサービス	14,800	1,064.00	15,747,200	貸付有価証券 1,800株
7196	C a s a	9,400	845.00	7,943,000	貸付有価証券 1,600株
7198	アルヒ	39,400	1,080.00	42,552,000	貸付有価証券 10,400株
7199	プレミアムグループ	13,500	3,810.00	51,435,000	貸付有価証券 2,600株
7383	ネットプロテクションズホールディングス	60,800	1,035.00	62,928,000	
8253	クレディセゾン	171,400	1,324.00	226,933,600	貸付有価証券 30,600株
8424	芙蓉総合リース	28,000	7,720.00	216,160,000	貸付有価証券 6,000株
8425	みずほリース	41,200	3,275.00	134,930,000	貸付有価証券 6,800株
8439	東京センチュリー	51,700	5,880.00	303,996,000	貸付有価証券 16,600株
8511	日本証券金融	104,900	899.00	94,305,100	貸付有価証券 19,200株
8515	アイフル	448,000	343.00	153,664,000	貸付有価証券 66,600株
8566	リコーリース	23,600	3,825.00	90,270,000	貸付有価証券 4,500株
8570	イオンフィナンシャルサービス	145,200	1,231.00	178,741,200	貸付有価証券 26,800株
8572	アコム	528,100	315.00	166,351,500	
8584	ジャックス	29,500	3,145.00	92,777,500	貸付有価証券 2,100株
8585	オリエントコーポレーション	722,300	123.00	88,842,900	貸付有価証券 118,100株
8591	オリックス	1,620,900	2,471.50	4,006,054,350	
8593	三菱ＨＣキャピタル	986,300	623.00	614,464,900	
8596	九州リースサービス	13,100	604.00	7,912,400	貸付有価証券 2,200株
8697	日本取引所グループ	676,200	2,391.00	1,616,794,200	
8771	イー・ギャランティ	39,300	1,924.00	75,613,200	貸付有価証券 4,600株
8772	アサックス	13,900	675.00	9,382,500	貸付有価証券 3,100株
8793	NECキャピタルソリューション	10,900	2,187.00	23,838,300	貸付有価証券 300株
2337	いちご	297,300	274.00	81,460,200	貸付有価証券 20,300株
2353	日本駐車場開発	292,800	136.00	39,820,800	
2975	スター・マイカ・ホールディングス	14,400	1,257.00	18,100,800	貸付有価証券 1,500株

2980	S R Eホールディングス	6,500	4,090.00	26,585,000	貸付有価証券 300株
2982	A Dワークスグループ	55,400	140.00	7,756,000	貸付有価証券 8,000株
3003	ヒューリック	637,600	1,081.00	689,245,600	貸付有価証券 140,800株
3228	三栄建築設計	10,700	1,622.00	17,355,400	
3231	野村不動産ホールディングス	138,100	2,781.00	384,056,100	
3232	三重交通グループホールディングス	54,100	455.00	24,615,500	貸付有価証券 5,200株
3244	サムティ	43,000	2,131.00	91,633,000	貸付有価証券 6,200株
3245	ディア・ライフ	34,400	532.00	18,300,800	
3246	コーセーアールイー	7,800	584.00	4,555,200	貸付有価証券 2,000株
3252	地主	16,900	1,753.00	29,625,700	貸付有価証券 2,700株
3254	プレサンスコーポレーション	34,800	2,044.00	71,131,200	貸付有価証券 13,900株
3271	T H Eグローバル社	14,300	174.00	2,488,200	貸付有価証券 2,200株
3275	ハウスコム	4,600	1,213.00	5,579,800	貸付有価証券 600株
3276	日本管理センター	12,800	974.00	12,467,200	
3277	サンセイランディック	7,800	808.00	6,302,400	貸付有価証券 1,300株
3280	エストラスト	3,100	593.00	1,838,300	貸付有価証券 300株
3284	フージャースホールディングス	34,100	684.00	23,324,400	
3288	オープンハウスグループ	84,800	5,680.00	481,664,000	貸付有価証券 2,500株
3289	東急不動産ホールディングス	786,500	650.00	511,225,000	
3291	飯田グループホールディングス	222,700	2,454.00	546,505,800	貸付有価証券 36,400株
3294	イーグランド	4,300	1,386.00	5,959,800	貸付有価証券 700株
3299	ムゲンエステート	16,400	488.00	8,003,200	貸付有価証券 3,000株
3452	ビーロット	18,100	478.00	8,651,800	貸付有価証券 2,000株
3454	ファーストブラザーズ	6,100	813.00	4,959,300	貸付有価証券 1,000株
3457	A n d D oホールディングス	13,200	854.00	11,272,800	貸付有価証券 2,800株
3458	シーアールイー	7,400	1,712.00	12,668,800	貸付有価証券 400株
3464	プロパティエージェント	3,100	1,590.00	4,929,000	貸付有価証券 800株
3465	ケイアイスター不動産	12,000	6,950.00	83,400,000	
3467	アグレ都市デザイン	4,300	1,202.00	5,168,600	貸付有価証券 800株

3475	グッドコムアセット	11,500	1,101.00	12,661,500	貸付有価証券 2,800株
3480	ジェイ・エス・ビー	5,400	2,947.00	15,913,800	
3484	テンポイノベーション	7,400	857.00	6,341,800	貸付有価証券 1,400株
3486	グローバル・リンク・マネジメント	4,700	845.00	3,971,500	貸付有価証券 700株
3489	フェイスネットワーク	2,500	1,278.00	3,195,000	貸付有価証券 400株
4666	パーク２４	143,300	1,734.00	248,482,200	
4809	パラカ	6,900	1,621.00	11,184,900	貸付有価証券 1,100株
6620	宮越ホールディングス	10,100	948.00	9,574,800	貸付有価証券 2,100株
8801	三井不動産	1,217,100	2,492.00	3,033,013,200	
8802	三菱地所	1,754,200	1,689.00	2,962,843,800	貸付有価証券 305,900株
8803	平和不動産	45,700	4,020.00	183,714,000	貸付有価証券 8,000株
8804	東京建物	263,700	1,727.00	455,409,900	貸付有価証券 47,700株
8806	ダイビル	67,700	2,195.00	148,601,500	
8818	京阪神ビルディング	41,200	1,394.00	57,432,800	
8830	住友不動産	560,200	3,558.00	1,993,191,600	貸付有価証券 98,200株
8841	テーオーシー	48,000	756.00	36,288,000	貸付有価証券 14,400株
8842	東京楽天地	4,400	3,860.00	16,984,000	
8848	レオパレス２１	276,800	204.00	56,467,200	貸付有価証券 37,800株
8850	スターツコーポレーション	36,300	2,534.00	91,984,200	貸付有価証券 5,900株
8860	フジ住宅	31,000	665.00	20,615,000	貸付有価証券 4,200株
8864	空港施設	26,700	548.00	14,631,600	貸付有価証券 4,400株
8869	明和地所	12,600	615.00	7,749,000	貸付有価証券 2,400株
8871	ゴールドクレスト	21,100	1,894.00	39,963,400	貸付有価証券 1,800株
8877	エスリード	10,400	1,703.00	17,711,200	貸付有価証券 2,800株
8881	日神グループホールディングス	43,400	493.00	21,396,200	貸付有価証券 400株
8892	日本エスコン	49,700	764.00	37,970,800	
8897	タカラレーベン	111,900	318.00	35,584,200	貸付有価証券 10,200株
8904	A V A N T I A	13,800	850.00	11,730,000	貸付有価証券 2,600株
8905	イオンモール	133,900	1,669.00	223,479,100	貸付有価証券 21,900株

8908	毎日コムネット	9,100	686.00	6,242,600	貸付有価証券 1,100株
8917	ファースト住建	9,900	1,170.00	11,583,000	貸付有価証券 2,700株
8918	ランド	1,453,300	10.00	14,533,000	貸付有価証券 234,800株
8919	カチタス	66,100	3,360.00	222,096,000	
8923	トーセイ	36,800	1,041.00	38,308,800	貸付有価証券 6,000株
8928	穴吹興産	5,800	1,946.00	11,286,800	貸付有価証券 1,000株
8934	サンフロンティア不動産	36,900	1,042.00	38,449,800	貸付有価証券 8,200株
8935	F J ネクストホールディングス	26,200	992.00	25,990,400	
8940	インテリックス	6,000	618.00	3,708,000	貸付有価証券 1,300株
8944	ランドビジネス	11,300	242.00	2,734,600	貸付有価証券 700株
8945	サンネクスタグループ	8,500	1,058.00	8,993,000	貸付有価証券 1,100株
8999	グランディハウス	18,100	507.00	9,176,700	貸付有価証券 3,400株
9706	日本空港ビルデング	101,800	5,260.00	535,468,000	貸付有価証券 17,100株
1717	明豊ファシリティワークス	11,800	732.00	8,637,600	貸付有価証券 2,700株
1954	日本工営	16,500	3,015.00	49,747,500	貸付有価証券 100株
2120	L I F U L L	79,000	231.00	18,249,000	貸付有価証券 6,400株
2121	ミクシィ	59,200	2,358.00	139,593,600	貸付有価証券 11,900株
2124	ジェイエイシーリクルートメント	20,900	2,020.00	42,218,000	貸付有価証券 4,100株
2127	日本M&Aセンターホールディングス	424,300	1,727.00	732,766,100	
2130	メンバーズ	7,700	2,811.00	21,644,700	
2139	中広	4,100	385.00	1,578,500	貸付有価証券 500株
2146	UTグループ	37,300	3,515.00	131,109,500	貸付有価証券 9,300株
2148	アイティメディア	12,300	1,641.00	20,184,300	貸付有価証券 1,600株
2153	E・Jホールディングス	14,900	1,146.00	17,075,400	貸付有価証券 1,000株
2154	夢真ビーネックスグループ	84,100	1,668.00	140,278,800	
2157	コシダカホールディングス	69,200	643.00	44,495,600	
2163	アルトナー	6,300	889.00	5,600,700	貸付有価証券 1,000株
2168	パソナグループ	28,000	2,503.00	70,084,000	貸付有価証券 5,200株

2169	C D S	6,400	1,578.00	10,099,200	貸付有価証券 1,100株
2170	リンクアンドモチベーション	57,000	470.00	26,790,000	貸付有価証券 5,000株
2175	エス・エム・エス	87,900	3,190.00	280,401,000	
2180	サニーサイドアップグループ	8,900	729.00	6,488,100	貸付有価証券 1,000株
2181	パーソルホールディングス	258,600	2,970.00	768,042,000	貸付有価証券 42,300株
2183	リニカル	14,600	683.00	9,971,800	貸付有価証券 2,100株
2193	クックパッド	81,300	262.00	21,300,600	貸付有価証券 17,600株
2196	エスクリ	11,600	344.00	3,990,400	貸付有価証券 1,500株
2198	アイ・ケイ・ケイホールディングス	12,600	584.00	7,358,400	
2301	学情	10,500	985.00	10,342,500	貸付有価証券 1,500株
2305	スタジオアリス	11,600	2,154.00	24,986,400	貸付有価証券 3,500株
2309	シミックホールディングス	14,300	1,566.00	22,393,800	貸付有価証券 2,200株
2311	エプコ	5,500	708.00	3,894,000	貸付有価証券 700株
2325	N J S	5,700	1,970.00	11,229,000	貸付有価証券 900株
2331	総合警備保障	102,900	4,080.00	419,832,000	貸付有価証券 1,600株
2371	カカココム	189,800	2,520.00	478,296,000	貸付有価証券 13,500株
2372	アイロムグループ	9,300	1,999.00	18,590,700	
2374	セントケア・ホールディング	16,800	773.00	12,986,400	
2376	サイネックス	4,400	607.00	2,670,800	貸付有価証券 200株
2378	ルネサンス	18,000	1,071.00	19,278,000	貸付有価証券 2,400株
2379	ディップ	45,500	3,335.00	151,742,500	貸付有価証券 7,900株
2389	デジタルホールディングス	18,000	1,329.00	23,922,000	貸付有価証券 3,500株
2395	新日本科学	31,500	1,676.00	52,794,000	
2410	キャリアデザインセンター	6,500	1,165.00	7,572,500	貸付有価証券 1,100株
2412	ベネフィット・ワン	94,100	2,999.00	282,205,900	貸付有価証券 3,300株
2413	エムスリー	456,400	4,206.00	1,919,618,400	
2418	ツカダ・グローバルホールディング	16,500	280.00	4,620,000	貸付有価証券 3,700株
2424	プラス	3,400	633.00	2,152,200	貸付有価証券 500株

2427	アウトソーシング	148,200	1,348.00	199,773,600	貸付有価証券 1,800株
2428	ウェルネット	26,100	438.00	11,431,800	貸付有価証券 5,600株
2429	ワールドホールディングス	10,300	2,408.00	24,802,400	貸付有価証券 1,400株
2432	ディー・エヌ・エー	98,500	1,787.00	176,019,500	貸付有価証券 3,100株
2433	博報堂ＤＹホールディングス	360,100	1,790.00	644,579,000	貸付有価証券 58,900株
2440	ぐるなび	42,500	381.00	16,192,500	貸付有価証券 10,000株
2445	タカミヤ	31,300	405.00	12,676,500	
2453	ジャパンベストレスクューシステム	17,500	916.00	16,030,000	貸付有価証券 900株
2461	ファンコミュニケーションズ	64,700	378.00	24,456,600	貸付有価証券 3,900株
2462	ライク	8,600	1,791.00	15,402,600	貸付有価証券 1,700株
2464	ビジネス・ブレークスルー	9,600	419.00	4,022,400	貸付有価証券 2,500株
2471	エスプール	73,000	991.00	72,343,000	
2475	ＷＤＢホールディングス	11,800	2,805.00	33,099,000	貸付有価証券 1,100株
2477	手間いらず	3,800	4,720.00	17,936,000	貸付有価証券 800株
2485	ティア	15,100	437.00	6,598,700	貸付有価証券 2,500株
2487	ＣＤＧ	2,800	1,366.00	3,824,800	
2489	アドウェイズ	38,500	759.00	29,221,500	貸付有価証券 7,400株
2491	バリューコマース	20,300	3,485.00	70,745,500	貸付有価証券 100株
2492	インフォマート	283,400	636.00	180,242,400	貸付有価証券 10,100株
2749	ＪＰホールディングス	66,400	231.00	15,338,400	貸付有価証券 13,200株
3521	エコナックホールディングス	46,700	88.00	4,109,600	貸付有価証券 8,600株
4286	ＣＬホールディングス	5,500	1,198.00	6,589,000	
4290	プレステージ・インターナショナル	97,000	722.00	70,034,000	貸付有価証券 21,800株
4301	アミューズ	14,100	2,106.00	29,694,600	
4310	ドリームインキュベータ	7,000	2,074.00	14,518,000	貸付有価証券 1,800株
4318	クイック	17,700	1,646.00	29,134,200	貸付有価証券 1,000株
4319	ＴＡＣ	14,000	227.00	3,178,000	貸付有価証券 2,500株
4324	電通グループ	266,600	4,185.00	1,115,721,000	

4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	12,100	1,027.00	12,426,700	貸付有価証券 1,600株
4337	ぴあ	9,000	3,350.00	30,150,000	貸付有価証券 1,200株
4343	イオンファンタジー	10,000	2,170.00	21,700,000	貸付有価証券 1,200株
4345	シーティーエス	29,200	811.00	23,681,200	貸付有価証券 7,200株
4346	ネクシィーズグループ	9,100	689.00	6,269,900	貸付有価証券 2,300株
4544	H. U. グループホールディングス	67,600	2,954.00	199,690,400	
4641	アルプス技研	22,900	1,853.00	42,433,700	貸付有価証券 1,000株
4651	サニックス	45,200	194.00	8,768,800	貸付有価証券 8,400株
4653	ダイオーズ	5,100	993.00	5,064,300	
4658	日本空調サービス	27,100	782.00	21,192,200	貸付有価証券 6,500株
4661	オリエンタルランド	305,700	20,920.00	6,395,244,000	貸付有価証券 61,400株
4665	ダスキン	60,000	2,750.00	165,000,000	貸付有価証券 20,700株
4668	明光ネットワークジャパン	30,400	565.00	17,176,000	貸付有価証券 7,600株
4671	ファルコホールディングス	12,300	2,066.00	25,411,800	貸付有価証券 3,000株
4678	秀英予備校	5,600	422.00	2,363,200	
4679	田谷	4,700	551.00	2,589,700	貸付有価証券 200株
4680	ラウンドワン	72,200	1,462.00	105,556,400	
4681	リゾートトラスト	118,600	1,916.00	227,237,600	貸付有価証券 22,200株
4694	ビー・エム・エル	33,300	3,645.00	121,378,500	
4708	りらいあコミュニケーションズ	38,100	1,029.00	39,204,900	貸付有価証券 9,600株
4714	リソー教育	118,200	406.00	47,989,200	
4718	早稲田アカデミー	14,400	1,013.00	14,587,200	貸付有価証券 1,400株
4732	ユー・エス・エス	289,600	1,905.00	551,688,000	貸付有価証券 76,600株
4745	東京個別指導学院	22,800	626.00	14,272,800	貸付有価証券 1,500株
4751	サイバーエージェント	637,500	1,468.00	935,850,000	
4755	楽天グループ	1,329,400	978.00	1,300,153,200	貸付有価証券 303,600株
4763	クリーク・アンド・リバー社	13,500	1,745.00	23,557,500	貸付有価証券 2,200株
4765	モーニングスター	45,200	584.00	26,396,800	貸付有価証券 2,500株
4767	テー・オー・ダブリュー	49,400	302.00	14,918,800	貸付有価証券 7,400株

4792	山田コンサルティンググループ	13,400	1,142.00	15,302,800	貸付有価証券 1,900株
4801	セントラルスポーツ	9,600	2,470.00	23,712,000	
4848	フルキャストホールディングス	22,100	2,205.00	48,730,500	貸付有価証券 1,800株
4849	エン・ジャパン	41,800	2,897.00	121,094,600	貸付有価証券 2,500株
5261	リソルホールディングス	2,800	4,375.00	12,250,000	貸付有価証券 300株
6028	テクノプロ・ホールディングス	154,900	3,510.00	543,699,000	貸付有価証券 9,600株
6029	アトラグループ	5,700	260.00	1,482,000	貸付有価証券 1,000株
6032	インターワークス	7,400	375.00	2,775,000	
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	12,000	4,925.00	59,100,000	貸付有価証券 700株
6036	KeePer 技研	16,600	1,881.00	31,224,600	貸付有価証券 4,100株
6037	ファーストロジック	5,000	747.00	3,735,000	貸付有価証券 1,000株
6044	三機サービス	4,500	969.00	4,360,500	貸付有価証券 900株
6047	Gunosy	14,200	713.00	10,124,600	貸付有価証券 4,200株
6048	デザインワン・ジャパン	6,400	187.00	1,196,800	貸付有価証券 800株
6050	イー・ガーディアン	10,500	2,642.00	27,741,000	貸付有価証券 2,200株
6054	リブセンス	14,200	161.00	2,286,200	貸付有価証券 3,400株
6055	ジャパンマテリアル	79,500	1,658.00	131,811,000	貸付有価証券 12,900株
6058	ベクトル	36,300	1,038.00	37,679,400	
6059	ウチヤマホールディングス	12,700	326.00	4,140,200	貸付有価証券 3,400株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	19,200	1,140.00	21,888,000	貸付有価証券 4,300株
6070	キャリアリンク	9,500	1,681.00	15,969,500	貸付有価証券 1,400株
6071	I B J	21,200	759.00	16,090,800	貸付有価証券 100株
6073	アサンテ	11,400	1,628.00	18,559,200	貸付有価証券 1,700株
6078	バリューHR	10,300	2,483.00	25,574,900	貸付有価証券 2,000株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	21,300	4,745.00	101,068,500	貸付有価証券 3,000株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	10,000	1,530.00	15,300,000	貸付有価証券 2,000株
6083	E R I ホールディングス	7,200	1,165.00	8,388,000	貸付有価証券 1,400株

6087	アビスト	4,000	2,925.00	11,700,000	貸付有価証券 800株
6088	シグマクシス・ホールディングス	15,600	2,215.00	34,554,000	
6089	ウィルグループ	19,000	1,267.00	24,073,000	貸付有価証券 2,800株
6093	エスクロー・エージェント・ジャパン	34,600	188.00	6,504,800	貸付有価証券 7,800株
6095	メドピア	19,900	2,798.00	55,680,200	貸付有価証券 2,000株
6096	レアジョブ	4,900	815.00	3,993,500	貸付有価証券 300株
6098	リクルートホールディングス	1,995,500	5,666.00	11,306,503,000	
6099	エラン	35,700	1,022.00	36,485,400	貸付有価証券 5,600株
6171	土木管理総合試験所	12,000	317.00	3,804,000	貸付有価証券 1,900株
6175	ネットマーケティング	12,600	439.00	5,531,400	貸付有価証券 1,500株
6178	日本郵政	3,377,800	1,025.00	3,462,245,000	
6183	ベルシステム24ホールディングス	37,200	1,425.00	53,010,000	貸付有価証券 4,100株
6184	鎌倉新書	29,400	525.00	15,435,000	貸付有価証券 3,200株
6185	SMN	5,600	602.00	3,371,200	貸付有価証券 700株
6186	一蔵	3,200	391.00	1,251,200	貸付有価証券 500株
6189	グローバルキッズCOMPANY	4,700	789.00	3,708,300	貸付有価証券 600株
6191	エアトリ	16,700	3,030.00	50,601,000	貸付有価証券 2,800株
6194	アトラエ	18,000	2,090.00	37,620,000	貸付有価証券 3,000株
6196	ストライク	9,800	4,150.00	40,670,000	貸付有価証券 2,400株
6197	ソラスト	63,500	1,060.00	67,310,000	貸付有価証券 3,600株
6199	セラク	8,200	1,218.00	9,987,600	貸付有価証券 1,300株
6200	インソース	25,100	1,906.00	47,840,600	貸付有価証券 4,700株
6532	バイカレント・コンサルティング	18,300	40,650.00	743,895,000	
6533	Orchestra Holdings	4,900	2,798.00	13,710,200	
6535	アイモパイル	7,300	1,165.00	8,504,500	貸付有価証券 1,300株
6538	キャリアインデックス	8,800	752.00	6,617,600	貸付有価証券 1,700株
6539	MS-Japan	10,500	888.00	9,324,000	貸付有価証券 1,400株
6540	船場	5,200	747.00	3,884,400	

6544	ジャパンエレベーターサービスホール ディン	82,100	1,605.00	131,770,500	貸付有価証券 1,500株
6546	フルテック	3,600	1,315.00	4,734,000	
6547	グリーンズ	9,700	472.00	4,578,400	貸付有価証券 1,700株
6551	ツナググループ・ホールディングス	5,800	303.00	1,757,400	貸付有価証券 500株
6552	GameWith	7,700	446.00	3,434,200	貸付有価証券 900株
6553	ソウルドアウト	6,200	907.00	5,623,400	貸付有価証券 800株
6555	MS&Consulting	3,800	657.00	2,496,600	貸付有価証券 500株
6556	ウェルビー	16,900	1,223.00	20,668,700	貸付有価証券 2,400株
6560	エル・ティー・エス	3,300	2,307.00	7,613,100	貸付有価証券 800株
6564	ミダックホールディングス	11,700	2,534.00	29,647,800	貸付有価証券 400株
6569	日総工産	20,200	778.00	15,715,600	貸付有価証券 4,800株
6571	キュービーネットホールディングス	11,900	1,694.00	20,158,600	貸付有価証券 1,600株
6572	RPAホールディングス	36,400	358.00	13,031,200	貸付有価証券 3,500株
7030	スプリックス	7,300	1,447.00	10,563,100	貸付有価証券 1,400株
7033	マネジメントソリューションズ	12,700	3,300.00	41,910,000	
7034	プロレド・パートナーズ	5,600	812.00	4,547,200	貸付有価証券 500株
7035	and factory	5,800	368.00	2,134,400	貸付有価証券 1,000株
7037	テノ. ホールディングス	3,100	603.00	1,869,300	貸付有価証券 700株
7038	フロンティア・マネジメント	6,700	653.00	4,375,100	貸付有価証券 1,700株
7044	ピアラ	4,200	547.00	2,297,400	貸付有価証券 1,000株
7059	コプロ・ホールディングス	5,000	1,105.00	5,525,000	貸付有価証券 600株
7060	ギークス	4,400	1,463.00	6,437,200	貸付有価証券 800株
7085	カーブスホールディングス	71,000	704.00	49,984,000	
7088	フォーラムエンジニアリング	18,000	870.00	15,660,000	貸付有価証券 2,300株
7092	Fast Fitness Japan	3,500	2,112.00	7,392,000	
7354	ダイレクトマーケティングミックス	29,900	1,445.00	43,205,500	貸付有価証券 100株
7358	ポピンズホールディングス	6,000	2,498.00	14,988,000	貸付有価証券 1,000株

7366	L I T A L I C O	20,900	3,060.00	63,954,000	貸付有価証券 3,000株
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	13,100	720.00	9,432,000	貸付有価証券 3,100株
8876	リロググループ	141,400	2,059.00	291,142,600	貸付有価証券 10,000株
8920	東祥	19,300	1,554.00	29,992,200	貸付有価証券 2,700株
9247	T R Eホールディングス	35,400	1,481.00	52,427,400	
9248	人・夢・技術グループ	10,300	1,804.00	18,581,200	
9603	エイチ・アイ・エス	57,500	2,050.00	117,875,000	貸付有価証券 6,600株
9612	ラックランド	7,400	2,887.00	21,363,800	貸付有価証券 300株
9616	共立メンテナンス	46,100	4,155.00	191,545,500	貸付有価証券 11,100株
9619	イチネンホールディングス	26,500	1,288.00	34,132,000	貸付有価証券 4,700株
9621	建設技術研究所	15,500	2,365.00	36,657,500	
9622	スペース	18,400	914.00	16,817,600	貸付有価証券 2,800株
9628	燦ホールディングス	11,200	1,542.00	17,270,400	貸付有価証券 1,900株
9632	スバル興業	1,600	7,910.00	12,656,000	貸付有価証券 300株
9633	東京テアトル	10,100	1,225.00	12,372,500	貸付有価証券 1,600株
9644	タナベ経営	9,900	631.00	6,246,900	
9663	ナガワ	8,200	9,480.00	77,736,000	貸付有価証券 1,600株
9672	東京都競馬	19,300	4,320.00	83,376,000	
9675	常磐興産	10,400	1,355.00	14,092,000	貸付有価証券 1,800株
9678	カナモト	45,600	2,299.00	104,834,400	貸付有価証券 2,000株
9699	西尾レントオール	23,900	2,860.00	68,354,000	貸付有価証券 6,100株
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	142,100	22.00	3,126,200	貸付有価証券 18,900株
9715	トランス・コスモス	32,800	3,190.00	104,632,000	貸付有価証券 5,800株
9716	乃村工藝社	110,800	958.00	106,146,400	貸付有価証券 8,600株
9722	藤田観光	11,300	2,451.00	27,696,300	貸付有価証券 1,800株
9726	K N T－C Tホールディングス	16,100	1,466.00	23,602,600	
9728	日本管財	27,700	2,787.00	77,199,900	
9729	トーカイ	22,700	1,831.00	41,563,700	貸付有価証券 4,100株
9731	白洋舎	2,900	1,206.00	3,497,400	貸付有価証券 500株

9735	セコム	254,900	8,287.00	2,112,356,300	貸付有価証券 6,300株
9740	セントラル警備保障	12,500	2,369.00	29,612,500	
9743	丹青社	52,900	719.00	38,035,100	貸付有価証券 11,100株
9744	メイテック	31,200	6,700.00	209,040,000	貸付有価証券 3,500株
9755	応用地質	29,100	2,135.00	62,128,500	貸付有価証券 3,600株
9757	船井総研ホールディングス	52,900	2,314.00	122,410,600	
9760	進学会ホールディングス	8,400	328.00	2,755,200	貸付有価証券 2,800株
9765	オオバ	18,200	726.00	13,213,200	
9768	いであ	6,900	1,783.00	12,302,700	貸付有価証券 800株
9769	学究社	8,300	1,536.00	12,748,800	貸付有価証券 1,300株
9783	ベネッセホールディングス	86,200	2,276.00	196,191,200	貸付有価証券 3,400株
9787	イオンディライト	31,900	3,025.00	96,497,500	貸付有価証券 5,200株
9788	ナック	12,300	982.00	12,078,600	貸付有価証券 2,400株
9793	ダイセキ	47,100	4,895.00	230,554,500	貸付有価証券 4,800株
9795	ステップ	9,500	1,789.00	16,995,500	貸付有価証券 1,700株
合 計		297,541,300		712,718,003,520	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

J P X日経４００インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 4年 2月 7日現在]

資産の部

[令和 4年 2月 7日現在]

流動資産	
コール・ローン	114,158,431
株式	7,055,012,960
派生商品評価勘定	2,929,300
未収配当金	10,293,210
差入委託証拠金	6,300,000
流動資産合計	7,188,693,901
資産合計	7,188,693,901
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,550
前受金	3,404,500
未払解約金	558,312
未払利息	51
流動負債合計	3,983,413
負債合計	3,983,413
純資産の部	
元本等	
元本	3,838,536,917
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,346,173,571
元本等合計	7,184,710,488
純資産合計	7,184,710,488
負債純資産合計	7,188,693,901

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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	3,557,980,515円
期中追加設定元本額	3,006,282,295円
期中一部解約元本額	2,725,725,893円
元本の内訳※	
国際 J P X日経インデックス400オープン（適格機関投資家専用）	826,504円

	[令和 4年 2月 7日現在]
eMAXIS JPX日経400インデックス	3,316,850,593円
JPX日経400インデックスファンド（ラップ向け）	2,926,373円
国内株式セレクション（ラップ向け）	489,542,764円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	4,995,584円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	23,395,099円
合計	3,838,536,917円
2. 受益権の総数	3,838,536,917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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	111,016,654
合計	111,016,654

（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 4年 2月 7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	126,870,500	—	129,787,500	2,917,000
合計		126,870,500	—	129,787,500	2,917,000

（注）時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	1.8717円
(1万口当たり純資産額)	(18,717円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1332	日本水産	5,000	520.00	2,600,000	
1605	I N P E X	20,200	1,174.00	23,714,800	
1417	ミライト・ホールディングス	1,600	1,883.00	3,012,800	
1719	安藤・間	2,500	873.00	2,182,500	
1720	東急建設	1,500	686.00	1,029,000	
1721	コムシスホールディングス	1,600	2,728.00	4,364,800	
1766	東建コーポレーション	100	9,210.00	921,000	
1801	大成建設	3,400	3,815.00	12,971,000	
1802	大林組	11,600	942.00	10,927,200	
1803	清水建設	10,900	783.00	8,534,700	
1808	長谷工コーポレーション	3,500	1,458.00	5,103,000	
1812	鹿島建設	8,500	1,379.00	11,721,500	
1820	西松建設	700	3,735.00	2,614,500	
1821	三井住友建設	2,600	428.00	1,112,800	
1860	戸田建設	4,800	744.00	3,571,200	
1861	熊谷組	600	2,972.00	1,783,200	
1878	大東建託	1,200	13,480.00	16,176,000	
1881	N I P P O	300	3,985.00	1,195,500	
1893	五洋建設	4,600	639.00	2,939,400	
1911	住友林業	3,000	2,039.00	6,117,000	
1925	大和ハウス工業	10,700	3,389.00	36,262,300	
1928	積水ハウス	12,600	2,329.00	29,345,400	
1942	関電工	1,900	870.00	1,653,000	
1951	エクシオグループ	1,700	2,327.00	3,955,900	
1959	九電工	900	3,075.00	2,767,500	
5076	インフロニア・ホールディングス	4,900	1,054.00	5,164,600	
2201	森永製菓	900	3,690.00	3,321,000	
2229	カルビー	1,700	2,449.00	4,163,300	
2264	森永乳業	700	5,460.00	3,822,000	
2267	ヤクルト本社	2,800	5,790.00	16,212,000	

2269	明治ホールディングス	2,500	7,220.00	18,050,000	
2281	プリマハム	500	2,409.00	1,204,500	
2282	日本ハム	1,400	4,210.00	5,894,000	
2502	アサヒグループホールディングス	8,800	4,770.00	41,976,000	
2503	キリンホールディングス	13,700	1,882.00	25,783,400	
2587	サントリー食品インターナショナル	2,500	4,490.00	11,225,000	
2593	伊藤園	1,100	6,220.00	6,842,000	
2801	キッコーマン	2,700	8,770.00	23,679,000	
2802	味の素	8,200	3,239.00	26,559,800	
2809	キューピー	2,000	2,397.00	4,794,000	
2811	カゴメ	1,400	2,890.00	4,046,000	
2815	アリアケジャパン	300	5,750.00	1,725,000	
2871	ニチレイ	1,700	2,616.00	4,447,200	
2875	東洋水産	1,800	4,820.00	8,676,000	
2897	日清食品ホールディングス	1,500	8,960.00	13,440,000	
2914	日本たばこ産業	19,900	2,340.00	46,566,000	
3401	帝人	3,400	1,384.00	4,705,600	
3402	東レ	26,300	670.80	17,642,040	
8111	ゴールドウイン	700	6,090.00	4,263,000	
3861	王子ホールディングス	15,200	604.00	9,180,800	
3880	大王製紙	1,800	1,915.00	3,447,000	
3941	レンゴー	3,400	864.00	2,937,600	
3405	クラレ	5,300	1,035.00	5,485,500	
3407	旭化成	24,100	1,116.00	26,895,600	
4004	昭和電工	3,100	2,383.00	7,387,300	
4005	住友化学	26,700	586.00	15,646,200	
4021	日産化学	2,000	6,590.00	13,180,000	
4042	東ソー	5,200	1,907.00	9,916,400	
4043	トクヤマ	1,200	1,971.00	2,365,200	
4061	デンカ	1,300	3,635.00	4,725,500	
4063	信越化学工業	5,400	18,970.00	102,438,000	
4088	エア・ウォーター	3,400	1,750.00	5,950,000	
4091	日本酸素ホールディングス	3,500	2,283.00	7,990,500	
4182	三菱瓦斯化学	3,400	2,134.00	7,255,600	
4183	三井化学	3,300	3,040.00	10,032,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	24,300	839.30	20,394,990	
4202	ダイセル	5,200	876.00	4,555,200	
4204	積水化学工業	7,600	1,937.00	14,721,200	
4205	日本ゼオン	3,300	1,352.00	4,461,600	
4206	アイカ工業	1,000	3,175.00	3,175,000	
4208	宇部興産	1,700	2,169.00	3,687,300	
4403	日油	1,200	5,140.00	6,168,000	

4452	花王	8,200	5,254.00	43,082,800	
4612	日本ペイントホールディングス	13,600	849.00	11,546,400	
4613	関西ペイント	3,800	2,296.00	8,724,800	
4631	D I C	1,500	2,997.00	4,495,500	
4901	富士フイルムホールディングス	6,500	7,612.00	49,478,000	
4911	資生堂	6,900	5,997.00	41,379,300	
4912	ライオン	4,500	1,513.00	6,808,500	
4921	ファンケル	1,500	3,110.00	4,665,000	
4922	コーセー	700	10,980.00	7,686,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	1,600	1,734.00	2,774,400	
4967	小林製薬	1,000	9,470.00	9,470,000	
6988	日東電工	2,200	8,710.00	19,162,000	
7947	エフピコ	700	3,375.00	2,362,500	
7988	ニフコ	1,200	3,430.00	4,116,000	
8113	ユニ・チャーム	7,100	4,405.00	31,275,500	
4151	協和キリン	4,300	2,923.00	12,568,900	
4502	武田薬品工業	27,300	3,443.00	93,993,900	
4503	アステラス製薬	32,100	2,021.50	64,890,150	
4506	大日本住友製薬	2,300	1,242.00	2,856,600	
4507	塩野義製薬	4,700	7,984.00	37,524,800	
4516	日本新薬	1,000	7,640.00	7,640,000	
4519	中外製薬	11,600	4,059.00	47,084,400	
4521	科研製薬	600	4,105.00	2,463,000	
4523	エーザイ	4,400	5,752.00	25,308,800	
4527	ロート製薬	1,900	3,205.00	6,089,500	
4528	小野薬品工業	8,500	2,830.50	24,059,250	
4536	参天製薬	6,900	1,321.00	9,114,900	
4552	J C Rファーマ	1,000	2,032.00	2,032,000	
4553	東和薬品	500	2,930.00	1,465,000	
4568	第一三共	29,100	2,360.50	68,690,550	
4578	大塚ホールディングス	7,700	4,091.00	31,500,700	
4587	ペプチドリーム	1,900	2,020.00	3,838,000	
4887	サワイグループホールディングス	800	4,505.00	3,604,000	
5019	出光興産	4,100	3,075.00	12,607,500	
5020	E N E O Sホールディングス	55,800	468.70	26,153,460	
5021	コスモエネルギーホールディングス	1,100	2,376.00	2,613,600	
5101	横浜ゴム	2,100	1,710.00	3,591,000	
5105	TOY O T I R E	2,000	1,633.00	3,266,000	
5108	ブリヂストン	10,700	5,198.00	55,618,600	
5110	住友ゴム工業	3,300	1,188.00	3,920,400	
5201	A G C	3,400	5,040.00	17,136,000	
5233	太平洋セメント	2,100	2,307.00	4,844,700	

5301	東海カーボン	3,100	1,147.00	3,555,700	
5332	TOTO	2,600	4,885.00	12,701,000	
5333	日本碍子	4,000	1,862.00	7,448,000	
5334	日本特殊陶業	2,800	2,205.00	6,174,000	
5393	ニチアス	900	2,595.00	2,335,500	
5706	三井金属鉱業	1,000	3,260.00	3,260,000	
5713	住友金属鉱山	4,700	5,373.00	25,253,100	
5802	住友電気工業	13,700	1,561.00	21,385,700	
5857	アサヒホールディングス	1,500	2,202.00	3,303,000	
3436	SUMCO	5,600	1,984.00	11,110,400	
5929	三和ホールディングス	3,500	1,202.00	4,207,000	
5947	リンナイ	700	10,110.00	7,077,000	
5631	日本製鋼所	1,100	3,750.00	4,125,000	
6005	三浦工業	1,600	3,295.00	5,272,000	
6113	アマダ	5,800	1,097.00	6,362,600	
6134	FUJ I	1,700	2,509.00	4,265,300	
6136	オーエスジー	1,700	2,029.00	3,449,300	
6141	DMG森精機	2,200	1,733.00	3,812,600	
6146	ディスコ	500	32,250.00	16,125,000	
6235	オプトラン	500	2,296.00	1,148,000	
6268	ナブテスコ	2,100	3,505.00	7,360,500	
6273	SMC	1,100	63,910.00	70,301,000	
6301	小松製作所	16,800	2,819.50	47,367,600	
6302	住友重機械工業	2,100	2,965.00	6,226,500	
6305	日立建機	1,500	2,930.00	4,395,000	
6326	クボタ	18,000	2,396.50	43,137,000	
6361	荏原製作所	1,500	5,540.00	8,310,000	
6367	ダイキン工業	4,700	22,385.00	105,209,500	
6383	ダイフク	2,000	8,530.00	17,060,000	
6432	竹内製作所	600	2,822.00	1,693,200	
6465	ホンザキ	1,100	8,680.00	9,548,000	
6471	日本精工	7,000	747.00	5,229,000	
6586	マキタ	4,500	3,977.00	17,896,500	
7011	三菱重工業	5,800	3,193.00	18,519,400	
7013	I H I	2,300	2,335.00	5,370,500	
6448	ブラザー工業	4,500	2,220.00	9,990,000	
6479	ミネベアミツミ	6,400	2,671.00	17,094,400	
6501	日立製作所	16,900	5,888.00	99,507,200	
6503	三菱電機	37,100	1,410.00	52,311,000	
6504	富士電機	2,200	5,940.00	13,068,000	
6506	安川電機	4,000	4,800.00	19,200,000	
6594	日本電産	9,000	9,981.00	89,829,000	

6645	オムロン	3,100	8,227.00	25,503,700	
6670	MC J	1,300	973.00	1,264,900	
6701	日本電気	4,700	5,080.00	23,876,000	
6702	富士通	3,300	16,115.00	53,179,500	
6723	ルネサスエレクトロニクス	20,100	1,256.00	25,245,600	
6724	セイコーエプソン	4,600	1,842.00	8,473,200	
6727	ワコム	2,900	892.00	2,586,800	
6728	アルバック	700	5,900.00	4,130,000	
6750	エレコム	800	1,365.00	1,092,000	
6752	パナソニック	39,500	1,201.50	47,459,250	
6754	アンリツ	2,400	1,581.00	3,794,400	
6758	ソニーグループ	9,900	12,660.00	125,334,000	
6762	T D K	5,400	4,555.00	24,597,000	
6841	横河電機	3,700	1,868.00	6,911,600	
6845	アズビル	2,200	4,165.00	9,163,000	
6849	日本光電工業	1,500	3,100.00	4,650,000	
6856	堀場製作所	700	6,050.00	4,235,000	
6857	アドバンテスト	2,800	9,220.00	25,816,000	
6861	キーエンス	1,800	58,760.00	105,768,000	
6869	シスメックス	3,100	10,585.00	32,813,500	
6920	レーザーテック	1,600	22,255.00	35,608,000	
6923	スタンレー電気	2,600	2,666.00	6,931,600	
6952	カシオ計算機	2,700	1,397.00	3,771,900	
6954	ファナック	3,300	22,270.00	73,491,000	
6965	浜松ホトニクス	2,700	5,810.00	15,687,000	
6971	京セラ	5,200	6,846.00	35,599,200	
6976	太陽誘電	1,800	5,290.00	9,522,000	
6981	村田製作所	10,900	8,234.00	89,750,600	
7276	小糸製作所	2,000	5,850.00	11,700,000	
7735	S C R E E Nホールディングス	600	11,250.00	6,750,000	
8035	東京エレクトロン	2,400	55,270.00	132,648,000	
3116	トヨタ紡織	1,500	2,180.00	3,270,000	
6201	豊田自動織機	3,000	8,900.00	26,700,000	
6902	デンソー	8,200	8,500.00	69,700,000	
7202	いすゞ自動車	11,600	1,491.00	17,295,600	
7203	トヨタ自動車	55,300	2,275.50	125,835,150	
7205	日野自動車	4,600	1,060.00	4,876,000	
7259	アイシン	2,700	4,525.00	12,217,500	
7267	本田技研工業	29,200	3,403.00	99,367,600	
7269	スズキ	8,500	4,803.00	40,825,500	
7270	S U B A R U	10,600	2,012.50	21,332,500	
7272	ヤマハ発動機	4,800	2,777.00	13,329,600	

7282	豊田合成	1,200	2,247.00	2,696,400	
7309	シマノ	1,500	25,940.00	38,910,000	
7313	テイ・エス テック	1,600	1,562.00	2,499,200	
4543	テルモ	10,500	4,145.00	43,522,500	
7701	島津製作所	4,800	4,120.00	19,776,000	
7717	ブイ・テクノロジー	200	3,400.00	680,000	
7729	東京精密	600	4,540.00	2,724,000	
7733	オリンパス	19,400	2,263.00	43,902,200	
7741	HOYA	7,200	15,470.00	111,384,000	
7747	朝日インテック	4,100	1,940.00	7,954,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	3,300	8,531.00	28,152,300	
7846	パイロットコーポレーション	600	4,210.00	2,526,000	
7951	ヤマハ	2,200	5,370.00	11,814,000	
7956	ピジョン	2,200	2,201.00	4,842,200	
7974	任天堂	1,600	58,490.00	93,584,000	
9502	中部電力	11,300	1,122.00	12,678,600	
9503	関西電力	14,000	1,070.00	14,980,000	
9504	中国電力	5,800	873.00	5,063,400	
9506	東北電力	8,700	725.00	6,307,500	
9508	九州電力	7,600	823.00	6,254,800	
9509	北海道電力	3,200	503.00	1,609,600	
9513	電源開発	3,200	1,970.00	6,304,000	
9517	イーレックス	500	1,469.00	734,500	
9519	レノバ	700	1,495.00	1,046,500	
9531	東京瓦斯	7,100	2,299.00	16,322,900	
9532	大阪瓦斯	6,700	2,037.00	13,647,900	
9022	東海旅客鉄道	3,100	14,950.00	46,345,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	4,400	3,450.00	15,180,000	
9064	ヤマトホールディングス	4,900	2,483.00	12,166,700	
9065	山九	900	4,075.00	3,667,500	
9069	センコーグループホールディングス	1,800	924.00	1,663,200	
9086	日立物流	700	5,360.00	3,752,000	
9090	丸和運輸機関	700	1,160.00	812,000	
9142	九州旅客鉄道	2,700	2,433.00	6,569,100	
9143	ＳＧホールディングス	6,600	2,364.00	15,602,400	
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	1,200	6,750.00	8,100,000	
9101	日本郵船	2,900	9,280.00	26,912,000	
9104	商船三井	1,900	8,690.00	16,511,000	
9375	近鉄エクスプレス	700	2,980.00	2,086,000	
1973	NECネットエスアイ	1,200	1,732.00	2,078,400	
2317	システナ	5,200	360.00	1,872,000	
2327	日鉄ソリューションズ	500	3,605.00	1,802,500	

3626	T I S	3,500	2,759.00	9,656,500	
3635	コーエーテクモホールディングス	1,200	4,135.00	4,962,000	
3659	ネクソン	8,200	2,339.00	19,179,800	
3738	ティーガイア	300	1,675.00	502,500	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	900	2,443.00	2,198,700	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	700	9,960.00	6,972,000	
3923	ラクス	1,700	2,192.00	3,726,400	
3932	アカツキ	200	2,943.00	588,600	
4307	野村総合研究所	7,000	4,040.00	28,280,000	
4348	インフォコム	400	1,945.00	778,000	
4684	オービック	1,100	18,840.00	20,724,000	
4686	ジャストシステム	500	4,930.00	2,465,000	
4689	Zホールディングス	52,900	579.10	30,634,390	
4704	トレンドマイクロ	1,900	6,130.00	11,647,000	
4716	日本オラクル	600	8,360.00	5,016,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	1,700	2,946.00	5,008,200	
4768	大塚商会	2,000	4,275.00	8,550,000	
4812	電通国際情報サービス	500	3,495.00	1,747,500	
4816	東映アニメーション	100	10,450.00	1,045,000	
4819	デジタルガレージ	600	3,730.00	2,238,000	
8056	日本ユニシス	1,100	3,135.00	3,448,500	
9418	USEN-NEXT HOLDINGS	300	2,523.00	756,900	
9432	日本電信電話	33,200	3,349.00	111,186,800	
9433	KDDI	26,500	3,745.00	99,242,500	
9435	光通信	400	14,130.00	5,652,000	
9602	東宝	2,100	4,765.00	10,006,500	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	9,700	2,256.00	21,883,200	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,700	5,930.00	10,081,000	
9697	カプコン	3,400	2,893.00	9,836,200	
9719	SCSK	2,500	1,956.00	4,890,000	
9766	コナミホールディングス	1,300	7,000.00	9,100,000	
9984	ソフトバンクグループ	10,400	5,350.00	55,640,000	
2768	双日	4,000	1,916.00	7,664,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	4,100	1,697.00	6,957,700	
3038	神戸物産	2,800	3,525.00	9,870,000	
3107	ダイワボウホールディングス	1,800	1,642.00	2,955,600	
3167	TOKAIホールディングス	1,800	898.00	1,616,400	
3360	シップヘルスケアホールディングス	1,200	2,571.00	3,085,200	
3543	コメダホールディングス	800	2,145.00	1,716,000	
7459	メディパルホールディングス	3,900	2,172.00	8,470,800	

7575	日本ライフライン	1,100	1,001.00	1,101,100	
8001	伊藤忠商事	25,500	3,719.00	94,834,500	
8002	丸紅	36,000	1,179.50	42,462,000	
8015	豊田通商	3,700	4,940.00	18,278,000	
8020	兼松	1,400	1,295.00	1,813,000	
8031	三井物産	28,300	2,965.00	83,909,500	
8053	住友商事	23,000	1,836.50	42,239,500	
8058	三菱商事	27,400	3,953.00	108,312,200	
8088	岩谷産業	900	5,280.00	4,752,000	
8283	PALTAC	500	4,415.00	2,207,500	
9810	日鉄物産	300	5,310.00	1,593,000	
9962	ミスミグループ本社	4,600	3,470.00	15,962,000	
2651	ローソン	800	4,805.00	3,844,000	
2670	エービーシー・マート	600	5,200.00	3,120,000	
2702	日本マクドナルドホールディングス	1,700	4,995.00	8,491,500	
2782	セリア	900	3,040.00	2,736,000	
3048	ビックカメラ	2,200	1,030.00	2,266,000	
3064	MonotaRO	4,600	1,841.00	8,468,600	
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	1,600	4,080.00	6,528,000	
3092	ZOZO	2,500	3,070.00	7,675,000	
3141	ウエルシアホールディングス	1,900	3,130.00	5,947,000	
3148	クリエイトSDホールディングス	500	3,145.00	1,572,500	
3349	コスモス薬品	400	14,100.00	5,640,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	14,300	5,794.00	82,854,200	
3391	ツルハホールディングス	800	9,120.00	7,296,000	
3549	クスリのアオキホールディングス	400	6,870.00	2,748,000	
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	2,100	3,550.00	7,455,000	
7419	ノジマ	600	2,484.00	1,490,400	
7453	良品計画	4,200	1,763.00	7,404,600	
7516	コーナン商事	500	3,535.00	1,767,500	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	7,300	1,661.00	12,125,300	
7550	ゼンショーホールディングス	1,800	2,767.00	4,980,600	
7564	ワークマン	500	5,050.00	2,525,000	
7649	スギホールディングス	700	6,740.00	4,718,000	
8194	ライフコーポレーション	300	3,055.00	916,500	
8252	丸井グループ	2,900	2,274.00	6,594,600	
8273	イズミ	700	3,285.00	2,299,500	
8279	ヤオコー	400	6,640.00	2,656,000	
8282	ケーズホールディングス	3,400	1,239.00	4,212,600	
9627	アインホールディングス	500	5,970.00	2,985,000	
9843	ニトリホールディングス	1,400	16,250.00	22,750,000	

9983	ファーストリテイリング	500	64,050.00	32,025,000	
9989	サンドラッグ	1,400	2,984.00	4,177,600	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	19,000	277.00	5,263,000	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	20,900	503.00	10,512,700	
8303	新生銀行	2,400	2,341.00	5,618,400	
8304	あおぞら銀行	2,000	2,752.00	5,504,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	164,100	740.30	121,483,230	
8308	りそなホールディングス	41,800	543.20	22,705,760	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	6,900	4,240.00	29,256,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	25,300	4,336.00	109,700,800	
8331	千葉銀行	12,200	789.00	9,625,800	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	3,100	2,369.00	7,343,900	
8410	セブン銀行	10,900	254.00	2,768,600	
8411	みずほフィナンシャルグループ	46,800	1,618.50	75,745,800	
7148	F P G	1,200	896.00	1,075,200	
7177	GMOフィナンシャルホールディングス	700	834.00	583,800	
8473	S B Iホールディングス	4,500	3,040.00	13,680,000	
8595	ジャフコ グループ	1,400	1,735.00	2,429,000	
8601	大和証券グループ本社	27,400	716.10	19,621,140	
8604	野村ホールディングス	55,800	541.50	30,215,700	
8630	SOMPOホールディングス	6,000	5,620.00	33,720,000	
8725	MS & ADインシュアランスグループホール	8,200	4,150.00	34,030,000	
8750	第一生命ホールディングス	18,000	2,765.50	49,779,000	
8766	東京海上ホールディングス	12,000	7,087.00	85,044,000	
8795	T & Dホールディングス	9,500	1,826.00	17,347,000	
7164	全国保証	900	5,090.00	4,581,000	
8424	芙蓉総合リース	400	7,720.00	3,088,000	
8425	みずほリース	600	3,275.00	1,965,000	
8439	東京センチュリー	700	5,880.00	4,116,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	2,000	1,231.00	2,462,000	
8572	アコム	6,100	315.00	1,921,500	
8585	オリエントコーポレーション	9,900	123.00	1,217,700	
8591	オリックス	22,200	2,471.50	54,867,300	
8593	三菱HCキャピタル	13,500	623.00	8,410,500	
8697	日本取引所グループ	9,300	2,391.00	22,236,300	
2337	いちご	4,100	274.00	1,123,400	
3003	ヒューリック	8,700	1,081.00	9,404,700	
3231	野村不動産ホールディングス	1,900	2,781.00	5,283,900	
3244	サムティ	600	2,131.00	1,278,600	
3254	プレサンスコーポレーション	500	2,044.00	1,022,000	

3288	オープンハウスグループ	1,200	5,680.00	6,816,000	
3289	東急不動産ホールディングス	10,800	650.00	7,020,000	
3291	飯田グループホールディングス	3,000	2,454.00	7,362,000	
8801	三井不動産	16,700	2,492.00	41,616,400	
8802	三菱地所	24,000	1,689.00	40,536,000	
8804	東京建物	3,600	1,727.00	6,217,200	
8830	住友不動産	7,700	3,558.00	27,396,600	
8850	スターツコーポレーション	500	2,534.00	1,267,000	
8892	日本エスコン	700	764.00	534,800	
8905	イオンモール	1,800	1,669.00	3,004,200	
8919	カチタス	900	3,360.00	3,024,000	
2121	ミクシィ	800	2,358.00	1,886,400	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	5,800	1,727.00	10,016,600	
2146	U Tグループ	500	3,515.00	1,757,500	
2175	エス・エム・エス	1,200	3,190.00	3,828,000	
2181	パーソルホールディングス	3,500	2,970.00	10,395,000	
2331	総合警備保障	1,400	4,080.00	5,712,000	
2371	カカクコム	2,600	2,520.00	6,552,000	
2379	ディップ	600	3,335.00	2,001,000	
2412	ベネフィット・ワン	1,300	2,999.00	3,898,700	
2413	エムスリー	6,200	4,206.00	26,077,200	
2427	アウトソーシング	2,000	1,348.00	2,696,000	
2433	博報堂D Yホールディングス	4,900	1,790.00	8,771,000	
4661	オリエンタルランド	4,200	20,920.00	87,864,000	
4732	ユー・エス・エス	4,000	1,905.00	7,620,000	
4848	フルキャストホールディングス	300	2,205.00	661,500	
4849	エン・ジャパン	600	2,897.00	1,738,200	
6028	テクノプロ・ホールディングス	2,100	3,510.00	7,371,000	
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	200	4,925.00	985,000	
6055	ジャパンマテリアル	1,100	1,658.00	1,823,800	
6098	リクルートホールディングス	21,100	5,666.00	119,552,600	
6183	ベルシステム24ホールディングス	500	1,425.00	712,500	
6532	ベイカレント・コンサルティング	300	40,650.00	12,195,000	
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	1,100	1,605.00	1,765,500	
8876	リログループ	1,900	2,059.00	3,912,100	
9678	カナモト	600	2,299.00	1,379,400	
9735	セコム	3,500	8,287.00	29,004,500	
9744	メイテック	400	6,700.00	2,680,000	
9787	イオンディライト	400	3,025.00	1,210,000	
合 計		2,481,700		7,055,012,960	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

日本株インカム・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	62,962,028
株式	7,401,690,740
投資証券	178,443,000
未収入金	119,297,712
未収配当金	16,215,345
流動資産合計	7,778,608,825
資産合計	7,778,608,825
負債の部	
流動負債	
未払金	117,615,970
未払解約金	951,629
未払利息	28
流動負債合計	118,567,627
負債合計	118,567,627
純資産の部	
元本等	
元本	3,073,855,540
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,586,185,658
元本等合計	7,660,041,198
純資産合計	7,660,041,198
負債純資産合計	7,778,608,825

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	3,049,959,642円
期中追加設定元本額	361,970,468円
期中一部解約元本額	338,074,570円
元本の内訳※	
三菱UFJ 好配当日本株ファンド（2ヵ月決算型）	2,084,431,638円
好配当日本株ファンド（ラップ向け）	3,536,889円
国内株式セレクション（ラップ向け）	932,341,079円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	7,672,885円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	45,873,049円
合計	3,073,855,540円
2. 受益権の総数	3,073,855,540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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はあります。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	38,277,000
投資証券	△3,000,500
合計	35,276,500

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	2.4920円
(1万口当たり純資産額)	(24,920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	
1605	I N P E X	89,400	1,174.00	104,955,600	
1926	ライト工業	70,500	1,851.00	130,495,500	
1928	積水ハウス	30,300	2,329.00	70,568,700	
1951	エクシオグループ	21,800	2,327.00	50,728,600	
5076	インフロニア・ホールディングス	92,800	1,054.00	97,811,200	
6379	レイズネクスト	54,000	1,129.00	60,966,000	
2502	アサヒグループホールディングス	22,600	4,770.00	107,802,000	
2503	麒麟ホールディングス	51,800	1,882.00	97,487,600	
3407	旭化成	63,200	1,116.00	70,531,200	
4061	デンカ	18,500	3,635.00	67,247,500	
4182	三菱瓦斯化学	59,700	2,134.00	127,399,800	
4206	アイカ工業	18,400	3,175.00	58,420,000	
4401	A D E K A	36,200	2,526.00	91,441,200	
5208	有沢製作所	45,200	996.00	45,019,200	
4502	武田薬品工業	23,900	3,443.00	82,287,700	
5108	ブリヂストン	17,400	5,198.00	90,445,200	
5201	A G C	24,300	5,040.00	122,472,000	
5393	ニチアス	23,200	2,595.00	60,204,000	
5401	日本製鉄	76,400	1,967.00	150,278,800	
5713	住友金属鉱山	18,200	5,373.00	97,788,600	
5801	古河電気工業	16,800	2,205.00	37,044,000	
5802	住友電気工業	36,400	1,561.00	56,820,400	
5857	アサヒホールディングス	17,200	2,202.00	37,874,400	
5929	三和ホールディングス	76,100	1,202.00	91,472,200	
5938	L I X I L	31,000	2,516.00	77,996,000	
6113	アマダ	77,100	1,097.00	84,578,700	
6490	日本ピラー工業	21,000	3,100.00	65,100,000	
6592	マブチモーター	18,300	3,600.00	65,880,000	
6670	M C J	83,100	973.00	80,856,300	
6859	エスベック	30,900	2,014.00	62,232,600	
7752	リコー	38,800	982.00	38,101,600	
8035	東京エレクトロン	3,800	55,270.00	210,026,000	
6902	デンソー	12,200	8,500.00	103,700,000	
7203	トヨタ自動車	226,100	2,275.50	514,490,550	

7270	S U B A R U	51,600	2,012.50	103,845,000	
7731	ニコン	112,500	1,305.00	146,812,500	
7740	タムロン	49,700	2,514.00	124,945,800	
7912	大日本印刷	33,400	2,739.00	91,482,600	
7974	任天堂	800	58,490.00	46,792,000	
9531	東京瓦斯	14,100	2,299.00	32,415,900	
9069	センコーグループホールディングス	66,400	924.00	61,353,600	
9147	N I P P O N E X P R E S Sホール ディン	6,800	6,750.00	45,900,000	
9303	住友倉庫	40,000	2,083.00	83,320,000	
4298	プロトコーポレーション	30,200	1,260.00	38,052,000	
4423	アルテリア・ネットワークス	14,600	1,376.00	20,089,600	
9432	日本電信電話	77,900	3,349.00	260,887,100	
9434	ソフトバンク	101,200	1,441.00	145,829,200	
3167	T O K A Iホールディングス	61,600	898.00	55,316,800	
3543	コメダホールディングス	31,200	2,145.00	66,924,000	
8001	伊藤忠商事	57,200	3,719.00	212,726,800	
8002	丸紅	94,400	1,179.50	111,344,800	
8058	三菱商事	47,200	3,953.00	186,581,600	
9934	因幡電機産業	18,200	2,583.00	47,010,600	
2670	エービーシー・マート	20,200	5,200.00	105,040,000	
2685	アダストリア	39,700	1,750.00	69,475,000	
3086	J．フロント リテイリング	44,700	1,076.00	48,097,200	
8174	日本瓦斯	65,800	1,662.00	109,359,600	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	350,800	740.30	259,697,240	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	30,400	4,336.00	131,814,400	
8367	南都銀行	16,300	2,044.00	33,317,200	
8473	S B Iホールディングス	39,400	3,040.00	119,776,000	
8604	野村ホールディングス	111,400	541.50	60,323,100	
8750	第一生命ホールディングス	149,500	2,765.50	413,442,250	
8766	東京海上ホールディングス	19,300	7,087.00	136,779,100	
8570	イオンフィナンシャルサービス	49,000	1,231.00	60,319,000	
8591	オリックス	60,600	2,471.50	149,772,900	
8593	三菱HCキャピタル	103,300	623.00	64,355,900	
2353	日本駐車場開発	235,400	136.00	32,014,400	
3231	野村不動産ホールディングス	25,300	2,781.00	70,359,300	
4714	リソー教育	286,300	406.00	116,237,800	
6178	日本郵政	77,300	1,025.00	79,232,500	
6183	ベルシステム24ホールディングス	38,600	1,425.00	55,005,000	
9743	丹青社	24,200	719.00	17,399,800	
9744	メイテック	11,600	6,700.00	77,720,000	
合 計		4,254,700		7,401,690,740	

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	70	23,205,000	
	日本リート投資法人	43	16,705,500	
	ラサールロジポート投資法人	113	19,978,400	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	66	40,656,000	
	オリックス不動産投資法人	89	14,676,100	
	グローバル・ワン不動産投資法人	152	16,948,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	34	22,950,000	
	大和証券オフィス投資法人	34	23,324,000	
合計		601	178,443,000	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	51,111,292
株式	5,059,202,350
派生商品評価勘定	943,900
未収配当金	9,779,850
差入委託証拠金	2,790,000
流動資産合計	5,123,827,392
資産合計	5,123,827,392
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,550
前受金	1,150,000
未払金	6,064,580
未払解約金	30,840
未払利息	22
流動負債合計	7,265,992
負債合計	7,265,992

[令和 4年 2月 7日現在]

純資産の部	
元本等	
元本	3,210,925,013
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,905,636,387
元本等合計	5,116,561,400
純資産合計	5,116,561,400
負債純資産合計	5,123,827,392

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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	2,970,440,793円
期中追加設定元本額	1,705,042,994円
期中一部解約元本額	1,464,558,774円
元本の内訳※	
iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックスファンド（ラップ向け）	566,224,062円
国内株式セレクション（ラップ向け）	380,283,599円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	2,841,691円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	18,880,316円
eMAXIS JAPAN クオリティ150インデックス	1,334,404,672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）	474,151,228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）	434,139,445円
合計	3,210,925,013円
2. 受益権の総数	3,210,925,013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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7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る場合、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 4年 2月 7日現在]
--	-----------------

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	8,344,845
合計	8,344,845

(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 4年 2月 7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	56,750,000	57,675,000	925,000
合計		56,750,000	57,675,000	925,000

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	〔令和 4年 2月 7日現在〕
1口当たり純資産額	1.5935円
(1万口当たり純資産額)	(15,935円)

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1)株式

（単位：円）

			評価額	
--	--	--	-----	--

	銘 柄	株式数	単価	金額	備考
1414	ショーボンドホールディングス	1,600	5,050.00	8,080,000	
1721	コムシスホールディングス	4,200	2,728.00	11,457,600	
1801	大成建設	6,900	3,815.00	26,323,500	
1878	大東建託	2,300	13,480.00	31,004,000	
1928	積水ハウス	23,100	2,329.00	53,799,900	
2201	森永製菓	1,600	3,690.00	5,904,000	
2229	カルビー	3,000	2,449.00	7,347,000	
2267	ヤクルト本社	5,400	5,790.00	31,266,000	
2269	明治ホールディングス	5,200	7,220.00	37,544,000	
2531	宝ホールディングス	6,700	1,114.00	7,463,800	
2801	キッコーマン	6,600	8,770.00	57,882,000	
2871	ニチレイ	4,700	2,616.00	12,295,200	
2897	日清食品ホールディングス	2,900	8,960.00	25,984,000	
2914	日本たばこ産業	37,400	2,340.00	87,516,000	
8111	ゴールドウイン	1,300	6,090.00	7,917,000	
8114	デサント	1,600	3,455.00	5,528,000	
4021	日産化学	4,800	6,590.00	31,632,000	
4042	東ソー	11,000	1,907.00	20,977,000	
4061	デンカ	3,000	3,635.00	10,905,000	
4063	信越化学工業	5,600	18,970.00	106,232,000	
4091	日本酸素ホールディングス	7,200	2,283.00	16,437,600	
4205	日本ゼオン	6,600	1,352.00	8,923,200	
4403	日油	2,800	5,140.00	14,392,000	
4452	花王	16,100	5,254.00	84,589,400	
4901	富士フイルムホールディングス	12,800	7,612.00	97,433,600	
4921	ファンケル	2,700	3,110.00	8,397,000	
4967	小林製薬	2,300	9,470.00	21,781,000	
4974	タカラバイオ	1,600	2,293.00	3,668,800	
4980	デクセリアルズ	2,100	3,100.00	6,510,000	
6988	日東電工	5,100	8,710.00	44,421,000	
7988	ニフコ	2,900	3,430.00	9,947,000	
8113	ユニ・チャーム	15,700	4,405.00	69,158,500	
4506	大日本住友製薬	6,500	1,242.00	8,073,000	
4507	塩野義製薬	9,900	7,984.00	79,041,600	
4516	日本新薬	2,400	7,640.00	18,336,000	
4519	中外製薬	22,800	4,059.00	92,545,200	
4521	科研製薬	1,200	4,105.00	4,926,000	
4527	ロート製薬	4,000	3,205.00	12,820,000	
4528	小野薬品工業	16,900	2,830.50	47,835,450	
5332	TOTO	6,000	4,885.00	29,310,000	
5333	日本碍子	10,700	1,862.00	19,923,400	

5929	三和ホールディングス	7,800	1,202.00	9,375,600	
6005	三浦工業	3,800	3,295.00	12,521,000	
6134	F U J I	3,300	2,509.00	8,279,700	
6146	ディスコ	1,000	32,250.00	32,250,000	
6268	ナブテスコ	4,100	3,505.00	14,370,500	
6273	SMC	1,500	63,910.00	95,865,000	
6323	ローツェ	400	10,260.00	4,104,000	
6361	荏原製作所	3,200	5,540.00	17,728,000	
6367	ダイキン工業	4,200	22,385.00	94,017,000	
6383	ダイフク	4,300	8,530.00	36,679,000	
6479	ミネベアミツミ	14,400	2,671.00	38,462,400	
6702	富士通	5,600	16,115.00	90,244,000	
6754	アンリツ	4,700	1,581.00	7,430,700	
6758	ソニーグループ	7,900	12,660.00	100,014,000	
6845	アズビル	4,600	4,165.00	19,159,000	
6849	日本光電工業	3,000	3,100.00	9,300,000	
6856	堀場製作所	1,400	6,050.00	8,470,000	
6857	アドバンテスト	6,700	9,220.00	61,774,000	
6861	キーエンス	1,500	58,760.00	88,140,000	
6869	シスメックス	5,900	10,585.00	62,451,500	
6920	レーザーテック	3,200	22,255.00	71,216,000	
6954	ファナック	4,600	22,270.00	102,442,000	
6965	浜松ホトニクス	4,900	5,810.00	28,469,000	
6967	新光電気工業	2,300	4,975.00	11,442,500	
6976	太陽誘電	4,400	5,290.00	23,276,000	
6981	村田製作所	12,700	8,234.00	104,571,800	
7735	S C R E E Nホールディングス	1,600	11,250.00	18,000,000	
8035	東京エレクトロン	1,800	55,270.00	99,486,000	
3116	トヨタ紡織	3,400	2,180.00	7,412,000	
7269	スズキ	16,600	4,803.00	79,729,800	
7272	ヤマハ発動機	11,800	2,777.00	32,768,600	
7309	シマノ	2,800	25,940.00	72,632,000	
4543	テルモ	23,100	4,145.00	95,749,500	
7701	島津製作所	10,000	4,120.00	41,200,000	
7729	東京精密	1,400	4,540.00	6,356,000	
7730	マニー	3,000	1,653.00	4,959,000	
7733	オリンパス	43,900	2,263.00	99,345,700	
7741	H O Y A	6,100	15,470.00	94,367,000	
7747	朝日インテック	8,400	1,940.00	16,296,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	7,500	8,531.00	63,982,500	
7951	ヤマハ	5,500	5,370.00	29,535,000	
7956	ピジョン	4,100	2,201.00	9,024,100	

7974	任天堂	2,100	58,490.00	122,829,000	
9143	S Gホールディングス	17,000	2,364.00	40,188,000	
1973	N E C ネットエスアイ	3,100	1,732.00	5,369,200	
2317	システナ	9,600	360.00	3,456,000	
2327	日鉄ソリューションズ	1,100	3,605.00	3,965,500	
3626	T I S	8,500	2,759.00	23,451,500	
3635	コーエーテクモホールディングス	2,400	4,135.00	9,924,000	
3697	S H I F T	400	20,500.00	8,200,000	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,200	2,443.00	5,374,600	
3774	インターネットイニシアティブ	2,500	3,890.00	9,725,000	
3923	ラクス	3,700	2,192.00	8,110,400	
3962	チェンジ	1,500	1,422.00	2,133,000	
4307	野村総合研究所	15,200	4,040.00	61,408,000	
4684	オービック	2,400	18,840.00	45,216,000	
4686	ジャストシステム	1,100	4,930.00	5,423,000	
4704	トレンドマイクロ	4,800	6,130.00	29,424,000	
4716	日本オラクル	1,100	8,360.00	9,196,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	3,600	2,946.00	10,605,600	
4768	大塚商会	4,400	4,275.00	18,810,000	
7518	ネットワンシステムズ	2,900	2,733.00	7,925,700	
8056	日本ユニシス	2,700	3,135.00	8,464,500	
9432	日本電信電話	35,600	3,349.00	119,224,400	
9433	K D D I	32,900	3,745.00	123,210,500	
9435	光通信	800	14,130.00	11,304,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	21,700	2,256.00	48,955,200	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,100	5,930.00	18,383,000	
9697	カプコン	6,500	2,893.00	18,804,500	
9719	S C S K	5,200	1,956.00	10,171,200	
9766	コナミホールディングス	3,400	7,000.00	23,800,000	
3038	神戸物産	4,900	3,525.00	17,272,500	
7476	アズワン	1,100	6,120.00	6,732,000	
8001	伊藤忠商事	32,100	3,719.00	119,379,900	
8088	岩谷産業	1,800	5,280.00	9,504,000	
9962	ミスミグループ本社	9,600	3,470.00	33,312,000	
3064	M o n o t a R O	8,500	1,841.00	15,648,500	
3141	ウエルシアホールディングス	3,500	3,130.00	10,955,000	
3349	コスモス薬品	800	14,100.00	11,280,000	
3391	ツルハホールディングス	1,500	9,120.00	13,680,000	
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	3,900	3,550.00	13,845,000	
7453	良品計画	8,900	1,763.00	15,690,700	

8174	日本瓦斯	4,000	1,662.00	6,648,000	
8279	ヤオコー	1,000	6,640.00	6,640,000	
8282	ケーズホールディングス	6,800	1,239.00	8,425,200	
9843	ニトリホールディングス	3,200	16,250.00	52,000,000	
9983	ファーストリテイリング	1,600	64,050.00	102,480,000	
9989	サンドラッグ	2,600	2,984.00	7,758,400	
8630	SOMPOホールディングス	11,800	5,620.00	66,316,000	
8766	東京海上ホールディングス	18,200	7,087.00	128,983,400	
7164	全国保証	2,300	5,090.00	11,707,000	
8697	日本取引所グループ	18,100	2,391.00	43,277,100	
3003	ヒューリック	22,800	1,081.00	24,646,800	
3288	オープンハウスグループ	2,700	5,680.00	15,336,000	
3291	飯田グループホールディングス	6,600	2,454.00	16,196,400	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	10,600	1,727.00	18,306,200	
2175	エス・エム・エス	2,400	3,190.00	7,656,000	
2181	パーソルホールディングス	6,600	2,970.00	19,602,000	
2331	総合警備保障	3,000	4,080.00	12,240,000	
2371	カカクコム	4,400	2,520.00	11,088,000	
2412	ベネフィット・ワン	2,700	2,999.00	8,097,300	
2413	エムスリー	15,100	4,206.00	63,510,600	
2433	博報堂DYホールディングス	10,800	1,790.00	19,332,000	
4544	H. U. グループホールディングス	1,900	2,954.00	5,612,600	
4849	エン・ジャパン	1,300	2,897.00	3,766,100	
6028	テクノプロ・ホールディングス	3,700	3,510.00	12,987,000	
6098	リクルートホールディングス	15,200	5,666.00	86,123,200	
6544	ジャパンエレベーターサービスホール ディン	2,100	1,605.00	3,370,500	
9793	ダイセキ	1,700	4,895.00	8,321,500	
合 計		1,030,900		5,059,202,350	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

日本株オープン「35」マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	77,844,246
株式	6,718,138,390
未収入金	110,517,141
未収配当金	18,927,000
流動資産合計	6,925,426,777
資産合計	6,925,426,777
負債の部	
流動負債	
未払金	87,407,680
未払解約金	5,795,820
未払利息	34
流動負債合計	93,203,534
負債合計	93,203,534
純資産の部	
元本等	
元本	1,673,310,586
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,158,912,657
元本等合計	6,832,223,243
純資産合計	6,832,223,243
負債純資産合計	6,925,426,777

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。
--------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	1,526,830,385円
期中追加設定元本額	705,388,378円
期中一部解約元本額	558,908,177円
元本の内訳※	

	[令和 4年 2月 7日現在]
三菱UFJ 日本株オープン「35」	1,304,799,259円
国内株式セレクション（ラップ向け）	176,356,791円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	602,827円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	8,167,997円
三菱UFJ 日本株オープン「35」VA	138,991,808円
三菱UFJ DC厳選日本成長株オープン	44,391,904円
合計	1,673,310,586円
2. 受益権の総数	1,673,310,586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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△463,357,589
合計	△463,357,589

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	4.0831円
(1万口当たり純資産額)	(40,831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	
4004	昭和電工	148,100	2,383.00	352,922,300	
4182	三菱瓦斯化学	60,400	2,134.00	128,893,600	
4185	J S R	36,000	3,450.00	124,200,000	
4369	トリケミカル研究所	69,100	2,976.00	205,641,600	
4901	富士フイルムホールディングス	16,500	7,612.00	125,598,000	

4911	資生堂	19,400	5,997.00	116,341,800	
4980	デクセリアルズ	96,000	3,100.00	297,600,000	
4565	そーせいグループ	214,900	1,462.00	314,183,800	
4568	第一三共	89,200	2,360.50	210,556,600	
3110	日東紡績	35,700	2,939.00	104,922,300	
5301	東海カーボン	124,500	1,147.00	142,801,500	
5713	住友金属鉱山	13,800	5,373.00	74,147,400	
4062	イビデン	58,000	6,030.00	349,740,000	
6501	日立製作所	20,400	5,888.00	120,115,200	
6504	富士電機	38,000	5,940.00	225,720,000	
6594	日本電産	7,700	9,981.00	76,853,700	
6723	ルネサスエレクトロニクス	139,000	1,256.00	174,584,000	
6758	ソニーグループ	18,300	12,660.00	231,678,000	
6817	スミダコーポレーション	142,800	974.00	139,087,200	
6857	アドバンテスト	16,900	9,220.00	155,818,000	
6861	キーエンス	1,500	58,760.00	88,140,000	
6941	山一電機	124,400	2,188.00	272,187,200	
6981	村田製作所	4,300	8,234.00	35,406,200	
8035	東京エレクトロン	3,200	55,270.00	176,864,000	
6201	豊田自動織機	12,600	8,900.00	112,140,000	
6902	デンソー	18,600	8,500.00	158,100,000	
7203	トヨタ自動車	107,200	2,275.50	243,933,600	
7747	朝日インテック	21,900	1,940.00	42,486,000	
9519	レノバ	7,700	1,495.00	11,511,500	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	13,100	9,960.00	130,476,000	
3994	マネーフォワード	33,600	4,970.00	166,992,000	
4385	メルカリ	9,700	3,625.00	35,162,500	
4443	Sansan	165,100	1,225.00	202,247,500	
9766	コナミホールディングス	12,800	7,000.00	89,600,000	
9984	ソフトバンクグループ	24,100	5,350.00	128,935,000	
8031	三井物産	71,700	2,965.00	212,590,500	
9983	ファーストリテイリング	1,900	64,050.00	121,695,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	390,300	740.30	288,939,090	
8750	第一生命ホールディングス	50,800	2,765.50	140,487,400	
8766	東京海上ホールディングス	14,900	7,087.00	105,596,300	
6069	トレンダーズ	196,700	758.00	149,098,600	
6532	ペイカレント・コンサルティング	3,300	40,650.00	134,145,000	
合 計		2,654,100		6,718,138,390	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	314,584,501
株式	7,685,682,100
未収配当金	11,286,350
流動資産合計	8,011,552,951
資産合計	8,011,552,951
負債の部	
流動負債	
未払解約金	659,272
未払利息	140
流動負債合計	659,412
負債合計	659,412
純資産の部	
元本等	
元本	1,038,180,740
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,972,712,799
元本等合計	8,010,893,539
純資産合計	8,010,893,539
負債純資産合計	8,011,552,951

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。
-------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	1,035,295,767円
期中追加設定元本額	294,125,778円
期中一部解約元本額	291,240,805円
元本の内訳※	
三菱UFJ ジャパン・アクティブ・プラス	21,349,426円
国内株式セレクション（ラップ向け）	142,912,866円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	989,207円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	6,396,947円
日本・小型株・ファンド	302,411,600円
日本株スタイル・ミックス・ファンド	14,428,038円
三菱UFJ 日本株スタイル・ミックス・ファンドF（適格機関投資家限定）	2,366,179円
三菱UFJ国際 日本・小型株・ファンド（適格機関投資家用）	249,119,268円
<DC>日本株スタイル・ミックス・ファンド	298,207,209円
合計	1,038,180,740円
2. 受益権の総数	1,038,180,740口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7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。

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△1,126,623,192
合計	△1,126,623,192

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	7.7163円
(1万口当たり純資産額)	(77,163円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表
(1)株式

(単位：円)

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1377	サカタのタネ	19,500	3,275.00	63,862,500	
1431	L i b W o r k	39,000	740.00	28,860,000	
5076	インフロニア・ホールディングス	149,000	1,054.00	157,046,000	
2607	不二製油グループ本社	15,000	2,330.00	34,950,000	
2925	ピクルスコーポレーション	40,100	1,586.00	63,598,600	
3569	セーレン	28,000	2,093.00	58,604,000	
4092	日本化学工業	14,000	2,638.00	36,932,000	
4113	田岡化学工業	74,000	1,192.00	88,208,000	
4187	大阪有機化学工業	24,500	2,986.00	73,157,000	
4203	住友ベークライト	35,500	5,340.00	189,570,000	
4362	日本精化	9,000	2,075.00	18,675,000	
4368	扶桑化学工業	41,400	4,735.00	196,029,000	
4931	新日本製薬	19,000	1,325.00	25,175,000	
4552	J C Rファーマ	17,500	2,032.00	35,560,000	
4565	そーせいグループ	60,500	1,462.00	88,451,000	
4572	カルナバイオサイエンス	22,200	965.00	21,423,000	
4595	ミズホメディー	15,000	2,145.00	32,175,000	
4599	ステムリム	52,000	633.00	32,916,000	
4880	セルソース	17,000	3,665.00	62,305,000	
5344	M A R U W A	10,800	13,820.00	149,256,000	
5393	ニチアス	45,000	2,595.00	116,775,000	
7943	ニチハ	23,000	2,618.00	60,214,000	
5563	新日本電工	559,000	326.00	182,234,000	
3433	トーカロ	29,500	1,320.00	38,940,000	
3445	R S T e c h n o l o g i e s	28,500	5,650.00	161,025,000	
6013	タクマ	80,000	1,424.00	113,920,000	
6118	アイダエンジニアリング	165,500	1,034.00	171,127,000	
6149	小田原エンジニアリング	17,000	2,227.00	37,859,000	
6245	ヒラノテクシード	36,000	2,416.00	86,976,000	
6272	レオン自動機	29,000	1,043.00	30,247,000	
6289	技研製作所	29,000	3,890.00	112,810,000	
6626	S E M I T E C	11,800	9,840.00	116,112,000	
6810	マクセル	98,000	1,230.00	120,540,000	
6947	図研	24,000	2,987.00	71,688,000	
6951	日本電子	10,400	6,250.00	65,000,000	
6955	F D K	39,000	838.00	32,682,000	

6966	三井ハイテック	13,800	8,500.00	117,300,000	
7244	市光工業	117,300	512.00	60,057,600	
3116	トヨタ紡織	55,000	2,180.00	119,900,000	
7600	日本エム・ディ・エム	69,000	1,609.00	111,021,000	
7729	東京精密	12,900	4,540.00	58,566,000	
7732	トプコン	145,400	1,486.00	216,064,400	
7780	メニコン	11,000	2,716.00	29,876,000	
7803	ブシロード	28,000	1,455.00	40,740,000	
7821	前田工織	57,100	3,155.00	180,150,500	
7839	SHOEI	47,000	4,375.00	205,625,000	
9090	丸和運輸機関	27,000	1,160.00	31,320,000	
1973	NECネットエスアイ	112,000	1,732.00	193,984,000	
3663	アートスパークホールディングス	70,400	700.00	49,280,000	
3762	テクマトリックス	43,200	1,568.00	67,737,600	
3966	ユーザベース	37,000	1,011.00	37,407,000	
3994	マネーフォワード	22,200	4,970.00	110,334,000	
4384	ラクスル	26,200	3,640.00	95,368,000	
4385	メルカリ	15,100	3,625.00	54,737,500	
4443	Sansan	80,000	1,225.00	98,000,000	
4449	ギフトィ	35,000	1,092.00	38,220,000	
4479	マクアケ	8,900	2,232.00	19,864,800	
4490	ビザスク	33,000	4,070.00	134,310,000	
3139	ラクト・ジャパン	14,000	1,979.00	27,706,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	23,000	2,571.00	59,133,000	
7456	松田産業	50,000	2,356.00	117,800,000	
2685	アダストリア	37,000	1,750.00	64,750,000	
3186	ネクステージ	77,800	2,932.00	228,109,600	
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	9,500	3,550.00	33,725,000	
7545	西松屋チェーン	43,000	1,491.00	64,113,000	
8174	日本瓦斯	96,000	1,662.00	159,552,000	
7164	全国保証	19,800	5,090.00	100,782,000	
7198	アルヒ	34,000	1,080.00	36,720,000	
2337	いちご	280,000	274.00	76,720,000	
3288	オープンハウスグループ	14,300	5,680.00	81,224,000	
3479	ティーケーピー	21,000	1,330.00	27,930,000	
8919	カチタス	23,000	3,360.00	77,280,000	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	24,000	1,727.00	41,448,000	
2395	新日本科学	60,000	1,676.00	100,560,000	
4293	セプテーニ・ホールディングス	448,300	415.00	186,044,500	
4763	クリーク・アンド・リバー社	44,000	1,745.00	76,780,000	
4848	フルキャストホールディングス	86,500	2,205.00	190,732,500	
6055	ジャパンマテリアル	83,000	1,658.00	137,614,000	

6071	I B J	122,000	759.00	92,598,000	
6099	エラン	98,000	1,022.00	100,156,000	
6191	エアトリ	52,000	3,030.00	157,560,000	
6197	ソラスト	50,000	1,060.00	53,000,000	
6532	ペイカレント・コンサルティング	4,900	40,650.00	199,185,000	
7354	ダイレクトマーケティングミックス	38,000	1,445.00	54,910,000	
9247	T R Eホールディングス	64,000	1,481.00	94,784,000	
合 計		4,911,300		7,685,682,100	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	60,970,351
株式	13,030,461,530
未収配当金	31,242,350
前払金	3,350,000
差入委託証拠金	4,650,000
流動資産合計	13,130,674,231
資産合計	13,130,674,231
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,727,750
未払解約金	282,782
未払利息	27
流動負債合計	4,010,559
負債合計	4,010,559
純資産の部	
元本等	
元本	9,433,518,811
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,693,144,861
元本等合計	13,126,663,672

[令和 4年 2月 7日現在]

純資産合計	13,126,663,672
負債純資産合計	13,130,674,231

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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	10,257,728,079円
期中追加設定元本額	1,460,069,871円
期中一部解約元本額	2,284,279,139円
元本の内訳※	
国内株式セレクション（ラップ向け）	1,232,794,812円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	7,795,612円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	58,298,699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）	538,130,278円
日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,087,752,057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）	508,747,353円
合計	9,433,518,811円
2. 受益権の総数	9,433,518,811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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△381,166,846
合計	△381,166,846

(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 4年 2月 7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	99,850,000	—	96,125,000	△3,725,000
合計		99,850,000	—	96,125,000	△3,725,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	〔令和 4年 2月 7日現在〕
1口当たり純資産額	1.3915円
(1万口当たり純資産額)	(13,915円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1801	大成建設	6,700	3,815.00	25,560,500	
1878	大東建託	5,500	13,480.00	74,140,000	
1928	積水ハウス	58,800	2,329.00	136,945,200	

2267	ヤクルト本社	10,100	5,790.00	58,479,000	
2269	明治ホールディングス	16,300	7,220.00	117,686,000	
2503	キリンホールディングス	24,900	1,882.00	46,861,800	
2587	サントリー食品インターナショナル	23,600	4,490.00	105,964,000	
2802	味の素	26,200	3,239.00	84,861,800	
2875	東洋水産	9,300	4,820.00	44,826,000	
2897	日清食品ホールディングス	5,400	8,960.00	48,384,000	
2914	日本たばこ産業	88,400	2,340.00	206,856,000	
4063	信越化学工業	4,000	18,970.00	75,880,000	
4185	J S R	10,300	3,450.00	35,535,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	25,900	839.30	21,737,870	
4452	花王	26,700	5,254.00	140,281,800	
4612	日本ペイントホールディングス	16,400	849.00	13,923,600	
4613	関西ペイント	26,800	2,296.00	61,532,800	
4901	富士フイルムホールディングス	22,500	7,612.00	171,270,000	
4911	資生堂	1,200	5,997.00	7,196,400	
4912	ライオン	37,600	1,513.00	56,888,800	
4967	小林製薬	5,300	9,470.00	50,191,000	
6988	日東電工	3,600	8,710.00	31,356,000	
8113	ユニ・チャーム	27,500	4,405.00	121,137,500	
4151	協和キリン	20,500	2,923.00	59,921,500	
4502	武田薬品工業	54,900	3,443.00	189,020,700	
4503	アステラス製薬	102,700	2,021.50	207,608,050	
4507	塩野義製薬	21,700	7,984.00	173,252,800	
4516	日本新薬	1,100	7,640.00	8,404,000	
4519	中外製薬	41,800	4,059.00	169,666,200	
4523	エーザイ	4,200	5,752.00	24,158,400	
4528	小野薬品工業	43,600	2,830.50	123,409,800	
4536	参天製薬	25,700	1,321.00	33,949,700	
4568	第一三共	15,300	2,360.50	36,115,650	
4578	大塚ホールディングス	39,300	4,091.00	160,776,300	
4581	大正製薬ホールディングス	7,200	5,690.00	40,968,000	
5019	出光興産	17,400	3,075.00	53,505,000	
5108	ブリヂストン	40,900	5,198.00	212,598,200	
5486	日立金属	39,000	2,088.00	81,432,000	
5947	リンナイ	6,800	10,110.00	68,748,000	
6273	SMC	1,400	63,910.00	89,474,000	
6326	クボタ	21,400	2,396.50	51,285,100	
6367	ダイキン工業	6,300	22,385.00	141,025,500	
6465	ホシザキ	3,500	8,680.00	30,380,000	
6586	マキタ	4,700	3,977.00	18,691,900	
6501	日立製作所	5,500	5,888.00	32,384,000	

6502	東芝	12,500	4,800.00	60,000,000	
6503	三菱電機	79,800	1,410.00	112,518,000	
6594	日本電産	5,200	9,981.00	51,901,200	
6701	日本電気	11,900	5,080.00	60,452,000	
6702	富士通	6,300	16,115.00	101,524,500	
6758	ソニーグループ	11,200	12,660.00	141,792,000	
6806	ヒロセ電機	6,400	17,280.00	110,592,000	
6845	アズビル	13,400	4,165.00	55,811,000	
6861	キーエンス	2,800	58,760.00	164,528,000	
6869	シスメックス	10,900	10,585.00	115,376,500	
6954	ファナック	1,100	22,270.00	24,497,000	
6965	浜松ホトニクス	18,100	5,810.00	105,161,000	
6971	京セラ	17,200	6,846.00	117,751,200	
6981	村田製作所	23,200	8,234.00	191,028,800	
7751	キヤノン	60,100	2,798.00	168,159,800	
8035	東京エレクトロン	900	55,270.00	49,743,000	
7203	トヨタ自動車	96,000	2,275.50	218,448,000	
7309	シマノ	5,300	25,940.00	137,482,000	
4543	テルモ	30,600	4,145.00	126,837,000	
7701	島津製作所	4,700	4,120.00	19,364,000	
7733	オリンパス	25,200	2,263.00	57,027,600	
7741	HOYA	11,000	15,470.00	170,170,000	
7747	朝日インテック	26,500	1,940.00	51,410,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	10,400	8,531.00	88,722,400	
7974	任天堂	2,900	58,490.00	169,621,000	
9502	中部電力	169,900	1,122.00	190,627,800	
9503	関西電力	89,200	1,070.00	95,444,000	
9531	東京瓦斯	61,300	2,299.00	140,928,700	
9532	大阪瓦斯	65,600	2,037.00	133,627,200	
9001	東武鉄道	11,000	2,839.00	31,229,000	
9005	東急	30,700	1,564.00	48,014,800	
9007	小田急電鉄	37,600	2,032.00	76,403,200	
9008	京王電鉄	7,000	5,150.00	36,050,000	
9009	京成電鉄	2,000	3,200.00	6,400,000	
9020	東日本旅客鉄道	20,300	6,955.00	141,186,500	
9022	東海旅客鉄道	7,700	14,950.00	115,115,000	
9041	近鉄グループホールディングス	12,300	3,415.00	42,004,500	
9042	阪急阪神ホールディングス	8,800	3,450.00	30,360,000	
9064	ヤマトホールディングス	12,900	2,483.00	32,030,700	
9143	SGホールディングス	53,300	2,364.00	126,001,200	
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	1,500	6,750.00	10,125,000	
3626	TIS	3,000	2,759.00	8,277,000	

3635	コーエーテクモホールディングス	4,100	4,135.00	16,953,500	
3659	ネクソン	7,300	2,339.00	17,074,700	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	1,500	9,960.00	14,940,000	
4307	野村総合研究所	15,500	4,040.00	62,620,000	
4684	オービック	8,700	18,840.00	163,908,000	
4689	Zホールディングス	106,500	579.10	61,674,150	
4704	トレンドマイクロ	4,400	6,130.00	26,972,000	
4716	日本オラクル	7,400	8,360.00	61,864,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	21,600	2,946.00	63,633,600	
4768	大塚商会	15,500	4,275.00	66,262,500	
9432	日本電信電話	63,500	3,349.00	212,661,500	
9433	KDDI	59,700	3,745.00	223,576,500	
9434	ソフトバンク	129,900	1,441.00	187,185,900	
9435	光通信	1,900	14,130.00	26,847,000	
9602	東宝	32,200	4,765.00	153,433,000	
9613	エス・ティ・ティ・データ	49,200	2,256.00	110,995,200	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	4,300	5,930.00	25,499,000	
9697	カプコン	14,900	2,893.00	43,105,700	
7459	メディopalホールディングス	27,100	2,172.00	58,861,200	
8001	伊藤忠商事	61,500	3,719.00	228,718,500	
8031	三井物産	39,600	2,965.00	117,414,000	
8053	住友商事	39,300	1,836.50	72,174,450	
8058	三菱商事	58,900	3,953.00	232,831,700	
9962	ミスミグループ本社	3,300	3,470.00	11,451,000	
2651	ローソン	17,000	4,805.00	81,685,000	
2702	日本マクドナルドホールディングス	39,900	4,995.00	199,300,500	
3064	MonotaRO	26,100	1,841.00	48,050,100	
3092	ZOZO	2,500	3,070.00	7,675,000	
3141	ウエルシアホールディングス	18,100	3,130.00	56,653,000	
3349	コスモス薬品	3,800	14,100.00	53,580,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	31,800	5,794.00	184,249,200	
3391	ツルハホールディングス	4,200	9,120.00	38,304,000	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	56,700	1,661.00	94,178,700	
9843	ニトリホールディングス	9,700	16,250.00	157,625,000	
9983	ファーストリテイリング	1,500	64,050.00	96,075,000	
7182	ゆうちょ銀行	219,800	1,174.00	258,045,200	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	251,200	740.30	185,963,360	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	52,300	4,336.00	226,772,800	
8411	みずほフィナンシャルグループ	114,600	1,618.50	185,480,100	
8725	MS&ADインシュアランスグループホール	30,500	4,150.00	126,575,000	

8766	東京海上ホールディングス	26,000	7,087.00	184,262,000	
8697	日本取引所グループ	18,300	2,391.00	43,755,300	
8802	三菱地所	19,100	1,689.00	32,259,900	
2331	総合警備保障	16,800	4,080.00	68,544,000	
2371	カカクコム	5,600	2,520.00	14,112,000	
2413	エムスリー	11,800	4,206.00	49,630,800	
4661	オリエンタルランド	10,300	20,920.00	215,476,000	
4732	ユー・エス・エス	23,700	1,905.00	45,148,500	
4751	サイバーエージェント	13,500	1,468.00	19,818,000	
6178	日本郵政	202,200	1,025.00	207,255,000	
9735	セコム	25,500	8,287.00	211,318,500	
合 計		4,125,900		13,030,461,530	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 4年 2月 7日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	36,988,473
株式	3,938,108,500
未収配当金	5,344,400
流動資産合計	3,980,441,373
資産合計	3,980,441,373
負債の部	
流動負債	
未払解約金	294,779
未払利息	16
流動負債合計	294,795
負債合計	294,795
純資産の部	
元本等	
元本	1,018,654,945
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,961,491,633

[令和 4年 2月 7日現在]

元本等合計	3,980,146,578
純資産合計	3,980,146,578
負債純資産合計	3,980,441,373

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。
-------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	1,133,997,312円
期中追加設定元本額	142,017,972円
期中一部解約元本額	257,360,339円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ ジャパン・アクティブ・プラス	313,066,518円
国内株式セレクション（ラップ向け）	193,578,277円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	1,526,256円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	11,258,500円
三菱ＵＦＪ ジャパン・アクティブ・ファンド	217,734,202円
世界ソブリン債券・日本株ファンド（毎月分配型）	265,780,152円
MUAM ジャパン・アクティブ・ニュートラル（適格機関投資家限定）	15,711,040円
合計	1,018,654,945円
2. 受益権の総数	1,018,654,945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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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る場合、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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△249,556,157
合計	△249,556,157

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	3.9073円
(1万口当たり純資産額)	(39,073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	
1605	I N P E X	26,700	1,174.00	31,345,800	
1407	ウエストホールディングス	24,300	4,125.00	100,237,500	
1928	積水ハウス	16,600	2,329.00	38,661,400	
1951	エクシオグループ	16,600	2,327.00	38,628,200	
5076	インフロニア・ホールディングス	45,700	1,054.00	48,167,800	
2802	味の素	18,300	3,239.00	59,273,700	
2875	東洋水産	8,200	4,820.00	39,524,000	
3402	東レ	67,200	670.80	45,077,760	
3407	旭化成	34,900	1,116.00	38,948,400	
4063	信越化学工業	4,800	18,970.00	91,056,000	
4186	東京応化工業	5,900	6,350.00	37,465,000	
4901	富士フイルムホールディングス	8,800	7,612.00	66,985,600	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	27,000	1,734.00	46,818,000	
4985	アース製薬	4,900	5,870.00	28,763,000	
4151	協和キリン	20,000	2,923.00	58,460,000	
4523	エーザイ	6,600	5,752.00	37,963,200	
4568	第一三共	48,500	2,360.50	114,484,250	
5301	東海カーボン	48,400	1,147.00	55,514,800	
5401	日本製鉄	46,700	1,967.00	91,858,900	

5713	住友金属鉱山	3,800	5,373.00	20,417,400	
5801	古河電気工業	8,500	2,205.00	18,742,500	
5938	L I X I L	22,600	2,516.00	56,861,600	
5991	日本発條	64,100	900.00	57,690,000	
6113	アマダ	34,600	1,097.00	37,956,200	
6361	荏原製作所	6,900	5,540.00	38,226,000	
6490	日本ピラー工業	15,200	3,100.00	47,120,000	
6586	マキタ	8,700	3,977.00	34,599,900	
7013	I H I	17,200	2,335.00	40,162,000	
4062	イビデン	9,800	6,030.00	59,094,000	
6501	日立製作所	12,700	5,888.00	74,777,600	
6502	東芝	16,500	4,800.00	79,200,000	
6702	富士通	4,300	16,115.00	69,294,500	
6723	ルネサスエレクトロニクス	75,700	1,256.00	95,079,200	
6758	ソニーグループ	13,000	12,660.00	164,580,000	
6967	新光電気工業	8,100	4,975.00	40,297,500	
6981	村田製作所	6,900	8,234.00	56,814,600	
8035	東京エレクトロン	1,000	55,270.00	55,270,000	
7012	川崎重工業	13,200	2,172.00	28,670,400	
7203	トヨタ自動車	78,600	2,275.50	178,854,300	
7269	スズキ	12,000	4,803.00	57,636,000	
7731	ニコン	48,400	1,305.00	63,162,000	
7911	凸版印刷	27,000	2,184.00	58,968,000	
9009	京成電鉄	22,200	3,200.00	71,040,000	
9068	丸全昭和運輸	6,200	3,185.00	19,747,000	
9069	センコーグループホールディングス	21,300	924.00	19,681,200	
9303	住友倉庫	9,800	2,083.00	20,413,400	
2327	日鉄ソリューションズ	17,600	3,605.00	63,448,000	
4689	Zホールディングス	69,200	579.10	40,073,720	
4812	電通国際情報サービス	11,100	3,495.00	38,794,500	
9432	日本電信電話	24,100	3,349.00	80,710,900	
9984	ソフトバンクグループ	15,100	5,350.00	80,785,000	
8001	伊藤忠商事	29,400	3,719.00	109,338,600	
8058	三菱商事	17,900	3,953.00	70,758,700	
2670	エービーシー・マート	12,900	5,200.00	67,080,000	
2685	アダストリア	23,200	1,750.00	40,600,000	
3186	ネクステージ	6,800	2,932.00	19,937,600	
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	10,900	3,550.00	38,695,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	113,900	740.30	84,320,170	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	14,100	4,336.00	61,137,600	
8473	SBIホールディングス	13,200	3,040.00	40,128,000	
8750	第一生命ホールディングス	23,100	2,765.50	63,883,050	

8766	東京海上ホールディングス	12,900	7,087.00	91,422,300	
8591	オリックス	20,700	2,471.50	51,160,050	
8919	カチタス	5,500	3,360.00	18,480,000	
4661	オリエンタルランド	3,100	20,920.00	64,852,000	
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	15,700	1,140.00	17,898,000	
6098	リクルートホールディングス	21,200	5,666.00	120,119,200	
6178	日本郵政	39,900	1,025.00	40,897,500	
合 計		1,569,900		3,938,108,500	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本株 E S G アクティブマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 4年 2月 7日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	35,726,276
株式	1,260,179,100
未収配当金	2,024,400
流動資産合計	1,297,929,776
資産合計	1,297,929,776
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,123
未払利息	15
流動負債合計	7,138
負債合計	7,138
純資産の部	
元本等	
元本	851,723,987
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	446,198,651
元本等合計	1,297,922,638
純資産合計	1,297,922,638
負債純資産合計	1,297,929,776

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。
--------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	295,455,387円
期中追加設定元本額	576,149,704円
期中一部解約元本額	19,881,104円
元本の内訳※	
国内株式セレクション（ラップ向け）	502,428,387円
三菱UFJ DC日本株ESGアクティブファンド	23,401,595円
三菱UFJ DC世界ESGバランスファンド	1,357,201円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	4,959,264円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	27,630,181円
日本株ESGアクティブファンド（適格機関投資家限定）	291,947,359円
合計	851,723,987円
2. 受益権の総数	851,723,987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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7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。

区分	自 令和 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△53,696,481
合計	△53,696,481

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	1.5239円
(1万口当たり純資産額)	(15,239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	
1928	積水ハウス	13,200	2,329.00	30,742,800	
2811	カゴメ	3,700	2,890.00	10,693,000	
8114	デサント	3,300	3,455.00	11,401,500	
3863	日本製紙	6,600	1,177.00	7,768,200	
7988	ニフコ	6,600	3,430.00	22,638,000	
4502	武田薬品工業	1,900	3,443.00	6,541,700	
4568	第一三共	17,300	2,360.50	40,836,650	
5108	ブリヂストン	10,300	5,198.00	53,539,400	
6146	ディスコ	1,400	32,250.00	45,150,000	
6370	栗田工業	5,600	4,765.00	26,684,000	
6409	キトー	10,700	1,687.00	18,050,900	
6501	日立製作所	10,400	5,888.00	61,235,200	
6502	東芝	10,500	4,800.00	50,400,000	
6645	オムロン	2,300	8,227.00	18,922,100	
6702	富士通	3,200	16,115.00	51,568,000	
6753	シャープ	10,000	1,247.00	12,470,000	
6758	ソニーグループ	5,200	12,660.00	65,832,000	
6971	京セラ	4,800	6,846.00	32,860,800	
7752	リコー	36,100	982.00	35,450,200	
7203	トヨタ自動車	25,300	2,275.50	57,570,150	
7701	島津製作所	9,800	4,120.00	40,376,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	6,100	8,531.00	52,039,100	
7911	凸版印刷	31,300	2,184.00	68,359,200	

7951	ヤマハ	7,300	5,370.00	39,201,000	
9147	NIPPON EXPRESSホール ディン	4,400	6,750.00	29,700,000	
9697	カプコン	20,100	2,893.00	58,149,300	
8058	三菱商事	11,500	3,953.00	45,459,500	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	9,900	5,794.00	57,360,600	
8174	日本瓦斯	24,100	1,662.00	40,054,200	
8252	丸井グループ	15,700	2,274.00	35,701,800	
8367	南都銀行	13,200	2,044.00	26,980,800	
4661	オリエンタルランド	2,100	20,920.00	43,932,000	
6098	リクルートホールディングス	8,400	5,666.00	47,594,400	
9735	セコム	1,800	8,287.00	14,916,600	
合 計		354,100		1,260,179,100	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ジャパンＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 4年 2月 7日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,776,657
株式	1,850,640,130
投資証券	30,556,100
未収配当金	2,103,012
前払金	525,000
差入委託証拠金	930,000
流動資産合計	1,908,530,899
資産合計	1,908,530,899
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	600,550
未払金	10,464,045
未払解約金	192,617
未払利息	10

[令和 4年 2月 7日現在]	
流動負債合計	11,257,222
負債合計	11,257,222
純資産の部	
元本等	
元本	1,442,999,165
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	454,274,512
元本等合計	1,897,273,677
純資産合計	1,897,273,677
負債純資産合計	1,908,530,899

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 2月 7日現在]
1. 期首	令和 3年 2月 6日
期首元本額	598,810,829円
期中追加設定元本額	1,159,792,478円
期中一部解約元本額	315,604,142円
元本の内訳※	
国内株式セレクション（ラップ向け）	462,595,753円
eMAXIS ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス	864,705,491円
三菱UFJ DCジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス	85,956,939円
アドバンスト・バランスⅢ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	4,316,630円
アドバンスト・バランスⅣ（FOFs用）（適格機関投資家限定）	25,424,352円
合計	1,442,999,165円
2. 受益権の総数	1,442,999,165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 3年 2月 6日 至 令和 4年 2月 7日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 2月 7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 4年 2月 7日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	27,876,550
投資証券	194,907
合計	28,071,457

(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 4年 2月 7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	19,825,000	—	19,225,000	△600,000
合計		19,825,000	—	19,225,000	△600,000

（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 4年 2月 7日現在]
1口当たり純資産額	1.3148円
(1万口当たり純資産額)	(13,148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	
1333	マルハニチロ	300	2,499.00	749,700	
1605	I N P E X	6,700	1,174.00	7,865,800	
1721	コムシスホールディングス	700	2,728.00	1,909,600	
1801	大成建設	1,300	3,815.00	4,959,500	
1802	大林組	4,300	942.00	4,050,600	
1803	清水建設	3,600	783.00	2,818,800	
1812	鹿島建設	3,000	1,379.00	4,137,000	
1860	戸田建設	1,500	744.00	1,116,000	
1911	住友林業	900	2,039.00	1,835,100	
1925	大和ハウス工業	3,700	3,389.00	12,539,300	
1928	積水ハウス	4,100	2,329.00	9,548,900	
1951	エクシオグループ	700	2,327.00	1,628,900	
1969	高砂熱学工業	300	1,897.00	569,100	
2501	サッポロホールディングス	400	2,235.00	894,000	
2502	アサヒグループホールディングス	3,000	4,770.00	14,310,000	
2503	キリンホールディングス	5,400	1,882.00	10,162,800	
2587	サントリー食品インターナショナル	900	4,490.00	4,041,000	
2607	不二製油グループ本社	300	2,330.00	699,000	
2801	キッコーマン	1,000	8,770.00	8,770,000	
2802	味の素	3,100	3,239.00	10,040,900	
2809	キューピー	700	2,397.00	1,677,900	
2810	ハウス食品グループ本社	400	2,921.00	1,168,400	
2871	ニチレイ	700	2,616.00	1,831,200	
2897	日清食品ホールディングス	400	8,960.00	3,584,000	
3101	東洋紡	500	1,305.00	652,500	
3401	帝人	1,200	1,384.00	1,660,800	
3402	東レ	9,100	670.80	6,104,280	
3863	日本製紙	700	1,177.00	823,900	
3941	レンゴー	1,200	864.00	1,036,800	
3405	クラレ	2,000	1,035.00	2,070,000	
3407	旭化成	8,300	1,116.00	9,262,800	
4005	住友化学	9,800	586.00	5,742,800	
4063	信越化学工業	2,300	18,970.00	43,631,000	
4118	カネカ	300	3,910.00	1,173,000	
4183	三井化学	1,200	3,040.00	3,648,000	
4186	東京応化工業	200	6,350.00	1,270,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	8,400	839.30	7,050,120	
4202	ダイセル	1,700	876.00	1,489,200	
4204	積水化学工業	2,500	1,937.00	4,842,500	
4208	宇部興産	700	2,169.00	1,518,300	

4272	日本化薬	900	1,166.00	1,049,400	
4452	花王	3,100	5,254.00	16,287,400	
4613	関西ペイント	1,200	2,296.00	2,755,200	
4631	D I C	500	2,997.00	1,498,500	
4634	東洋インキSCホールディングス	200	1,925.00	385,000	
4901	富士フイルムホールディングス	2,400	7,612.00	18,268,800	
4911	資生堂	2,600	5,997.00	15,592,200	
6988	日東電工	900	8,710.00	7,839,000	
7988	ニフコ	500	3,430.00	1,715,000	
8113	ユニ・チャーム	2,700	4,405.00	11,893,500	
4151	協和キリン	1,800	2,923.00	5,261,400	
4503	アステラス製薬	12,300	2,021.50	24,864,450	
4506	大日本住友製薬	1,200	1,242.00	1,490,400	
4507	塩野義製薬	1,700	7,984.00	13,572,800	
4519	中外製薬	4,400	4,059.00	17,859,600	
4523	エーザイ	1,600	5,752.00	9,203,200	
4528	小野薬品工業	2,400	2,830.50	6,793,200	
4534	持田製薬	200	3,720.00	744,000	
4536	参天製薬	2,400	1,321.00	3,170,400	
4568	第一三共	11,600	2,360.50	27,381,800	
5020	ENEOSホールディングス	20,200	468.70	9,467,740	
5332	TOTO	900	4,885.00	4,396,500	
5333	日本碍子	1,700	1,862.00	3,165,400	
5334	日本特殊陶業	1,000	2,205.00	2,205,000	
5393	ニチアス	400	2,595.00	1,038,000	
5486	日立金属	1,400	2,088.00	2,923,200	
5703	日本軽金属ホールディングス	400	1,787.00	714,800	
5711	三菱マテリアル	700	2,085.00	1,459,500	
5713	住友金属鉱山	1,600	5,373.00	8,596,800	
5714	DOWAホールディングス	300	5,180.00	1,554,000	
6005	三浦工業	600	3,295.00	1,977,000	
6013	タクマ	400	1,424.00	569,600	
6268	ナブテスコ	700	3,505.00	2,453,500	
6287	サトーホールディングス	200	2,027.00	405,400	
6301	小松製作所	5,800	2,819.50	16,353,100	
6305	日立建機	700	2,930.00	2,051,000	
6326	クボタ	6,800	2,396.50	16,296,200	
6361	荏原製作所	600	5,540.00	3,324,000	
6367	ダイキン工業	1,600	22,385.00	35,816,000	
6370	栗田工業	700	4,765.00	3,335,500	
6383	ダイフク	700	8,530.00	5,971,000	
6457	グローリー	300	2,089.00	626,700	

6460	セガサミーホールディングス	1,100	2,071.00	2,278,100	
6465	ホシザキ	400	8,680.00	3,472,000	
6472	N T N	2,600	233.00	605,800	
7004	日立造船	1,100	743.00	817,300	
7011	三菱重工業	2,100	3,193.00	6,705,300	
3105	日清紡ホールディングス	900	989.00	890,100	
4062	イビデン	700	6,030.00	4,221,000	
4902	コニカミノルタ	3,000	498.00	1,494,000	
6501	日立製作所	6,400	5,888.00	37,683,200	
6503	三菱電機	12,000	1,410.00	16,920,000	
6506	安川電機	1,600	4,800.00	7,680,000	
6588	東芝テック	200	4,945.00	989,000	
6645	オムロン	1,200	8,227.00	9,872,400	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	400	2,270.00	908,000	
6701	日本電気	1,600	5,080.00	8,128,000	
6702	富士通	1,300	16,115.00	20,949,500	
6728	アルバック	300	5,900.00	1,770,000	
6752	パナソニック	14,600	1,201.50	17,541,900	
6754	アンリツ	900	1,581.00	1,422,900	
6758	ソニーグループ	8,300	12,660.00	105,078,000	
6762	T D K	2,600	4,555.00	11,843,000	
6806	ヒロセ電機	200	17,280.00	3,456,000	
6807	日本航空電子工業	300	1,832.00	549,600	
6841	横河電機	1,500	1,868.00	2,802,000	
6845	アズビル	800	4,165.00	3,332,000	
6849	日本光電工業	500	3,100.00	1,550,000	
6861	キーエンス	1,300	58,760.00	76,388,000	
6869	シスメックス	1,100	10,585.00	11,643,500	
6923	スタンレー電気	900	2,666.00	2,399,400	
6925	ウシオ電機	600	1,847.00	1,108,200	
6981	村田製作所	3,800	8,234.00	31,289,200	
8035	東京エレクトロン	1,000	55,270.00	55,270,000	
6902	デンソー	2,900	8,500.00	24,650,000	
7012	川崎重工業	900	2,172.00	1,954,800	
7203	トヨタ自動車	69,900	2,275.50	159,057,450	
7205	日野自動車	1,900	1,060.00	2,014,000	
7272	ヤマハ発動機	2,000	2,777.00	5,554,000	
4543	テルモ	4,300	4,145.00	17,823,500	
7701	島津製作所	1,600	4,120.00	6,592,000	
7731	ニコン	2,000	1,305.00	2,610,000	
7762	シチズン時計	1,800	505.00	909,000	
7912	大日本印刷	1,500	2,739.00	4,108,500	

7936	アシックス	1,000	2,392.00	2,392,000	
7951	ヤマハ	900	5,370.00	4,833,000	
7966	リンテック	300	2,579.00	773,700	
7974	任天堂	700	58,490.00	40,943,000	
7984	コクヨ	600	1,700.00	1,020,000	
9502	中部電力	4,200	1,122.00	4,712,400	
9504	中国電力	1,900	873.00	1,658,700	
9508	九州電力	2,700	823.00	2,222,100	
9519	レノバ	200	1,495.00	299,000	
9531	東京瓦斯	2,500	2,299.00	5,747,500	
9532	大阪瓦斯	2,500	2,037.00	5,092,500	
9533	東邦瓦斯	500	3,150.00	1,575,000	
9001	東武鉄道	1,200	2,839.00	3,406,800	
9003	相鉄ホールディングス	500	2,134.00	1,067,000	
9005	東急	3,300	1,564.00	5,161,200	
9007	小田急電鉄	1,900	2,032.00	3,860,800	
9008	京王電鉄	700	5,150.00	3,605,000	
9020	東日本旅客鉄道	2,000	6,955.00	13,910,000	
9021	西日本旅客鉄道	1,400	4,938.00	6,913,200	
9024	西武ホールディングス	1,500	1,186.00	1,779,000	
9031	西日本鉄道	400	2,538.00	1,015,200	
9041	近鉄グループホールディングス	1,100	3,415.00	3,756,500	
9042	阪急阪神ホールディングス	1,500	3,450.00	5,175,000	
9044	南海電気鉄道	700	2,308.00	1,615,600	
9048	名古屋鉄道	1,200	1,829.00	2,194,800	
9065	山九	400	4,075.00	1,630,000	
9069	センコーグループホールディングス	700	924.00	646,800	
9075	福山通運	200	3,650.00	730,000	
9086	日立物流	200	5,360.00	1,072,000	
9142	九州旅客鉄道	900	2,433.00	2,189,700	
9143	S Gホールディングス	2,100	2,364.00	4,964,400	
9147	N I P P O N E X P R E S Sホール ディン	500	6,750.00	3,375,000	
9101	日本郵船	1,100	9,280.00	10,208,000	
4307	野村総合研究所	2,200	4,040.00	8,888,000	
4385	メルカリ	700	3,625.00	2,537,500	
4689	Zホールディングス	17,700	579.10	10,250,070	
7518	ネットワンシステムズ	600	2,733.00	1,639,800	
8056	日本ユニシス	500	3,135.00	1,567,500	
9432	日本電信電話	8,500	3,349.00	28,466,500	
9433	K D D I	10,600	3,745.00	39,697,000	
9434	ソフトバンク	18,900	1,441.00	27,234,900	
9719	S C S K	1,000	1,956.00	1,956,000	

2784	アルフレッサ ホールディングス	1,200	1,697.00	2,036,400	
3167	TOKAIホールディングス	600	898.00	538,800	
3360	シップヘルスケアホールディングス	500	2,571.00	1,285,500	
7476	アズワン	200	6,120.00	1,224,000	
7575	日本ライフライン	400	1,001.00	400,400	
8001	伊藤忠商事	7,800	3,719.00	29,008,200	
8060	キヤノンマーケティングジャパン	300	2,502.00	750,600	
8130	サンゲツ	300	1,572.00	471,600	
9987	スズケン	400	3,545.00	1,418,000	
2651	ローソン	300	4,805.00	1,441,500	
3050	DCMホールディングス	800	1,104.00	883,200	
8252	丸井グループ	1,300	2,274.00	2,956,200	
8267	イオン	4,300	2,659.00	11,433,700	
8282	ケーズホールディングス	1,100	1,239.00	1,362,900	
9831	ヤマダホールディングス	4,500	398.00	1,791,000	
9983	ファーストリテイリング	400	64,050.00	25,620,000	
8308	りそなホールディングス	13,600	543.20	7,387,520	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	2,200	4,240.00	9,328,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	8,600	4,336.00	37,289,600	
8331	千葉銀行	3,500	789.00	2,761,500	
8355	静岡銀行	2,900	916.00	2,656,400	
8418	山口フィナンシャルグループ	1,300	739.00	960,700	
8604	野村ホールディングス	20,300	541.50	10,992,450	
8630	SOMPOホールディングス	2,100	5,620.00	11,802,000	
8725	MS&ADインシュアランスグループ ホール	2,900	4,150.00	12,035,000	
8750	第一生命ホールディングス	6,600	2,765.50	18,252,300	
8766	東京海上ホールディングス	4,100	7,087.00	29,056,700	
8795	T&Dホールディングス	3,500	1,826.00	6,391,000	
8424	芙蓉総合リース	100	7,720.00	772,000	
8439	東京センチュリー	200	5,880.00	1,176,000	
8591	オリックス	8,100	2,471.50	20,019,150	
3003	ヒューリック	2,500	1,081.00	2,702,500	
3231	野村不動産ホールディングス	800	2,781.00	2,224,800	
3289	東急不動産ホールディングス	4,000	650.00	2,600,000	
8801	三井不動産	6,000	2,492.00	14,952,000	
8802	三菱地所	7,800	1,689.00	13,174,200	
2331	総合警備保障	500	4,080.00	2,040,000	
4544	H. U. グループホールディングス	300	2,954.00	886,200	
4661	オリエンタルランド	1,300	20,920.00	27,196,000	
4665	ダスキン	300	2,750.00	825,000	
6028	テクノプロ・ホールディングス	700	3,510.00	2,457,000	
6098	リクルートホールディングス	8,900	5,666.00	50,427,400	

9716	乃村工藝社	500	958.00	479,000	
9735	セコム	1,400	8,287.00	11,601,800	
9744	メイテック	200	6,700.00	1,340,000	
9783	ベネッセホールディングス	400	2,276.00	910,400	
合 計		606,100		1,850,640,130	

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資証券	産業ファンド投資法人	12	2,218,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4	1,252,000	
	日本プロロジスリート投資法人	14	4,830,000	
	ヒューリックリート投資法人	8	1,291,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	28	4,418,400	
	日本ビルファンド投資法人	10	6,470,000	
	日本都市ファンド投資法人	46	4,379,200	
	オリックス不動産投資法人	17	2,803,300	
	日本プライムリアルティ投資法人	5	1,870,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	8	1,023,200	
合計		152	30,556,100	

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】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	15,460,294,997
II 負債総額	21,524,165
III 純資産総額（I－II）	15,438,770,832
IV 発行済口数	12,053,422,696口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.2809
(10,000口当たり)	(12,809)

(参考)

ＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	779,701,295,828
II 負債総額	74,184,473,006
III 純資産総額（I－II）	705,516,822,822
IV 発行済口数	324,402,107,332口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	2.1748
(10,000口当たり)	(21,748)

J P X日経４００インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	7,153,971,589
II 負債総額	2,003,061
III 純資産総額（I－II）	7,151,968,528
IV 発行済口数	3,900,649,697口

V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8335
（10,000口当たり）	（18,335）

日本株インカム・マザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

I 資産総額	7,522,668,343
II 負債総額	47,937,189
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,474,731,154
IV 発行済口数	3,057,308,926口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4449
（10,000口当たり）	（24,449）

JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

I 資産総額	5,018,307,126
II 負債総額	1,292,952
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,017,014,174
IV 発行済口数	3,229,501,298口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5535
（10,000口当たり）	（15,535）

日本株オープン「35」マザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

（単位：円）

I 資産総額	6,873,935,538
II 負債総額	97,971,050
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,775,964,488
IV 発行済口数	1,699,447,869口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9872

(10,000口当たり)	(39,872)
--------------	----------

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	8,680,352,406
II 負債総額	363,181,916
III 純資産総額（I－II）	8,317,170,490
IV 発行済口数	1,081,469,470口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	7.6906
(10,000口当たり)	(76,906)

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	12,863,466,676
II 負債総額	30,147,389
III 純資産総額（I－II）	12,833,319,287
IV 発行済口数	9,394,045,768口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.3661
(10,000口当たり)	(13,661)

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	4,076,086,466
II 負債総額	171,607,889
III 純資産総額（I－II）	3,904,478,577
IV 発行済口数	1,012,131,146口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	3.8577
(10,000口当たり)	(38,577)

日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,278,852,379
II 負債総額	7
III 純資産総額（I－II）	1,278,852,372
IV 発行済口数	853,539,391口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.4983
(10,000口当たり)	(14,983)

ジャパンＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,885,644,314
II 負債総額	10,282,005
III 純資産総額（I－II）	1,875,362,309
IV 発行済口数	1,470,538,840口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.2753
(10,000口当たり)	(12,753)

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(１) 名義書換等

該当事項はありません。

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

(２) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(３) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

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

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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

2022年2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤投資行動のモニタリング1

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

⑥投資行動のモニタリング2

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

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2022年 2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	899	18,862,930
追加型公社債投資信託	16	1,349,427
単位型株式投資信託	89	407,755
単位型公社債投資信託	50	182,673
合 計	1,054	20,802,785

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36期事業年度（自 令和2年4月1日 至 令和3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37期事業年度に係る中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
-----------------------	-----------------------

(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	56,398,457	※2	56,803,388
有価証券		1,960,318		2,001
前払費用		575,904		598,135
未収入金		14,559		31,359
未収委託者報酬		10,296,453		13,216,357
未収収益	※2	638,994	※2	662,230
金銭の信託		100,000		2,300,000
その他		254,330		269,506
流動資産合計		70,239,017		73,882,978
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	584,048	※1	548,902
器具備品	※1	871,893	※1	1,435,369
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,084,375		2,612,705
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,369,611		3,569,171
ソフトウェア仮勘定		1,374,932		1,895,190
無形固定資産合計		4,760,365		5,480,184
投資その他の資産				
投資有価証券		16,704,756		18,616,670
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	※1	819,255	※1	814,684
長期差入保証金		565,358		538,497
前払年金費用		375,031		258,835
繰延税金資産		1,912,824		916,962
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		20,718,993		21,487,417
固定資産合計		27,563,734		29,580,307
資産合計		97,802,752		103,463,286

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	687,565	533,622
未払金		
未払収益分配金	131,478	158,856
未払償還金	395,400	133,877
未払手数料	※2 4,026,078	※2 5,200,810
その他未払金	※2 3,818,195	※2 4,412,521
未払費用	※2 4,402,578	※2 4,755,909
未払消費税等	629,469	752,617
未払法人税等	617,341	873,027

賞与引当金	933,517	933,381
役員賞与引当金	124,590	160,710
その他	701,285	691,143
流動負債合計	16,467,499	18,606,476
固定負債		
長期未払金	32,400	21,600
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
役員退職慰労引当金	130,784	117,938
時効後支払損引当金	238,811	245,426
固定負債合計	1,412,398	1,530,479
負債合計	17,879,897	20,136,956
(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	25,847,605	26,951,289
利益剰余金合計	33,188,194	34,291,879
株主資本合計	79,921,039	81,024,723

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3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	1,815	2,301,606
評価・換算差額等合計	1,815	2,301,606
純資産合計	79,922,854	83,326,329
負債純資産合計	97,802,752	103,463,286

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	67,967,489	67,963,712
投資顧問料	2,385,084	2,443,980
その他営業収益	16,085	21,613
営業収益合計	70,368,658	70,429,306
営業費用		

支払手数料	※2	27,106,451	※2	26,689,896
広告宣伝費		696,418		668,150
公告費		1,000		250
調査費				
調査費		1,857,271		2,077,942
委託調査費		11,579,175		12,035,954
事務委託費		847,769		798,528
営業雑経費				
通信費		153,731		296,490
印刷費		427,118		378,180
協会費		52,053		51,841
諸会費		15,990		16,613
事務機器関連費		1,953,926		1,977,769
その他営業雑経費		-		8,391
営業費用合計		44,690,907		45,000,009
一般管理費				
給料				
役員報酬		331,987		352,879
給料・手当		6,611,427		6,461,546
賞与引当金繰入		933,517		933,381
役員賞与引当金繰入		124,590		160,710
福利厚生費		1,276,950		1,272,568
交際費		11,871		2,721
旅費交通費		165,891		22,768
租税公課		360,165		402,939
不動産賃借料		647,402		666,331
退職給付費用		422,919		481,135
役員退職慰労引当金繰入		48,183		11,763
固定資産減価償却費		1,307,555		1,358,911
諸経費		427,212		413,538
一般管理費合計		12,669,674		12,541,193
営業利益		13,008,076		12,888,103

(単位：千円)

		第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)		第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業外収益				
受取配当金		90,965		170,807
受取利息	※2	4,169	※2	2,726
投資有価証券償還益		585,179		81,557
収益分配金等時効完成分		101,734		275,835
受取賃貸料	※2	65,808	※2	65,808
その他		19,987		12,504
営業外収益合計		867,845		609,239
営業外費用				
投資有価証券償還損		96,379		95,946
時効後支払損引当金繰入		-		16,395
事務過誤費		3,483		-
賃貸関連費用		20,339		13,472
その他		1,920		2,932

営業外費用合計		122,122		128,747
経常利益		13,753,799		13,368,595
特別利益				
投資有価証券売却益		174,842		2,007,655
特別利益合計		174,842		2,007,655
特別損失				
投資有価証券売却損		75,963		51,737
投資有価証券評価損		163,865		26,317
固定資産除却損	※1	8,832	※1	536
固定資産売却損		435		-
特別損失合計		249,096		78,591
税引前当期純利益		13,679,545		15,297,659
法人税、住民税及び事業税	※2	4,146,534	※2	4,755,427
法人税等調整額		79,824		△19,122
法人税等合計		4,226,359		4,736,304
当期純利益		9,453,186		10,561,354

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

(単位：千円)

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

	評価・換算差額等		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

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		

当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当期変動額									
剰余金の配当							△9,457,670	△9,457,670	△9,457,670
当期純利益							10,561,354	10,561,354	10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,103,684	1,103,684	1,103,684
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723

	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
当期変動額			
剰余金の配当			△9,457,670
当期純利益			10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	2,299,791	2,299,791	2,299,791
当期変動額合計	2,299,791	2,299,791	3,403,475
当期末残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329

[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. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 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。

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、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。

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権

等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

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

①退職給付見込額の期間帰属方法

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

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

6.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(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31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

(未適用の会計基準等)

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

(1)概要

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

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

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

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

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

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

(貸借対照表関係)

※1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
建物	599,542千円	643,920千円
器具備品	1,408,613千円	1,545,179千円
投資不動産	145,391千円	151,833千円

※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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
預金	314,247千円	40,328,414千円
未収収益	15,773千円	14,138千円
未払手数料	712,210千円	772,495千円
その他未払金	3,029,426千円	3,425,136千円
未払費用	432,019千円	349,222千円

(損益計算書関係)

※1.固定資産除却損の内訳

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

器具備品	8,832千円	536千円
計	8,832千円	536千円

※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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
支払手数料	5,234,629千円	5,128,270千円
受取利息	2千円	143千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,030,180千円	3,492,898千円

(株主資本等変動計算書関係)

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。

- | | | |
|---|----------|-------------|
| ① | 配当金の総額 | 9,675,175千円 |
| ② | 1株当たり配当額 | 45,728円 |
| ③ | 基準日 | 平成31年3月31日 |
| ④ | 効力発生日 | 令和元年6月27日 |

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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

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

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	10,576,511千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	49,988円
④	基準日	令和3年3月31日
⑤	効力発生日	令和3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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
1年内	675,956千円	709,808千円
1年超	—	709,808千円
合計	675,956千円	1,419,616千円

(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、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、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) 金銭の信託	100,000	100,000	—
(4) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	—
(5) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	—
資産計	85,428,625	85,428,625	—
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	—
負債計	4,026,078	4,026,078	—

第36期(令和3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	56,803,388	56,803,388	—
(2) 有価証券	2,001	2,001	—
(3) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	—
(4) 未収委託者報酬	13,216,357	13,216,357	—
(5) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	—

資産計	90,907,057	90,907,057	—
(1) 未払手数料	5,200,810	5,200,810	—
負債計	5,200,810	5,200,810	—

(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、(4)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、(5)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。

(3)金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
非上場株式	31,360	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、「(5) 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	—	—	—
金銭の信託	100,000	—	—	—
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	68,755,228	5,652,257	4,813,929	27,375

第36期(令和3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	56,803,388	—	—	—
金銭の信託	2,300,000	—	—	—
未収委託者報酬	13,216,357	—	—	—
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	2,001	8,412,286	3,123,026	11,398

合計	72,321,747	8,412,286	3,123,026	11,398
----	------------	-----------	-----------	--------

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第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	8,874,369	10,037,087	△1,162,718
	小計	8,874,369	10,037,087	△1,162,718
合計		18,733,714	18,731,098	2,616

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は100,000千円）を含めております。

非上場株式（貸借対照表計上額は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、含めておりません。

第36期(令和3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	14,810,957	11,362,471	3,448,485
	小計	14,810,957	11,362,471	3,448,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	6,076,354	6,207,447	△131,093
	小計	6,076,354	6,207,447	△131,093
合計		20,887,311	17,569,919	3,317,392

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は2,300,000千円）を含めております。

非上場株式（貸借対照表計上額は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、含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

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

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
----	---------	-------------	-------------

株式	—	—	—
債券	—	—	—
その他	5,747,529	2,007,655	51,737
合計	5,747,529	2,007,655	51,737

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。

当事業年度において、有価証券について26,317千円（その他有価証券のその他26,317千円）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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,712,289 千円	3,718,736 千円
勤務費用	204,225	203,106
利息費用	17,557	19,110
数理計算上の差異の 発生額	△52,430	△18,826
退職給付の支払額	△162,904	△192,890
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,718,736	3,729,235

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
年金資産の期首残高	2,666,937 千円	2,460,824 千円
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の 発生額	△164,633	304,281
事業主からの拠出額	51,282	—
退職給付の支払額	△140,518	△159,390
年金資産の期末残高	2,460,824	2,649,846

（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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,969,807 千円	2,810,893 千円
年金資産	△2,460,824	△2,649,846
	508,982	161,046
非積立型制度の退職給付債務	748,929	918,342
未積立退職給付債務	1,257,911	1,079,388

未認識数理計算上の差異	△203,136	161,333
未認識過去勤務費用	△419,405	△354,043
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
前払年金費用	△375,031	△258,835
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
勤務費用	204,225 千円	203,106 千円
利息費用	17,557	19,110
期待運用収益	△47,757	△44,130
数理計算上の差異の 費用処理額	24,035	41,361
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	6,427	44,446
確定給付制度に係る 退職給付費用	269,848	329,255

(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、再就職支援金及び退職金です。

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
債券	64.7 %	62.7 %
株式	32.3	35.4
その他	3.0	1.9
合計	100	100

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
割引率	0.095～0.52%	0.051～0.59%
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153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
繰延税金資産		

減損損失	427,046千円	418,394千円
投資有価証券評価損	226,322	188,859
未払事業税	117,461	180,263
賞与引当金	285,842	285,801
役員賞与引当金	19,703	25,472
役員退職慰労引当金	40,046	36,112
退職給付引当金	309,384	350,756
減価償却超過額	96,767	68,024
委託者報酬	213,044	209,938
長期差入保証金	40,180	48,639
時効後支払損引当金	73,124	75,149
連結納税適用による時価評価	57,656	38,873
その他	123,248	87,023
繰延税金資産 小計	2,029,829	2,013,308
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	2,029,829	2,013,308
繰延税金負債		
前払年金費用	△114,834	△79,225
連結納税適用による時価評価	△1,260	△1,203
その他有価証券評価差額金	△801	△1,015,785
その他	△109	△101
繰延税金負債 合計	△117,005	△1,096,346
繰延税金資産の純額	1,912,824	916,962

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35期（令和2年3月31日現在）及び第36期（令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）及び第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,234,629 千円	未払手数料	712,210 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	583,270 千円	未払費用	302,681 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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)	3,492,898 千円	その他未払金	3,425,136 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,128,270 千円	未払手数料	772,495 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	523,327 千円	未払費用	290,120 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3)	科目	期末残高 (注3)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注1)	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2)	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入 (注2)	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2)	4,126 千円	未収収益	997 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注1)	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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3)	科目	期末残高 (注3)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注1)	3,729,785 千円	未払手数料	764,501 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注1)	5,655,482 千円	未払手数料	1,193,245 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 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。
2. 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。
3. 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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
1株当たり純資産額	377,741.17円	393,827.09円
1株当たり当期純利益金額	44,678.80円	49,916.36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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
当期純利益金額（千円）	9,453,186	10,561,354
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）	9,453,186	10,561,354
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37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)		
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		48,742,270
有価証券		1,291,000
前払費用		682,143
未収入金		166,605
未収委託者報酬		15,228,560
未収収益		694,402
金銭の信託		5,301,000
その他		226,759
流動資産合計		72,332,741
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	527,772
器具備品	※1	1,371,778
土地		628,433
有形固定資産合計		2,527,984
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,217,271
ソフトウェア仮勘定		1,478,970
無形固定資産合計		5,712,064
投資その他の資産		

投資有価証券		14,943,458
関係会社株式		320,136
投資不動産	※1	813,041
長期差入保証金		531,230
前払年金費用		224,272
繰延税金資産		733,199
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		17,586,969
固定資産合計		25,827,017
資産合計		98,159,759

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(令和3年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		663,405
未払金		
未払収益分配金		187,200
未払償還金		7,418
未払手数料		6,029,978
その他未払金		2,623,176
未払費用		5,348,002
未払消費税等	※2	757,223
未払法人税等		702,806
賞与引当金		924,214
役員賞与引当金		65,985
その他		5,517
流動負債合計		17,314,927
固定負債		
長期未払金		10,800
退職給付引当金		1,204,214
役員退職慰労引当金		117,938
時効後支払損引当金		256,262
固定負債合計		1,589,215
負債合計		18,904,143
(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		23,330,110
利益剰余金合計		30,670,700
株主資本合計		77,403,544

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(令和3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	1,852,071
評価・換算差額等合計	1,852,071
純資産合計	79,255,616
負債純資産合計	98,159,759

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(自 令和3年4月1日

至 令和3年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	39,061,243
投資顧問料	1,319,230
その他営業収益	7,249
営業収益合計	40,387,723
営業費用	
支払手数料	15,372,436
広告宣伝費	277,284
公告費	250
調査費	
調査費	1,187,915
委託調査費	7,042,637
事務委託費	653,911
営業雑経費	
通信費	75,781
印刷費	194,857
協会費	25,068
諸会費	9,036
事務機器関連費	1,066,190
その他営業雑経費	649
営業費用合計	25,906,022
一般管理費	
給料	
役員報酬	202,454
給料・手当	2,828,313
賞与引当金繰入	924,214
役員賞与引当金繰入	65,985
福利厚生費	637,293
交際費	2,635
旅費交通費	12,678
租税公課	232,446
不動産賃借料	364,289
退職給付費用	195,737
固定資産減価償却費	※1 969,675
諸経費	193,083
一般管理費合計	6,628,807
営業利益	7,852,893

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(自 令和3年4月1日

至 令和3年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	203,195
受取利息	2,567
投資有価証券償還益	753,216
収益分配金等時効完成分	136,491
受取賃貸料	32,904
その他	4,621
営業外収益合計	1,132,996
営業外費用	
投資有価証券償還損	62
時効後支払損引当金繰入	21,921
事務過誤費	66,316
賃貸関連費用	※1 7,921
その他	7,123
営業外費用合計	103,345
経常利益	8,882,544
特別利益	
投資有価証券売却益	522,323
特別利益合計	522,323
特別損失	
投資有価証券売却損	8,073
投資有価証券評価損	36,558
固定資産除却損	7,408
特別損失合計	52,039
税引前中間純利益	9,352,828
法人税、住民税及び事業税	2,700,962
法人税等調整額	172,220
法人税等合計	2,873,183
中間純利益	6,479,644

(3)中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723
会計方針の変更 による累積的影響額							475,687	475,687	475,687
会計方針の変更を 反映した当期首残 高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当中間期変動額									
剰余金の配当							△10,576,511	△10,576,511	△10,576,511
中間純利益							6,479,644	6,479,644	6,479,644
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	—	—	—	—	—	—	△3,621,178	△3,621,178	△3,621,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	23,330,110	30,670,700	77,403,544

	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	2,301,606	2,301,606	83,326,329
会計方針の変更による累積的影響額			475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,802,017
当中間期変動額			
剰余金の配当			△10,576,511
中間純利益			6,479,644
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△449,534	△449,534	△449,534
当中間期変動額合計	△449,534	△449,534	△4,070,713
当中間期末残高	1,852,071	1,852,071	79,255,616

[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

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 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。

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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(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. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

6. 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。

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 「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31日に公布されておりますが、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。

[会計方針の変更]

(収益認識に関する会計基準等の適用)

「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。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

この結果、収益認識会計基準等の適用を行う前と比べて、当中間会計期間の中間貸借対照表は、流動負債のその他は588,191千円減少、繰延税金資産は180,104千円減少、繰越利益剰余金は408,087千円増加しております。

当中間会計期間の中間損益計算書は、委託者報酬、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ97,433千円減少しております。

当中間会計期間の期首の純資産に累積的影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は475,687千円増加しております。

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。なお、時価算定会計基準等の適用による、中間財務諸表への影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

※1 減価償却累計額

	第37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)
建物	661,109千円
器具備品	1,743,773千円
投資不動産	154,845千円

※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37期中間会計期間 (自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日)
有形固定資産	241,452千円
無形固定資産	728,222千円
投資不動産	3,012千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3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3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	10,576,511千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	49,988円
④	基準日	令和3年3月31日
⑤	効力発生日	令和3年6月29日

（リース取引関係）

第37期中間会計期間(令和3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 709,808千円

1年超	354,904千円
合 計	1,064,712千円

（金融商品関係）

第37期中間会計期間（令和3年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

令和3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、市場価格のない株式等は、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) 有価証券	1,291,000	1,291,000	—
(2) 金銭の信託	5,301,000	5,301,000	—
(3) 投資有価証券	14,912,098	14,912,098	—
資産計	21,504,098	21,504,098	—

（注1）「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注2）市場価格のない株式等

非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がないため、「(3) 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、市場価格がないため、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もあります。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

なお、中間財務諸表等規則附則（令和3年9月24日内閣府令第9号）に基づく経過措置を適用した投資信託（中間貸借対照表計上額 有価証券 1,291,000千円、投資有価証券14,912,098千円）は、次表には含めておりません。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	—	5,301,000	—	5,301,000
資産計	—	5,301,000	—	5,301,000

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

（有価証券関係）

第37期中間会計期間（令和3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、市場価格がないため、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	18,010,889	15,246,038	2,764,851
	小 計	18,010,889	15,246,038	2,764,851
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	3,493,209	3,588,600	△95,390
	小 計	3,493,209	3,588,600	△95,390
合 計		21,504,098	18,834,638	2,669,460

（注）「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」（中間貸借対照表計上額5,301,000千円、取得価額5,300,000千円）を含めております。
非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）については、市場価格がないため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について36,558千円（その他有価証券のその他36,558千円）減損処理を行っております。

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

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載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37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3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37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3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37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)
1株当たり純資産額 (算定上の基礎)	374,587.58円
純資産の部の合計額（千円）	79,255,616
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	79,255,616
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37期中間会計期間 (自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	30,624.88円
中間純利益金額（千円）	6,479,644
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）	6,479,644
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

(注1)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。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、「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）等を適用し、「収益認識に関する会計基準」第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額は2,248.25円増加し、1株当たり中間純利益金額は319.49円減少しております。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- ①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

- ①名称：三菱UFJ信託銀行株式会社
（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）
- ②資本金の額：324,279百万円（2021年9月末現在）
- ③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

①名称	②資本金の額 (2021年9月末現在)	③事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2022年2月末現在）

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

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 4月30日	有価証券届出書
2021年 4月30日	有価証券報告書
2021年11月 4日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年11月 4日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

令和3年6月28日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木裕晃印
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤鉄也印
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の令和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3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4年3月16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
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉
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」に掲げられている国内株式セクション（ラップ向け）の令和3年2月6日から令和4年2月7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、国内株式セクション（ラップ向け）の令和4年2月7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、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、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3年12月3日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木裕晃印
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤鉄也印
--------------------	-------	-------

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の令和3年4月1日から令和4年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（令和3年4月1日から令和3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3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3年4月1日から令和3年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、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。