

【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6月24日提出
【計算期間】	第8期(自 2021年3月26日至 2022年3月25日)
【ファンド名】	三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

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

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<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、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

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

ファンドの特色

投資対象

ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。

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

<ファンドが投資対象とするマザーファンドと運用目標>

各マザーファンド	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式 (国内株式を除く)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
国内債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。
ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券 (国内債券を除く)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
マネー・マーケット・マザーファンド	国内の 短期公社債等	安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

運用方法・運用プロセス

<(ご参考)組入比率変更のイメージ>



- 1 上図はファンドの組入比率の変更をご理解いただくために、組入比率の変更をイメージとして示したものです。また、各投資環境における組入比率については実際の比率と異なり、投資環境等によっては、株式の組入れを行わない場合があります。

- 各資産の組入比率は以下の範囲で決定します。

<各資産の組入比率>

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

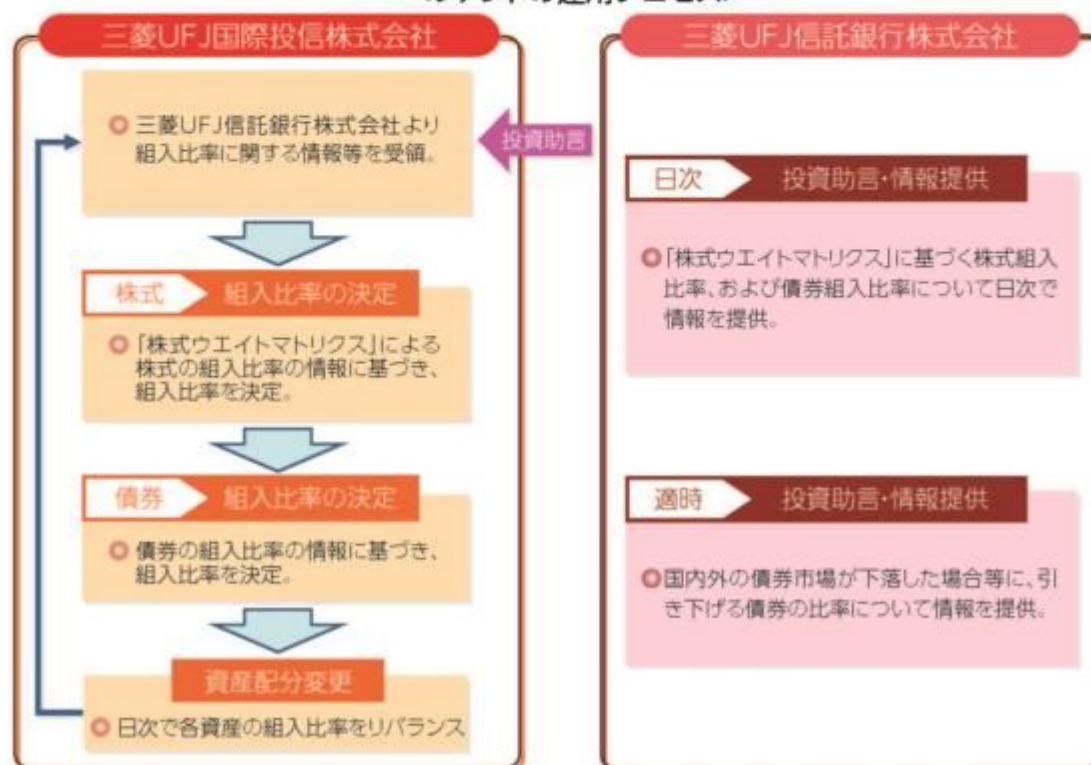
- ❗ 上記以外に短期金融資産を組み入れます。
- ❗ 上記組入比率は、今後、変更となる場合があります。

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

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

- ファンドの運用プロセスは以下のとおりです。

<ファンドの運用プロセス>



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

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

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

<株式ウェイトマトリクスのイメージ>



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

- 株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、残りは国内債券等に投資します。
- なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

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

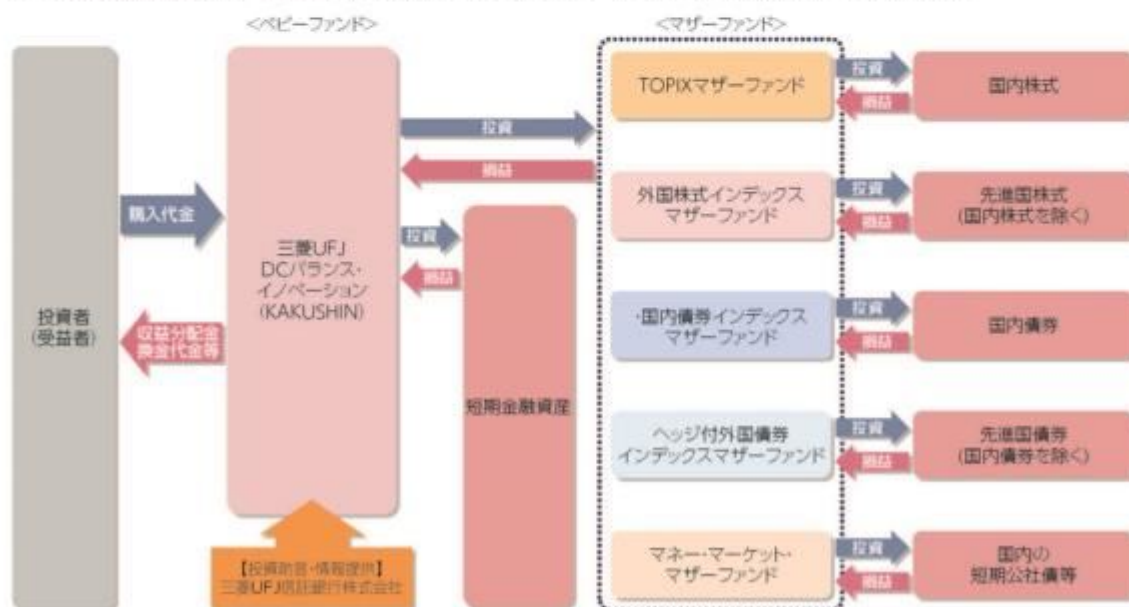
為替対応
方針

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

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

■ ファンドの仕組み

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



分配方針

年1回の決算時(3月25日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■主な投資制限

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



指数について

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、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に係る標準又は商標は、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に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

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

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

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2014年5月30日	設定日、信託契約締結、運用開始
2020年6月25日	ファンドの投資対象に「国内債券インデックスマザーファンド」を追加
2020年12月25日	ファンドの投資対象から「日本債券インデックスマザーファンド」を削除

(3) 【ファンドの仕組み】

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信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱UFJ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資↓↑損益	
マザーファンド	
投資↓↑損益	
有価証券等	

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3月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

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

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

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

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- １．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）
 - ａ．有価証券先物取引等
 - ｂ．スワップ取引
 - ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引
 - ハ．約束手形
- ニ．金銭債権
- ２．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

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、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とするTOPIXマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、国内債券インデックスマザーファンド、ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引

法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

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

③金融商品の指図範囲

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

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

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

TOPIXマザーファンド

(基本方針)

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

（運用方法）**①投資対象**

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

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

（投資制限）

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

⑤外貨建資産への投資は行いません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

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

外国株式インデックスマザーファンド**（基本方針）**

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

（運用方法）**①投資対象**

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

②投資態度

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

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

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

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

（投資制限）

①株式への投資割合に制限を設けません。

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

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

国内債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

主としてわが国の公社債に投資を行います。

公社債の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

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

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

①投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

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

マネー・マーケット・マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

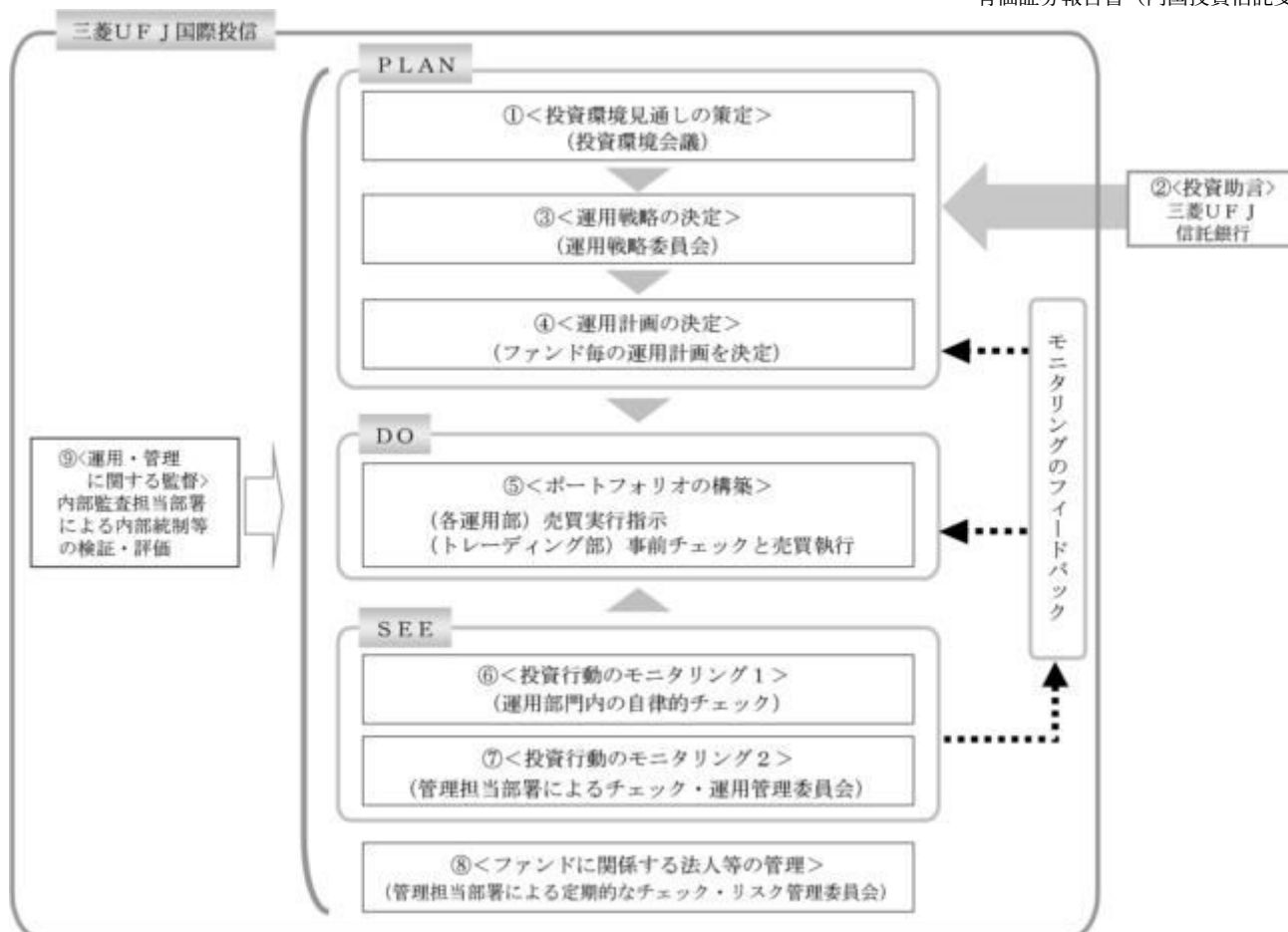
（運用方法）

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

（投資制限）

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

（3）【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②投資助言

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

③運用戦略の決定

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

④運用計画の決定

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

⑤ポートフォリオの構築

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

⑥投資行動のモニタリング1

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

⑦投資行動のモニタリング2

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

⑧ファンドに関係する法人等の管理

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

⑨運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

（５）【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①新株引受権証券および新株予約権証券

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

②投資信託証券

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

③同一銘柄の転換社債等

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

④スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「ス

ワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

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

⑤信用取引

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

⑥外国為替予約取引

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

⑦有価証券の借入れ

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

⑧資金の借入れ

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

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

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

⑨投資する株式等の範囲

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

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

⑪有価証券の貸付

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

⑫有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または⑦の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

⑬特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑭デリバティブ取引等

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

⑮信用リスクの分散規制

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

＜その他法令等に定められた投資制限＞

・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3【投資リスク】

（１）投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

①価格変動リスク

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

②為替変動リスク

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

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

その他の組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

③信用リスク

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

④流動性リスク

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

※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がある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かつた場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

（２）投資リスクに対する管理体制

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



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.66%（税抜0.6%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.4%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.17%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

◇個別元本について

- 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3月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

（1）【投資状況】

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	14,792,097,740	88.17
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,984,214,895	11.83
純資産総額		16,776,312,635	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 3月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックスマザーファンド	8,876,815,851	0.9610	8,530,937,420	0.9641	8,558,138,161	51.01
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	3,243,583,553	1.2890	4,181,153,238	1.2828	4,160,868,981	24.80
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	430,253,533	4.7146	2,028,477,124	4.8183	2,073,090,598	12.36

（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 3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	88.17
合計	88.17

（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3月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日（平成27年 3月25日）	35,553,059	35,553,059	10,752	10,752
第2計算期間末日（平成28年 3月25日）	807,612,280	807,612,280	10,742	10,742
第3計算期間末日（平成29年 3月27日）	1,403,572,405	1,403,572,405	10,697	10,697
第4計算期間末日（平成30年 3月26日）	2,639,151,920	2,639,151,920	11,120	11,120
第5計算期間末日（平成31年 3月25日）	6,301,738,329	6,301,738,329	11,294	11,294
第6計算期間末日（令和 2年 3月25日）	8,770,011,322	8,770,011,322	11,178	11,178
第7計算期間末日（令和 3年 3月25日）	12,406,605,658	12,406,605,658	11,599	11,599
第8計算期間末日（令和 4年 3月25日）	16,624,591,591	16,624,591,591	11,659	11,659
令和 3年 3月末日	12,567,506,106	—	11,655	—
4月末日	13,063,175,273	—	11,692	—
5月末日	13,433,609,869	—	11,756	—
6月末日	14,210,377,371	—	11,840	—
7月末日	14,634,956,204	—	11,885	—
8月末日	15,132,623,212	—	12,001	—
9月末日	15,371,463,253	—	11,961	—
10月末日	15,920,539,913	—	12,074	—
11月末日	16,161,768,026	—	12,018	—
12月末日	16,539,765,393	—	12,120	—
令和 4年 1月末日	16,489,141,336	—	11,812	—
2月末日	16,475,208,302	—	11,682	—
3月末日	16,776,312,635	—	11,694	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
--	------------

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

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	7.52
第2計算期間	△0.09
第3計算期間	△0.41
第4計算期間	3.95
第5計算期間	1.56
第6計算期間	△1.02
第7計算期間	3.76
第8計算期間	0.51

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	34,064,041	997,459	33,066,582
第2計算期間	897,344,061	178,600,159	751,810,484
第3計算期間	815,850,058	255,563,488	1,312,097,054
第4計算期間	1,435,863,542	374,521,457	2,373,439,139
第5計算期間	3,809,862,810	603,687,552	5,579,614,397
第6計算期間	3,243,919,150	977,723,872	7,845,809,675
第7計算期間	4,245,785,038	1,395,735,918	10,695,858,795
第8計算期間	5,189,124,868	1,626,181,686	14,258,801,977

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	1,101,919,600,160	70.22
	イギリス	64,643,809,658	4.12
	カナダ	58,345,510,946	3.72
	スイス	46,233,394,884	2.95
	フランス	46,119,233,006	2.94
	ドイツ	36,681,398,487	2.34
	オーストラリア	33,928,689,721	2.16
	オランダ	25,687,076,551	1.64
	スウェーデン	16,051,810,801	1.02
	デンマーク	11,954,033,725	0.76
	香港	11,794,043,729	0.75
	スペイン	10,530,100,573	0.67
	イタリア	7,873,576,437	0.50
	シンガポール	4,786,935,396	0.31
	フィンランド	4,270,295,490	0.27
	ベルギー	3,846,940,470	0.25
	ノルウェー	3,512,106,474	0.22
	アイルランド	2,593,664,128	0.17
	イスラエル	2,023,923,501	0.13
	ルクセンブルグ	1,337,939,386	0.09
	オーストリア	901,881,275	0.06
	ニュージーランド	895,354,575	0.06
	ポルトガル	711,022,196	0.05
	小計	1,496,642,341,569	95.37
投資証券	アメリカ	31,295,900,298	1.99
	オーストラリア	2,163,172,449	0.14
	イギリス	924,196,586	0.06
	フランス	712,528,641	0.05
	シンガポール	601,798,214	0.04
	香港	489,452,079	0.03
	カナダ	201,526,758	0.01
	小計	36,388,575,025	2.32
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	36,277,134,716	2.31
純資産総額		1,569,308,051,310	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 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	17,803,265,526	1.13
	買建	カナダ	858,913,902	0.05
	買建	ドイツ	2,973,045,923	0.19
	買建	オーストラリア	946,726,000	0.06
	買建	イギリス	3,386,123,118	0.22
	買建	スイス	672,510,610	0.04

（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 3月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,670,254	16,245.08	59,623,570,285	21,757.27	79,854,708,348	5.09
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,595,607	32,062.16	51,158,621,251	38,413.32	61,292,570,902	3.91
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	102,115	401,613.61	41,010,774,061	407,071.58	41,568,115,188	2.65
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	190,953	87,000.48	16,613,004,233	133,893.43	25,567,353,304	1.63
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	67,280	294,517.87	19,815,162,581	347,437.06	23,375,565,417	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	63,984	314,348.90	20,113,300,653	349,165.20	22,340,986,611	1.42
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	559,192	20,751.08	11,603,839,394	33,889.79	18,950,900,009	1.21
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	529,487	38,140.26	20,194,772,291	27,886.56	14,765,571,789	0.94
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	210,603	51,372.93	10,819,295,139	63,743.15	13,424,500,683	0.86
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	588,973	20,534.26	12,094,129,720	21,980.02	12,945,638,378	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	291,486	35,239.17	10,271,726,318	43,767.88	12,757,726,572	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	661,214	19,453.79	12,863,121,165	17,200.69	11,373,337,434	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	373,561	27,580.65	10,303,056,859	27,409.24	10,239,023,290	0.65

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・ パーソナル 用品	541,290	17,003.29	9,203,713,789	18,895.79	10,228,103,306	0.65
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	629,523	14,649.50	9,222,197,254	15,981.67	10,060,830,858	0.64
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	947,027	7,565.79	7,165,013,235	10,253.83	9,710,657,841	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	233,695	41,006.18	9,582,940,708	37,752.41	8,822,551,652	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	431,201	13,412.43	5,783,455,915	20,253.09	8,733,155,766	0.56
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	196,257	44,626.65	8,758,292,469	44,334.55	8,700,966,486	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,647,659	5,185.04	8,543,186,346	5,262.76	8,671,250,355	0.55
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,255,988	5,031.13	6,319,040,489	6,418.13	8,061,096,272	0.51
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	394,850	14,191.51	5,603,517,826	20,041.36	7,913,331,983	0.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	92,485	75,622.46	6,993,943,842	85,054.74	7,866,287,629	0.50
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	156,909	41,849.19	6,566,516,021	49,145.83	7,711,423,353	0.49
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	91,998	56,864.08	5,231,381,777	77,239.10	7,105,843,191	0.45
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	406,435	21,657.37	8,802,317,018	17,252.09	7,011,854,987	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	917,365	6,703.24	6,149,326,371	7,613.88	6,984,708,769	0.45
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	98,813	49,629.66	4,904,055,723	70,554.16	6,971,668,538	0.44
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	944,216	6,555.74	6,190,043,268	6,859.95	6,477,283,519	0.41
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	181,891	25,610.38	4,658,298,815	35,479.63	6,453,426,672	0.41

（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 3月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	4.38
	素材	4.31
	資本財	5.90
	商業・専門サービス	1.10
	運輸	2.01
	自動車・自動車部品	2.46

	耐久消費財・アパレル	1.65
	消費者サービス	1.72
	メディア・娯楽	6.24
	小売	5.07
	食品・生活必需品小売り	1.49
	食品・飲料・タバコ	3.76
	家庭用品・パーソナル用品	1.56
	ヘルスケア機器・サービス	4.70
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.06
	銀行	5.83
	各種金融	4.75
	保険	3.05
	不動産	0.38
	ソフトウェア・サービス	11.02
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.57
	電気通信サービス	1.48
	公益事業	2.92
	半導体・半導体製造装置	4.94
	小計	95.37
投資証券	—	2.32
合計		97.69

（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 3月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2206	買建	633	アメリカドル	140,122,379.99	17,149,578,087	145,463,400	17,803,265,526	1.13
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602206	買建	33	カナダドル	8,676,390.75	849,418,654	8,773,380	858,913,902	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2206	買建	563	ユーロ	21,157,668.2	2,892,253,243	21,748,690	2,973,045,923	0.19
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2206	買建	55	オーストラリアドル	10,007,151.25	920,657,915	10,290,500	946,726,000	0.06
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2206	買建	280	イギリスポンド	20,057,455	3,227,043,935	21,046,200	3,386,123,118	0.22

	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2206	買建	42	スイスフラン	4,978,267.7	659,819,600	5,074,020	672,510,610	0.04
--	-----	------------------	--------------	----	----	--------	-------------	-------------	-----------	-------------	------

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

国内債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	日本	190,227,262,240	82.58
地方債証券	日本	14,239,336,250	6.18
特殊債券	日本	9,738,542,462	4.23
社債券	日本	13,079,778,300	5.68
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	3,056,538,172	1.33
純資産総額		230,341,457,424	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 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	299,400,000	0.13

（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 3月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (％)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (％)
日本	国債証券	第138回利付国債（5年）	3,170,000,000	100.60	3,189,133,000	100.25	3,178,178,600	0.100000	2023/12/20	1.38
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	3,010,000,000	100.87	3,036,474,000	100.42	3,022,882,800	0.100000	2025/12/20	1.31
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	2,940,000,000	100.68	2,960,176,000	100.31	2,949,114,000	0.100000	2024/6/20	1.28

日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	2,750,000,000	100.86	2,773,650,000	100.41	2,761,440,000	0.100000	2025/9/20	1.20
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	2,740,000,000	100.72	2,759,778,000	100.40	2,750,960,000	0.100000	2025/3/20	1.19
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	2,560,000,000	100.31	2,568,171,000	99.95	2,558,848,000	0.005000	2026/9/20	1.11
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	2,450,000,000	100.86	2,471,266,500	100.09	2,452,352,000	0.100000	2028/9/20	1.06
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	2,440,000,000	101.22	2,469,938,800	100.20	2,445,075,200	0.100000	2028/3/20	1.06
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	2,400,000,000	100.52	2,412,604,500	99.55	2,389,272,000	0.100000	2030/6/20	1.04
日本	国債証券	第１５０回利付国債（５年）	2,390,000,000	100.00	2,390,116,200	99.90	2,387,729,500	0.005000	2026/12/20	1.04
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	2,360,000,000	100.93	2,381,948,000	100.30	2,367,080,000	0.100000	2027/9/20	1.03
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	2,320,000,000	100.96	2,342,272,000	99.45	2,307,379,200	0.100000	2030/9/20	1.00
日本	国債証券	第４２５回利付国債（２年）	2,280,000,000	100.20	2,284,634,400	100.08	2,281,983,600	0.005000	2023/6/1	0.99
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	2,200,000,000	101.00	2,222,000,000	100.35	2,207,766,000	0.100000	2026/12/20	0.96
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	2,120,000,000	100.82	2,137,384,000	100.41	2,128,861,600	0.100000	2025/6/20	0.92
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	2,110,000,000	101.05	2,132,162,300	100.37	2,117,996,900	0.100000	2026/9/20	0.92
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	2,110,000,000	100.47	2,120,031,000	99.25	2,094,175,000	0.100000	2031/3/20	0.91
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	2,090,000,000	100.75	2,105,863,100	100.00	2,090,000,000	0.100000	2029/3/20	0.91
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	2,070,000,000	101.30	2,096,910,000	100.15	2,073,187,800	0.100000	2028/6/20	0.90
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	2,080,000,000	99.19	2,063,212,200	98.95	2,058,201,600	0.100000	2031/12/20	0.89
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	2,050,000,000	100.62	2,062,748,000	100.33	2,056,826,500	0.100000	2024/9/20	0.89
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	2,060,000,000	100.35	2,067,255,700	99.02	2,039,894,400	0.100000	2031/9/20	0.89
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	2,023,000,000	100.68	2,036,858,600	100.36	2,030,424,410	0.100000	2024/12/20	0.88
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	2,010,000,000	100.61	2,022,388,800	99.35	1,997,035,500	0.100000	2030/12/20	0.87
日本	国債証券	第４３１回利付国債（２年）	1,950,000,000	100.16	1,953,138,500	100.10	1,951,950,000	0.005000	2023/12/1	0.85
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	1,940,000,000	100.94	1,958,425,500	99.64	1,933,113,000	0.100000	2030/3/20	0.84
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	1,890,000,000	100.40	1,897,570,200	99.13	1,873,727,100	0.100000	2031/6/20	0.81
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	1,840,000,000	100.98	1,858,149,100	100.40	1,847,360,000	0.100000	2026/6/20	0.80
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	1,840,000,000	100.76	1,854,016,600	99.73	1,835,068,800	0.100000	2029/12/20	0.80
日本	国債証券	第１４７回利付国債（５年）	1,830,000,000	100.34	1,836,342,800	100.03	1,830,713,700	0.005000	2026/3/20	0.79

（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 3月31日現在

種類	投資比率（％）
----	---------

国債証券	82.58
地方債証券	6.18
特殊債券	4.23
社債券	5.68
合計	98.67

（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 3月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物 2 2 年 0 6 月限	買建	2	円	301,422,200	299,400,000	0.13

（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。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	147,832,889,009	50.39
	フランス	28,902,609,064	9.85
	イタリア	27,024,352,905	9.21
	ドイツ	20,728,135,157	7.06
	スペイン	17,415,516,659	5.94
	イギリス	16,564,454,040	5.65
	ベルギー	6,660,927,744	2.27
	カナダ	6,417,144,281	2.19
	オランダ	5,695,760,953	1.94
	オーストラリア	5,025,160,308	1.71
	オーストリア	4,255,246,407	1.45
	中国	3,532,238,854	1.20
	アイルランド	2,420,923,939	0.83
	メキシコ	2,350,970,708	0.80
	フィンランド	1,770,733,375	0.60
	マレーシア	1,696,381,923	0.58
	イスラエル	1,406,330,470	0.48

	ポーランド	1,387,212,160	0.47
	デンマーク	1,327,588,210	0.45
	シンガポール	1,308,444,372	0.45
	スウェーデン	936,998,973	0.32
	ノルウェー	816,096,712	0.28
	小計	305,476,116,223	104.12
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	△12,074,045,995	△4.12
純資産総額		293,402,070,228	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 3月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	13,650,000	12,998.20	1,774,254,364	12,429.75	1,696,661,733	2.750000	2028/2/15	0.58
フランス	国債証券	2.25 O.A.T 240525	11,700,000	14,576.61	1,705,464,094	14,286.88	1,671,565,673	2.250000	2024/5/25	0.57
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 240915	14,100,000	11,980.75	1,689,286,751	11,649.04	1,642,514,914	0.375000	2024/9/15	0.56
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	12,100,000	13,104.33	1,585,624,601	12,516.76	1,514,528,918	2.875000	2028/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 271231	13,680,000	11,522.82	1,576,322,770	11,030.87	1,509,023,949	0.625000	2027/12/31	0.51
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280630	13,200,000	11,898.75	1,570,635,766	11,376.53	1,501,702,352	1.250000	2028/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	13,490,000	11,594.54	1,564,103,466	11,048.56	1,490,451,554	1.125000	2031/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	12,730,000	12,095.57	1,539,766,597	11,506.57	1,464,786,658	1.625000	2031/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	12,150,000	12,489.99	1,517,534,405	12,008.56	1,459,040,353	2.000000	2025/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280331	12,590,000	11,922.50	1,501,043,643	11,411.43	1,436,699,442	1.250000	2028/3/31	0.49
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	13,150,000	11,365.53	1,494,568,113	10,833.42	1,424,595,695	0.875000	2030/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	12,900,000	11,149.72	1,438,315,041	10,633.58	1,371,732,777	0.625000	2030/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 240531	11,260,000	12,490.95	1,406,481,115	12,134.77	1,366,375,920	2.000000	2024/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	10,850,000	13,123.45	1,423,895,298	12,533.50	1,359,884,851	2.875000	2028/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	0.375 T-NOTE 240415	11,500,000	12,050.63	1,385,822,926	11,756.13	1,351,955,318	0.375000	2024/4/15	0.46
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	8,750,000	16,423.71	1,437,074,812	15,431.24	1,350,233,745	2.500000	2030/5/25	0.46
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	12,060,000	11,469.87	1,383,267,439	11,098.28	1,338,453,406	1.250000	2031/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 261115	11,100,000	12,492.86	1,386,707,861	11,966.49	1,328,280,502	2.000000	2026/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 240229	10,400,000	12,578.44	1,308,157,865	12,251.43	1,274,148,744	2.375000	2024/2/29	0.43

アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	10,000,000	13,351.02	1,335,102,789	12,738.12	1,273,812,172	3.125000	2028/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 260731	11,200,000	11,750.66	1,316,074,357	11,301.95	1,265,818,575	0.625000	2026/7/31	0.43
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240515	10,200,000	12,627.68	1,288,023,754	12,265.77	1,251,108,827	2.500000	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 260630	10,900,000	11,896.69	1,296,739,261	11,440.59	1,247,025,017	0.875000	2026/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	11,030,000	11,762.39	1,297,392,360	11,200.59	1,235,425,884	1.375000	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 271115	9,900,000	12,636.76	1,251,039,982	12,124.25	1,200,301,678	2.250000	2027/11/15	0.41
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	8,360,000	15,317.26	1,280,523,027	14,315.78	1,196,799,581	1.500000	2031/5/25	0.41
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 270515	9,800,000	12,717.54	1,246,319,400	12,199.79	1,195,580,101	2.375000	2027/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	0.125 T-NOTE 230731	10,000,000	11,926.53	1,192,653,833	11,930.15	1,193,015,648	0.125000	2023/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 240630	9,850,000	12,419.23	1,223,294,981	12,065.93	1,188,494,389	1.750000	2024/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	0.75 T-NOTE 260531	10,400,000	11,844.10	1,231,786,505	11,394.70	1,185,048,824	0.750000	2026/5/31	0.40

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	104.12
合計	104.12

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

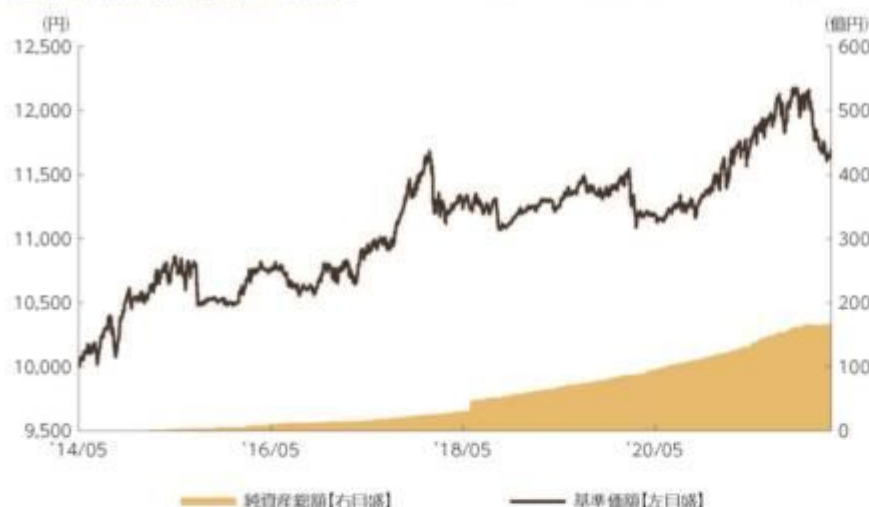
《参考情報》



運用実績

2022年3月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2014年5月30日(設定日)～2022年3月31日



■基準価額・純資産

基準価額	11,694円
純資産総額	167.7億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2022年 3月	0円
2021年 3月	0円
2020年 3月	0円
2019年 3月	0円
2018年 3月	0円
2017年 3月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率
国内債券	50.3%
外国株式	12.1%
外国債券	25.8%
コールローン他 (負債控除後)	11.8%
合計	100.0%

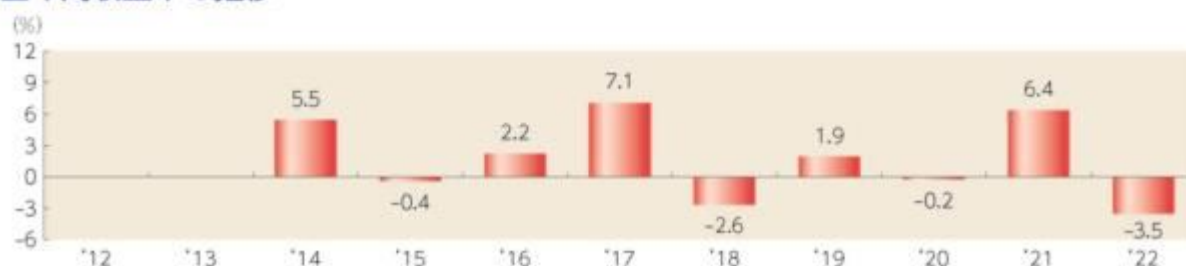
組入上位通貨	比率
1 円	88.5%
2 アメリカドル	8.7%
3 ユーロ	0.8%
4 イギリスポンド	0.5%
5 カナダドル	0.4%
6 スイスフラン	0.4%
7 オーストラリアドル	0.3%
8 スウェーデンクローネ	0.1%
9 香港ドル	0.1%
10 デンマーククローネ	0.1%

組入上位銘柄	種類	業種/種別	比率
APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.6%
MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	0.5%
AMAZON.COM INC	株式	小売	0.3%
TESLA INC	株式	自動車・自動車部品	0.2%
ALPHABET INC-CL A	株式	メディア・娯楽	0.2%
第138回利付国債(5年)	債券	国債	0.7%
第146回利付国債(5年)	債券	国債	0.7%
第140回利付国債(5年)	債券	国債	0.7%
第145回利付国債(5年)	債券	国債	0.6%
第143回利付国債(5年)	債券	国債	0.6%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	0.2%
債券先物取引 (買建)	0.1%

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

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2014年は設定日から年末までの、2022年は年初から3月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

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

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があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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

②解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

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

⑧解約請求受付時間

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

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

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】

無期限（2014年5月30日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年３月26日から翌年３月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

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發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議につ

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

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

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤関係法人との契約の更改

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

⑥運用報告書

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

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨信託事務の再信託

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

⑩公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

収益分配金は、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額

再投資されます。（税金が差引かれる場合があります。）

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に应じて受領する権利を有します。

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

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

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（令和3年3月26日から令和4年3月25日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 [令和 3年 3月25日現在]	第8期 [令和 4年 3月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	305,970,637	2,149,019,123
親投資信託受益証券	12,065,114,759	14,551,759,443
未収入金	111,000,000	-
流動資産合計	12,482,085,396	16,700,778,566
資産合計	12,482,085,396	16,700,778,566
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,473,706	22,747,533
未払受託者報酬	1,888,973	2,656,038
未払委託者報酬	35,890,392	50,464,612
未払利息	53	133
その他未払費用	226,614	318,659
流動負債合計	75,479,738	76,186,975
負債合計	75,479,738	76,186,975
純資産の部		
元本等		
元本	10,695,858,795	14,258,801,977
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,710,746,863	2,365,789,614
（分配準備積立金）	379,077,753	440,750,422
元本等合計	12,406,605,658	16,624,591,591
純資産合計	12,406,605,658	16,624,591,591
負債純資産合計	12,482,085,396	16,700,778,566

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 令和2年3月26日 至 令和3年3月25日	第8期 自 令和3年3月26日 至 令和4年3月25日
営業収益		
受取利息	10,723	1,905
有価証券売買等損益	494,418,261	83,524,886
営業収益合計	494,428,984	83,526,791
営業費用		
支払利息	343,913	92,938
受託者報酬	3,516,783	4,976,242
委託者報酬	66,818,768	94,548,426
その他費用	421,894	597,020
営業費用合計	71,101,358	100,214,626
営業利益又は営業損失（△）	423,327,626	△16,687,835
経常利益又は経常損失（△）	423,327,626	△16,687,835
当期純利益又は当期純損失（△）	423,327,626	△16,687,835
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（△）	19,044,128	36,846,238
期首剰余金又は期首欠損金（△）	924,201,647	1,710,746,863
剰余金増加額又は欠損金減少額	548,404,876	976,972,671
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	548,404,876	976,972,671
剰余金減少額又は欠損金増加額	166,143,158	268,395,847
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	166,143,158	268,395,847
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,710,746,863	2,365,789,614

(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。
--------------------	---

(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7期 [令和 3年 3月25日現在]	第8期 [令和 4年 3月25日現在]
1. 期首元本額	7,845,809,675円	10,695,858,795円
期中追加設定元本額	4,245,785,038円	5,189,124,868円
期中一部解約元本額	1,395,735,918円	1,626,181,686円
2. 受益権の総数	10,695,858,795口	14,258,801,977口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 令和 2年 3月26日 至 令和 3年 3月25日	第8期 自 令和 3年 3月26日 至 令和 4年 3月25日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>106,003,628円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>168,993,272円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,331,669,110円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>104,080,853円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>1,710,746,863円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>10,695,858,795口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,599円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>－円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	106,003,628円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	168,993,272円	収益調整金額	C	1,331,669,110円	分配準備積立金額	D	104,080,853円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,710,746,863円	当ファンドの期末残存口数	F	10,695,858,795口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,599円	1万口当たり分配金額	H	－円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	－円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>107,623,039円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,925,039,192円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>333,127,383円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>2,365,789,614円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>14,258,801,977口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>1,659円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>－円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>－円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	107,623,039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	1,925,039,192円	分配準備積立金額	D	333,127,383円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,365,789,614円	当ファンドの期末残存口数	F	14,258,801,977口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,659円	1万口当たり分配金額	H	－円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	－円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	106,003,628円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	168,993,272円																																																											
収益調整金額	C	1,331,669,110円																																																											
分配準備積立金額	D	104,080,853円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,710,746,863円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,695,858,795口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,599円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	－円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	107,623,039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	1,925,039,192円																																																											
分配準備積立金額	D	333,127,383円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,365,789,614円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	14,258,801,977口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,659円																																																											
1万口当たり分配金額	H	－円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	－円																																																											

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自 令和 2年 3月26日 至 令和 3年 3月25日	第8期 自 令和 3年 3月26日 至 令和 4年 3月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	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7期 [令和 3年 3月25日現在]	第8期 [令和 4年 3月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

区分	第7期 [令和 3年 3月25日現在]	第8期 [令和 4年 3月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第7期 [令和 3年 3月25日現在]	第8期 [令和 4年 3月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	278,994,843	△259,746,542
合計	278,994,843	△259,746,542

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第7期 [令和 3年 3月25日現在]	第8期 [令和 4年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.1599円	1.1659円
(1万口当たり純資産額)	(11,599円)	(11,659円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	3,181,937,045	4,102,153,238	
	国内債券インデックスマザーファンド	8,747,203,642	8,406,937,420	
	外国株式インデックスマザーファンド	433,411,582	2,042,668,785	
合 計		12,362,552,269	14,551,759,443	

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。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 4年 3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	57,132,078,526
コール・ローン	7,589,267,995
株式	1,465,188,373,986
投資証券	34,672,689,266
派生商品評価勘定	1,230,608,771
未収入金	16,813,625
未収配当金	2,241,836,924
差入委託証拠金	11,310,986,806
流動資産合計	1,579,382,655,899
資産合計	1,579,382,655,899
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,537,163
未払金	49,167,856,936
未払解約金	2,916,727,808
未払利息	471

[令和 4年 3月25日現在]

流動負債合計	52,093,122,378
負債合計	52,093,122,378
純資産の部	
元本等	
元本	324,060,471,685
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,203,229,061,836
元本等合計	1,527,289,533,521
純資産合計	1,527,289,533,521
負債純資産合計	1,579,382,655,899

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。 為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（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 3月25日現在]
1. 期首	令和 3年 3月26日
期首元本額	239,184,802,487円
期中追加設定元本額	195,588,593,416円
期中一部解約元本額	110,712,924,218円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）	231,243,114円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）	978,519,412円
三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）	849,544,624円
MAXIS 海外株式（MSCI コクサイ）上場投信	3,101,889,980円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	2,484,329,208円
三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	1,771,993,691円
三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	9,758,019,598円

	[令和 4年 3月25日現在]
三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	9,786,127,735円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	58,972,951円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	140,639,653円
ファンド・マネジャー（海外株式）	17,703,570円
eMAXIS 先進国株式インデックス	12,678,798,866円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,091,807,383円
eMAXIS バランス（波乗り型）	72,882,072円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	1,587,463,997円
コアバランス	203,390円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	112,432,964円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	149,353,299円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	112,389,631円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	68,348,281,162円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,445,222,360円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	3,823,794,717円
つみたて先進国株式	13,780,482,591円
つみたて8資産均等バランス	1,715,784,841円
つみたて4資産均等バランス	516,402,278円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,354,938円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,473,061円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	3,220,565円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	100,976,104円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	84,819,223円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	47,740,821円
三菱UFJ DC年金バランス（株式15）	38,510,958円
三菱UFJ DC年金バランス（株式40）	261,355,444円
三菱UFJ DC年金バランス（株式65）	510,640,572円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	24,642,900,548円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	362,412,486円
三菱UFJ DC年金インデックス（先進国株式）	1,459,724,496円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	85,169,355,223円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	54,052,944円
三菱UFJ DC年金バランス（株式25）	28,800,291円
先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）	111,458,601円
つみたて全世界株式	63,301,525円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）	15,096,430円

	[令和 4年 3月25日現在]
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,735,647,635円
三菱UFJ DC年金バランス（株式80）	1,215,246円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	24,400,805,441円
eMAXIS 全世界株式インデックス	3,560,758,287円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	568,656,835円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	593,882,037円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	433,411,582円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	56,546,016円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	267,199,014円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	81,027,498円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	97,371,243円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	336,350,182円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	265,852,263円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	517,859,993円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,993,839,256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）	15,679円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	13,198,141円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,057,305,279円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	68,379,385円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	933,950,195円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	12,243,780,993円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	655,892円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	735,210,467円
MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	6,396,588,554円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	11,704,316円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	69,646,772円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,426,088,420円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	519,617,157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）	460,879,156円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	53,675,029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）	14,790,506円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	2,110,709,391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）	431,614,958円

	[令和 4年 3月25日現在]
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	29,414,367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）	22,733円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,338,943,567円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	877,677円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	2,968,006円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	1,506,583円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	2,268,487円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	32,658,302円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	1,734,263円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	17,465,782円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	1,703,621円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	22,046,124円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,183,132,275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）	104,294,833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）	427,121,181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）	441,249,240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）	422,354,509円
合計	324,060,471,685円
2. 受益権の総数	324,060,471,685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 3月26日 至 令和 4年 3月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 3年 3月26日 至 令和 4年 3月25日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに依拠して、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 3月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 3月25日現在]
--	-----------------

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	60,669,511,171
投資証券	2,093,194,003
合計	62,762,705,174

(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 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	26,547,895,677	—	27,730,713,651	1,182,817,974
合計		26,547,895,677	—	27,730,713,651	1,182,817,974

（注）時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[令和 4年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	3,507,030,047	—	3,535,192,711	28,162,664
	カナダドル	177,026,051	—	178,843,281	1,817,230
	オーストラリアドル	398,064,570	—	399,136,490	1,071,920
	イギリスポンド	220,923,186	—	222,562,594	1,639,408
	スイスフラン	131,569,512	—	133,115,241	1,545,729
	香港ドル	44,427,026	—	44,769,130	342,104
	シンガポールドル	17,482,416	—	17,630,454	148,038
	ニュージーランドドル	4,414,924	—	4,414,919	△5
	スウェーデンクローネ	50,778,840	—	51,492,360	713,520

	ノルウェークローネ	12,115,891	—	12,219,790	103,899
	デンマーククローネ	24,053,667	—	24,254,580	200,913
	イスラエルシェケル	4,059,590	—	4,059,665	75
	ユーロ	399,287,131	—	402,795,690	3,508,559
	売建				
	カナダドル	29,190,570	—	29,190,300	270
	イギリスポンド	48,276,270	—	48,276,960	△690
	合計	5,068,699,691	—	5,107,954,165	39,253,634

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和 4年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	4.7130円
(1万口当たり純資産額)	(47,130円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	180,781	38.29	6,922,104.49	
	CHENIERE ENERGY INC	54,373	141.57	7,697,585.61	

CHEVRON CORP	431,201	166.30	71,708,726.30
CONOCOPHILLIPS	294,684	104.54	30,806,265.36
COTERRA ENERGY INC	172,895	27.03	4,673,351.85
DEVON ENERGY CORP	144,292	61.54	8,879,729.68
DIAMONDBACK ENERGY INC	37,921	143.19	5,429,907.99
EOG RESOURCES INC	130,814	121.01	15,829,802.14
EXXON MOBIL CORP	947,027	83.38	78,963,111.26
HALLIBURTON CO	195,652	37.68	7,372,167.36
HESS CORP	63,185	106.51	6,729,834.35
KINDER MORGAN INC	456,783	18.30	8,359,128.90
MARATHON PETROLEUM CORP	137,478	81.39	11,189,334.42
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	208,989	57.75	12,069,114.75
ONEOK INC	100,429	70.43	7,073,214.47
PHILLIPS 66	108,175	81.12	8,775,156.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	52,300	251.26	13,140,898.00
SCHLUMBERGER LTD	315,231	42.64	13,441,449.84
VALERO ENERGY CORP	91,539	96.44	8,828,021.16
WILLIAMS COS INC	270,950	32.93	8,922,383.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	49,594	242.41	12,022,081.54
ALBEMARLE CORP	26,609	214.15	5,698,317.35
AMCOR PLC	340,666	11.28	3,842,712.48
AVERY DENNISON CORP	18,276	166.82	3,048,802.32
BALL CORP	73,941	92.95	6,872,815.95
CELANESE CORP	25,081	143.86	3,608,152.66
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	47,871	106.40	5,093,474.40
CORTEVA INC	163,303	58.49	9,551,592.47
CROWN HOLDINGS INC	28,722	128.48	3,690,202.56
DOW INC	165,351	64.09	10,597,345.59
DUPONT DE NEMOURS INC	116,336	76.30	8,876,436.80
EASTMAN CHEMICAL CO	31,050	110.64	3,435,372.00
ECOLAB INC	57,835	176.26	10,193,997.10
FMC CORP	29,295	133.85	3,921,135.75
FREEPORT-MCMORAN INC	326,887	51.45	16,818,336.15
INTERNATIONAL PAPER CO	81,353	45.24	3,680,409.72
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	57,876	127.98	7,406,970.48
LINDE PLC	114,594	318.04	36,445,475.76
LYONDELLBASELL INDU-CL A	60,636	107.14	6,496,541.04
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13,462	383.90	5,168,061.80
MOSAIC CO/THE	82,448	68.57	5,653,459.36
NEWMONT CORP	178,620	78.23	13,973,442.60
NUCOR CORP	64,254	153.52	9,864,274.08
PACKAGING CORP OF AMERICA	21,722	152.96	3,322,597.12

PPG INDUSTRIES INC	52,359	129.51	6,781,014.09
RPM INTERNATIONAL INC	27,392	79.88	2,188,072.96
SEALED AIR CORP	35,102	67.22	2,359,556.44
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	55,693	249.93	13,919,351.49
STEEL DYNAMICS INC	42,749	88.66	3,790,126.34
VULCAN MATERIALS CO	30,610	180.84	5,535,512.40
WESTROCK CO	61,030	47.12	2,875,733.60
3M CO	129,193	148.98	19,247,173.14
AERCAP HOLDINGS NV	29,314	54.52	1,598,199.28
ALLEGION PLC	19,271	112.59	2,169,721.89
AMETEK INC	52,059	132.50	6,897,817.50
BOEING CO/THE	124,989	189.05	23,629,170.45
CARRIER GLOBAL CORP	181,264	46.17	8,368,958.88
CATERPILLAR INC	120,978	222.21	26,882,521.38
CUMMINS INC	32,714	209.24	6,845,077.36
DEERE & CO	65,829	432.22	28,452,610.38
DOVER CORP	31,093	157.23	4,888,752.39
EATON CORP PLC	88,787	153.20	13,602,168.40
EMERSON ELECTRIC CO	133,426	97.77	13,045,060.02
FASTENAL CO	128,773	57.35	7,385,131.55
FORTIVE CORP	74,529	61.32	4,570,118.28
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	31,825	77.57	2,468,665.25
GENERAC HOLDINGS INC	14,613	323.42	4,726,136.46
GENERAL DYNAMICS CORP	53,115	241.00	12,800,715.00
GENERAL ELECTRIC CO	245,731	94.12	23,128,201.72
HEICO CORP	9,664	155.09	1,498,789.76
HEICO CORP-CLASS A	16,453	127.13	2,091,669.89
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	153,994	194.69	29,981,091.86
HOWMET AEROSPACE INC	90,824	37.02	3,362,304.48
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	9,743	203.59	1,983,577.37
IDEX CORP	16,904	194.21	3,282,925.84
ILLINOIS TOOL WORKS	70,074	210.69	14,763,891.06
INGERSOLL-RAND INC	88,255	49.39	4,358,914.45
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	45,200	57.83	2,613,916.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	157,819	65.58	10,349,770.02
KORNIT DIGITAL LTD	10,100	80.84	816,484.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	44,013	256.88	11,306,059.44
LENNOX INTERNATIONAL INC	7,651	261.39	1,999,894.89
LOCKHEED MARTIN CORP	55,575	449.73	24,993,744.75
MASCO CORP	53,525	52.92	2,832,543.00
NORDSON CORP	11,415	227.09	2,592,232.35
NORTHROP GRUMMAN CORP	33,747	454.57	15,340,373.79

OTIS WORLDWIDE CORP	91,010	77.42	7,045,994.20
OWENS CORNING	21,476	92.82	1,993,402.32
PACCAR INC	78,315	88.95	6,966,119.25
PARKER HANNIFIN CORP	28,299	289.14	8,182,372.86
PENTAIR PLC	36,371	55.43	2,016,044.53
PLUG POWER INC	122,839	28.46	3,495,997.94
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	334,919	101.71	34,064,611.49
ROCKWELL AUTOMATION INC	25,617	275.00	7,044,675.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	23,652	461.45	10,914,215.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	37,891	51.10	1,936,230.10
SMITH (A.O.) CORP	27,826	66.23	1,842,915.98
SNAP-ON INC	12,812	206.91	2,650,930.92
STANLEY BLACK & DECKER INC	36,786	138.74	5,103,689.64
SUNRUN INC	36,416	32.28	1,175,508.48
TEXTRON INC	50,012	74.66	3,733,895.92
TRANE TECHNOLOGIES PLC	52,665	154.73	8,148,855.45
TRANSDIGM GROUP INC	11,720	675.70	7,919,204.00
UNITED RENTALS INC	16,607	358.98	5,961,580.86
WABTEC CORP	40,506	96.95	3,927,056.70
WW GRAINGER INC	9,658	501.24	4,840,975.92
XYLEM INC	38,994	86.34	3,366,741.96
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	28,957	87.14	2,523,312.98
CINTAS CORP	20,747	410.41	8,514,776.27
CLARIVATE PLC	69,180	16.34	1,130,401.20
COPART INC	47,935	126.64	6,070,488.40
COSTAR GROUP INC	88,193	67.44	5,947,735.92
EQUIFAX INC	27,284	236.53	6,453,484.52
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	28,649	138.62	3,971,324.38
LEIDOS HOLDINGS INC	31,306	107.54	3,366,647.24
REPUBLIC SERVICES INC	50,347	130.19	6,554,675.93
ROBERT HALF INTL INC	23,871	117.12	2,795,771.52
ROLLINS INC	45,331	33.54	1,520,401.74
TRANSUNION	41,415	102.22	4,233,441.30
VERISK ANALYTICS INC	34,394	208.24	7,162,206.56
WASTE CONNECTIONS INC	58,070	133.75	7,766,862.50
WASTE MANAGEMENT INC	93,427	155.04	14,484,922.08
AMERCO	2,336	620.07	1,448,483.52
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	28,525	106.37	3,034,204.25
CSX CORP	496,294	36.68	18,204,063.92
DELTA AIR LINES INC	32,953	37.26	1,227,828.78
EXPEDITORS INTL WASH INC	36,865	103.87	3,829,167.55
FEDEX CORP	56,527	225.12	12,725,358.24

GRAB HOLDINGS LTD - CL A	237,326	3.63	861,493.38
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	18,882	208.44	3,935,764.08
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	34,149	53.44	1,824,922.56
LYFT INC-A	56,676	38.98	2,209,230.48
NORFOLK SOUTHERN CORP	54,463	279.55	15,225,131.65
OLD DOMINION FREIGHT LINE	22,069	316.67	6,988,590.23
SOUTHWEST AIRLINES CO	38,892	43.92	1,708,136.64
UBER TECHNOLOGIES INC	326,903	34.70	11,343,534.10
UNION PACIFIC CORP	143,797	270.21	38,855,387.37
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	163,145	214.66	35,020,705.70
APTIV PLC	62,001	118.78	7,364,478.78
BORGWARNER INC	54,492	38.52	2,099,031.84
FORD MOTOR CO	877,243	16.83	14,763,999.69
GENERAL MOTORS CO	291,933	44.35	12,947,228.55
LEAR CORP	13,406	142.76	1,913,840.56
LUCID GROUP INC	88,200	26.25	2,315,250.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	36,700	48.66	1,785,822.00
TESLA INC	190,953	1,013.92	193,611,065.76
DR HORTON INC	76,977	78.83	6,068,096.91
GARMIN LTD	33,034	116.82	3,859,031.88
HASBRO INC	30,940	85.50	2,645,370.00
LENNAR CORP-A	58,960	83.88	4,945,564.80
LULULEMON ATHLETICA INC	26,994	317.74	8,577,073.56
MOHAWK INDUSTRIES INC	12,415	135.03	1,676,397.45
NEWELL BRANDS INC	80,494	21.88	1,761,208.72
NIKE INC -CL B	285,900	132.08	37,761,672.00
NVR INC	770	4,739.65	3,649,530.50
PELOTON INTERACTIVE INC-A	64,154	28.94	1,856,616.76
PULTEGROUP INC	52,983	44.57	2,361,452.31
VF CORP	78,227	56.24	4,399,486.48
WHIRLPOOL CORP	12,591	182.79	2,301,508.89
AIRBNB INC-CLASS A	66,186	170.83	11,306,554.38
ARAMARK	50,112	37.31	1,869,678.72
BOOKING HOLDINGS INC	9,210	2,261.99	20,832,927.90
CAESARS ENTERTAINMENT INC	49,601	78.99	3,917,982.99
CARNIVAL CORP	180,675	18.49	3,340,680.75
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6,342	1,565.94	9,931,191.48
DARDEN RESTAURANTS INC	29,784	132.40	3,943,401.60
DOMINO'S PIZZA INC	7,833	393.20	3,079,935.60
DRAFTKINGS INC - CL A	74,903	19.05	1,426,902.15
EXPEDIA GROUP INC	32,904	195.02	6,416,938.08
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	60,946	151.89	9,257,087.94

LAS VEGAS SANDS CORP	80,504	39.73	3,198,423.92
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	62,591	171.98	10,764,400.18
MCDONALD'S CORP	167,380	240.26	40,214,718.80
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	64,728	8.56	554,071.68
MGM RESORTS INTERNATIONAL	80,927	42.16	3,411,882.32
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	49,972	76.87	3,841,347.64
STARBUCKS CORP	263,038	87.12	22,915,870.56
VAIL RESORTS INC	9,387	258.62	2,427,665.94
WYNN RESORTS LTD	22,287	81.37	1,813,493.19
YUM! BRANDS INC	65,987	119.70	7,898,643.90
ACTIVISION BLIZZARD INC	174,313	79.62	13,878,801.06
ALPHABET INC-CL A	67,280	2,831.44	190,499,283.20
ALPHABET INC-CL C	63,984	2,826.24	180,834,140.16
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	108,848	20.23	2,201,995.04
CABLE ONE INC	1,113	1,472.04	1,638,380.52
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	27,977	559.32	15,648,095.64
COMCAST CORP-CLASS A	1,018,491	46.80	47,665,378.80
DISCOVERY INC - A	38,600	27.12	1,046,832.00
DISCOVERY INC-C	71,230	27.11	1,931,045.30
DISH NETWORK CORP-A	57,866	30.90	1,788,059.40
ELECTRONIC ARTS INC	63,700	125.57	7,998,809.00
FOX CORP - CLASS A	71,097	40.91	2,908,578.27
FOX CORP - CLASS B	35,796	37.57	1,344,855.72
IAC/INTERACTIVECORP	17,666	100.34	1,772,606.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	91,882	35.97	3,304,995.54
LIBERTY BROADBAND-A	7,231	134.77	974,521.87
LIBERTY BROADBAND-C	30,180	138.72	4,186,569.60
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	13,542	46.28	626,723.76
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	41,179	46.38	1,909,882.02
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	45,962	65.97	3,032,113.14
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	37,177	117.88	4,382,424.76
MATCH GROUP INC	60,868	107.06	6,516,528.08
META PLATFORMS INC-CLASS A	529,487	219.57	116,259,460.59
NETFLIX INC	99,072	375.71	37,222,341.12
NEWS CORP - CLASS A	87,126	22.55	1,964,691.30
OMNICOM GROUP	47,342	83.99	3,976,254.58
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	140,443	37.89	5,321,385.27
PINTEREST INC- CLASS A	127,988	26.34	3,371,203.92
ROKU INC	27,205	127.33	3,464,012.65
SEA LTD-ADR	72,486	123.32	8,938,973.52
SIRIUS XM HOLDINGS INC	228,939	6.50	1,488,103.50
SNAP INC - A	242,869	37.05	8,998,296.45

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	25,440	150.50	3,828,720.00
TWITTER INC	175,521	38.82	6,813,725.22
WALT DISNEY CO/THE	406,435	138.96	56,478,207.60
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	61,345	59.35	3,640,825.75
ADVANCE AUTO PARTS INC	14,047	214.67	3,015,469.49
AMAZON.COM INC	102,115	3,272.99	334,221,373.85
AUTOZONE INC	4,775	2,013.61	9,614,987.75
BATH & BODY WORKS INC	58,134	49.78	2,893,910.52
BEST BUY CO INC	48,336	96.71	4,674,574.56
BURLINGTON STORES INC	14,765	183.70	2,712,330.50
CARMAX INC	35,367	99.28	3,511,235.76
CARVANA CO	16,031	148.65	2,383,008.15
CHEWY INC - CLASS A	20,927	45.90	960,549.30
DOLLAR GENERAL CORP	52,277	220.90	11,547,989.30
DOLLAR TREE INC	50,368	156.85	7,900,220.80
DOORDASH INC - A	23,386	114.88	2,686,583.68
EBAY INC	141,751	57.23	8,112,409.73
ETSY INC	29,639	140.96	4,177,913.44
FIVERR INTERNATIONAL LTD	6,400	75.91	485,824.00
GENUINE PARTS CO	31,772	128.09	4,069,675.48
HOME DEPOT INC	233,695	315.78	73,796,207.10
LKQ CORP	65,826	45.40	2,988,500.40
LOWE'S COS INC	150,732	219.17	33,035,932.44
MERCADOLIBRE INC	10,167	1,236.44	12,570,885.48
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	15,237	700.24	10,669,556.88
POOL CORP	8,689	450.52	3,914,568.28
ROSS STORES INC	80,041	90.42	7,237,307.22
TARGET CORP	107,218	217.04	23,270,594.72
TJX COMPANIES INC	269,393	60.07	16,182,437.51
TRACTOR SUPPLY COMPANY	24,851	233.33	5,798,483.83
ULTA BEAUTY INC	11,314	395.84	4,478,533.76
WAYFAIR INC- CLASS A	16,269	121.37	1,974,568.53
COSTCO WHOLESALE CORP	98,813	558.11	55,148,523.43
KROGER CO	159,320	56.75	9,041,410.00
SYSCO CORP	116,834	81.53	9,525,476.02
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	165,394	47.02	7,776,825.88
WALMART INC	343,375	142.83	49,044,251.25
ALTRIA GROUP INC	410,992	52.50	21,577,080.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	123,240	90.43	11,144,593.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	68,030	66.43	4,519,232.90
BUNGE LTD	32,105	113.99	3,659,648.95
CAMPBELL SOUP CO	44,201	43.32	1,914,787.32

COCA-COLA CO/THE	917,365	60.98	55,940,917.70
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	43,572	48.55	2,115,420.60
CONAGRA BRANDS INC	107,877	32.28	3,482,269.56
CONSTELLATION BRANDS INC-A	37,485	226.46	8,488,853.10
GENERAL MILLS INC	135,568	66.36	8,996,292.48
HERSHEY CO/THE	33,096	211.24	6,991,199.04
HORMEL FOODS CORP	68,367	50.26	3,436,125.42
JM SMUCKER CO/THE	23,569	131.39	3,096,730.91
KELLOGG CO	57,020	61.79	3,523,265.80
KEURIG DR PEPPER INC	162,285	37.26	6,046,739.10
KRAFT HEINZ CO/THE	154,438	38.63	5,965,939.94
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	54,628	96.65	5,279,796.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	46,346	52.92	2,452,630.32
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	311,389	60.85	18,948,020.65
MONSTER BEVERAGE CORP	88,795	78.56	6,975,735.20
PEPSICO INC	309,049	164.47	50,829,289.03
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	348,072	92.58	32,224,505.76
TYSON FOODS INC-CL A	68,122	86.33	5,880,972.26
CHURCH & DWIGHT CO INC	54,045	97.24	5,255,335.80
CLOROX COMPANY	27,132	134.10	3,638,401.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	179,379	73.65	13,211,263.35
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51,790	276.68	14,329,257.20
KIMBERLY-CLARK CORP	75,609	120.09	9,079,884.81
PROCTER & GAMBLE CO/THE	541,290	151.08	81,778,093.20
ABBOTT LABORATORIES	395,463	117.82	46,593,450.66
ABIOMED INC	10,508	321.47	3,378,006.76
ALIGN TECHNOLOGY INC	17,171	436.26	7,491,020.46
AMERISOURCEBERGEN CORP	34,557	152.61	5,273,743.77
ANTHEM INC	54,258	473.73	25,703,642.34
BAXTER INTERNATIONAL INC	112,000	77.68	8,700,160.00
BECTON DICKINSON AND CO	63,512	263.09	16,709,372.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	318,777	42.87	13,665,969.99
CARDINAL HEALTH INC	65,261	57.27	3,737,497.47
CENTENE CORP	130,447	84.71	11,050,165.37
CERNER CORP	65,500	93.65	6,134,075.00
CIGNA CORP	74,135	242.10	17,948,083.50
COOPER COS INC/THE	10,714	411.94	4,413,525.16
CVS HEALTH CORP	295,049	108.05	31,880,044.45
DAVITA INC	16,247	111.77	1,815,927.19
DENTSPLY SIRONA INC	51,832	49.19	2,549,616.08
DEXCOM INC	21,687	468.39	10,157,973.93
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	139,633	109.46	15,284,228.18

HCA HEALTHCARE INC	55,568	260.60	14,481,020.80
HENRY SCHEIN INC	31,351	87.89	2,755,439.39
HOLOGIC INC	56,376	75.19	4,238,911.44
HUMANA INC	28,759	437.42	12,579,761.78
IDEXX LABORATORIES INC	18,938	540.39	10,233,905.82
INMODE LTD	10,900	40.09	436,981.00
INSULET CORP	16,073	251.61	4,044,127.53
INTUITIVE SURGICAL INC	79,834	281.08	22,439,740.72
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	20,897	271.44	5,672,281.68
MASIMO CORP	10,850	156.72	1,700,412.00
MCKESSON CORP	34,743	303.95	10,560,134.85
MEDTRONIC PLC	300,952	106.35	32,006,245.20
MOLINA HEALTHCARE INC	12,915	337.50	4,358,812.50
NOVOCURE LTD	21,179	82.15	1,739,854.85
QUEST DIAGNOSTICS INC	28,721	141.99	4,078,094.79
RESMED INC	32,110	241.37	7,750,390.70
STERIS PLC	21,757	232.37	5,055,674.09
STRYKER CORP	75,849	263.01	19,949,045.49
TELADOC HEALTH INC	30,683	69.39	2,129,093.37
TELEFLEX INC	10,448	334.45	3,494,333.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	210,603	513.46	108,136,216.38
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	17,045	146.35	2,494,535.75
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	30,265	197.75	5,984,903.75
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	47,315	124.15	5,874,157.25
10X GENOMICS INC-CLASS A	16,433	68.99	1,133,712.67
ABBVIE INC	394,850	160.28	63,286,558.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	66,251	136.41	9,037,298.91
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	27,467	163.70	4,496,347.90
AMGEN INC	125,680	236.87	29,769,821.60
AVANTOR INC	125,006	33.81	4,226,452.86
BIO-RAD LABORATORIES-A	5,226	567.70	2,966,800.20
BIO-TECHNE CORP	8,499	435.06	3,697,574.94
BIOGEN INC	33,429	213.01	7,120,711.29
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	41,039	80.88	3,319,234.32
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	496,610	72.41	35,959,530.10
CATALENT INC	36,921	107.91	3,984,145.11
CHARLES RIVER LABORATORIES	10,927	281.05	3,071,033.35
DANAHER CORP	143,805	286.53	41,204,446.65
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	96,813	27.47	2,659,453.11
ELI LILLY & CO	181,891	287.69	52,328,221.79
EXACT SCIENCES CORP	38,473	67.11	2,581,923.03
GILEAD SCIENCES INC	279,601	59.14	16,535,603.14

HORIZON THERAPEUTICS PLC	49,202	109.81	5,402,871.62
ILLUMINA INC	33,720	343.05	11,567,646.00
INCYTE CORP	44,272	78.19	3,461,627.68
IQVIA HOLDINGS INC	43,255	224.62	9,715,938.10
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12,978	159.61	2,071,418.58
JOHNSON & JOHNSON	588,973	175.24	103,211,628.52
MERCK & CO. INC.	565,272	80.41	45,453,521.52
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5,185	1,379.50	7,152,707.50
MODERNA INC	77,000	179.68	13,835,360.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	20,253	94.05	1,904,794.65
NOVAVAX INC	15,085	81.45	1,228,673.25
PERKINELMER INC	24,567	179.34	4,405,845.78
PFIZER INC	1,255,988	52.59	66,052,408.92
REGENERON PHARMACEUTICALS	23,725	679.76	16,127,306.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	74,688	38.52	2,876,981.76
SEAGEN INC	31,786	141.27	4,490,408.22
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	230,144	8.17	1,880,276.48
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	88,122	573.69	50,554,710.18
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	56,656	251.70	14,260,315.20
VIATRIS INC	269,886	10.95	2,955,251.70
WATERS CORP	13,491	325.11	4,386,059.01
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	16,646	408.45	6,799,058.70
ZOETIS INC	105,773	189.57	20,051,387.61
BANK OF AMERICA CORP	1,647,659	43.07	70,964,673.13
CITIGROUP INC	444,365	56.42	25,071,073.30
CITIZENS FINANCIAL GROUP	93,263	48.64	4,536,312.32
FIFTH THIRD BANCORP	149,529	45.85	6,855,904.65
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,606	684.07	1,782,686.42
FIRST REPUBLIC BANK/CA	39,712	166.21	6,600,531.52
HUNTINGTON BANCSHARES INC	318,663	15.14	4,824,557.82
JPMORGAN CHASE & CO	661,214	140.69	93,026,197.66
KEYCORP	212,316	23.60	5,010,657.60
M & T BANK CORP	28,217	179.69	5,070,312.73
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	94,716	193.25	18,303,867.00
REGIONS FINANCIAL CORP	210,035	22.90	4,809,801.50
SIGNATURE BANK	13,245	305.53	4,046,744.85
SVB FINANCIAL GROUP	13,431	576.91	7,748,478.21
TRUIST FINANCIAL CORP	300,085	58.79	17,641,997.15
US BANCORP	315,338	56.05	17,674,694.90
WEBSTER FINANCIAL CORP	40,000	57.81	2,312,400.00
WELLS FARGO & CO	892,025	51.33	45,787,643.25
AGNC INVESTMENT CORP	119,117	13.05	1,554,476.85

ALLY FINANCIAL INC	80,905	44.77	3,622,116.85
AMERICAN EXPRESS CO	147,224	188.89	27,809,141.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	24,455	311.72	7,623,112.60
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	308,776	7.21	2,226,274.96
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	79,026	63.89	5,048,971.14
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	176,126	52.04	9,165,597.04
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	291,486	352.37	102,710,921.82
BLACKROCK INC	34,037	738.28	25,128,836.36
BLACKSTONE INC	153,675	125.70	19,316,947.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	95,198	135.07	12,858,393.86
CARLYLE GROUP INC/THE	37,398	46.60	1,742,746.80
CBOE GLOBAL MARKETS INC	22,574	113.70	2,566,663.80
CME GROUP INC	80,417	244.93	19,696,535.81
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,200	190.19	1,559,558.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	67,198	111.90	7,519,456.20
EQUITABLE HOLDINGS INC	85,959	31.77	2,730,917.43
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	8,392	419.39	3,519,520.88
FRANKLIN RESOURCES INC	65,423	27.60	1,805,674.80
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	12,000	40.45	485,400.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	75,444	336.23	25,366,536.12
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	126,016	135.09	17,023,501.44
INVESCO LTD	73,382	21.83	1,601,929.06
KKR & CO INC	115,220	59.25	6,826,785.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	8,574	353.60	3,031,766.40
MOODY'S CORP	37,496	329.50	12,354,932.00
MORGAN STANLEY	301,010	92.13	27,732,051.30
MSCI INC	18,580	495.73	9,210,663.40
NASDAQ INC	26,774	174.63	4,675,543.62
NORTHERN TRUST CORP	45,748	116.59	5,333,759.32
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	41,987	107.15	4,498,907.05
ROBINHOOD MARKETS INC - A	39,700	12.96	514,512.00
S&P GLOBAL INC	79,217	407.67	32,294,394.39
SCHWAB (CHARLES) CORP	324,121	90.93	29,472,322.53
SEI INVESTMENTS COMPANY	25,390	60.28	1,530,509.20
SOFI TECHNOLOGIES INC	113,000	9.47	1,070,110.00
STATE STREET CORP	80,529	89.01	7,167,886.29
SYNCHRONY FINANCIAL	125,944	36.40	4,584,361.60
T ROWE PRICE GROUP INC	49,313	148.77	7,336,295.01
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	25,266	87.71	2,216,080.86
UPSTART HOLDINGS INC	8,939	115.45	1,032,007.55
AFLAC INC	142,085	64.49	9,163,061.65
ALLEGHANY CORP	2,855	849.54	2,425,436.70

ALLSTATE CORP	64,169	138.75	8,903,448.75
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	17,214	147.07	2,531,662.98
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	185,420	63.16	11,711,127.20
AON PLC-CLASS A	49,235	317.37	15,625,711.95
ARCH CAPITAL GROUP LTD	82,130	47.13	3,870,786.90
ARTHUR J GALLAGHER & CO	46,033	166.27	7,653,906.91
ASSURANT INC	12,691	182.87	2,320,803.17
BROWN & BROWN INC	54,745	68.99	3,776,857.55
CHUBB LTD	96,179	213.19	20,504,401.01
CINCINNATI FINANCIAL CORP	33,719	134.82	4,545,995.58
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	5,829	177.77	1,036,221.33
EVEREST RE GROUP LTD	8,861	295.00	2,613,995.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	57,142	49.61	2,834,814.62
GLOBE LIFE INC	22,587	100.43	2,268,412.41
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	76,830	71.64	5,504,101.20
LINCOLN NATIONAL CORP	36,189	66.04	2,389,921.56
LOEWS CORP	45,838	64.61	2,961,593.18
MARKEL CORP	3,036	1,504.21	4,566,781.56
MARSH & MCLENNAN COS	112,755	164.17	18,510,988.35
METLIFE INC	161,405	70.19	11,329,016.95
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	60,392	71.85	4,339,165.20
PROGRESSIVE CORP	130,742	114.10	14,917,662.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	85,539	119.16	10,192,827.24
TRAVELERS COS INC/THE	55,045	184.22	10,140,389.90
WILLIS TOWERS WATSON PLC	27,469	234.69	6,446,699.61
WR BERKLEY CORP	47,959	65.34	3,133,641.06
CBRE GROUP INC - A	75,296	90.06	6,781,157.76
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	271,100	4.94	1,339,234.00
ZILLOW GROUP INC - A	11,814	54.05	638,546.70
ZILLOW GROUP INC - C	39,739	55.16	2,192,003.24
ACCENTURE PLC-CL A	141,293	325.29	45,961,199.97
ADOBE INC	106,487	432.14	46,017,292.18
AFFIRM HOLDINGS INC	36,187	44.80	1,621,177.60
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	35,940	117.38	4,218,637.20
ANSYS INC	19,572	310.96	6,086,109.12
ASANA INC - CL A	14,600	42.70	623,420.00
AUTODESK INC	49,238	213.05	10,490,155.90
AUTOMATIC DATA PROCESSING	94,272	216.95	20,452,310.40
AVALARA INC	18,034	100.97	1,820,892.98
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	40,100	41.98	1,683,398.00
BILL.COM HOLDINGS INC	17,947	236.44	4,243,388.68
BLACK KNIGHT INC	34,374	58.59	2,013,972.66

BLOCK INC	114,077	135.06	15,407,239.62
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	25,226	151.92	3,832,333.92
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	62,797	162.12	10,180,649.64
CERIDIAN HCM HOLDING INC	32,480	69.41	2,254,436.80
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES INC	23,481	139.29	3,270,668.49
CITRIX SYSTEMS INC	29,822	100.86	3,007,846.92
CLOUDFLARE INC - CLASS A	60,035	122.39	7,347,683.65
COGNIZANT TECHNOLOGIES SOLUTIONS-A	117,526	91.19	10,717,195.94
COUPA SOFTWARE INC	16,876	104.87	1,769,786.12
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	43,208	223.40	9,652,667.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	8,285	169.75	1,406,378.75
DATADOG INC - CLASS A	49,874	152.21	7,591,321.54
DOCUSIGN INC	42,315	104.55	4,424,033.25
DROPBOX INC-CLASS A	64,861	23.23	1,506,721.03
DYNATRACE INC	38,788	48.50	1,881,218.00
EPAM SYSTEMS INC	12,562	288.05	3,618,484.10
FAIR ISAAC CORP	6,056	465.17	2,817,069.52
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	137,191	96.41	13,226,584.31
FISERV INC	133,530	98.70	13,179,411.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	17,158	243.69	4,181,233.02
FORTINET INC	31,479	335.71	10,567,815.09
GARTNER INC	18,357	296.24	5,438,077.68
GLOBAL PAYMENTS INC	65,282	134.93	8,808,500.26
GODADDY INC - CLASS A	39,402	83.49	3,289,672.98
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	19,911	94.24	1,876,412.64
HUBSPOT INC	9,798	474.51	4,649,248.98
INTL BUSINESS MACHINES CORP	200,774	129.25	25,950,039.50
INTUIT INC	60,182	465.63	28,022,544.66
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	17,504	189.33	3,314,032.32
MASTERCARD INC - A	196,257	349.35	68,562,382.95
MICROSOFT CORP	1,595,607	304.10	485,224,088.70
MONGODB INC	13,603	420.34	5,717,885.02
NORTONLIFELOCK INC	130,402	28.06	3,659,080.12
OKTA INC	32,139	144.50	4,644,085.50
ORACLE CORP	367,046	82.24	30,185,863.04
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	374,768	13.39	5,018,143.52
PALO ALTO NETWORKS INC	22,047	622.16	13,716,761.52
PAYCHEX INC	71,299	127.74	9,107,734.26
PAYCOM SOFTWARE INC	11,956	348.85	4,170,850.60
PAYPAL HOLDINGS INC	249,837	116.05	28,993,583.85
PTC INC	26,176	108.01	2,827,269.76
RINGCENTRAL INC-CLASS A	17,130	122.57	2,099,624.10

SALESFORCE.COM INC	219,136	213.98	46,890,721.28
SERVICENOW INC	44,518	581.09	25,868,964.62
SNOWFLAKE INC-CLASS A	47,153	227.57	10,730,608.21
SPLUNK INC	34,937	142.98	4,995,292.26
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	50,868	76.80	3,906,662.40
SYNOPSYS INC	34,258	325.56	11,153,034.48
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	100,119	68.40	6,848,139.60
TWILIO INC - A	37,289	161.94	6,038,580.66
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,833	436.60	3,856,487.80
UNITY SOFTWARE INC	11,919	99.77	1,189,158.63
VERISIGN INC	21,908	215.11	4,712,629.88
VISA INC-CLASS A SHARES	373,561	217.31	81,178,540.91
VMWARE INC-CLASS A	46,071	117.37	5,407,353.27
WESTERN UNION CO	83,023	18.55	1,540,076.65
WIX.COM LTD	11,770	99.84	1,175,116.80
WORKDAY INC-CLASS A	43,231	241.23	10,428,614.13
ZENDESK INC	27,274	119.48	3,258,697.52
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	49,016	117.75	5,771,634.00
ZSCALER INC	18,849	235.79	4,444,405.71
AMPHENOL CORP-CL A	134,753	75.42	10,163,071.26
APPLE INC	3,670,254	174.07	638,881,113.78
ARISTA NETWORKS INC	50,199	139.67	7,011,294.33
ARROW ELECTRONICS INC	15,089	125.97	1,900,761.33
CDW CORP/DE	30,047	175.84	5,283,464.48
CISCO SYSTEMS INC	944,216	54.50	51,459,772.00
COGNEX CORP	40,676	74.13	3,015,311.88
CORNING INC	183,442	38.35	7,035,000.70
DELL TECHNOLOGIES -C	64,910	53.51	3,473,334.10
F5 INC	12,926	208.66	2,697,139.16
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	289,252	17.05	4,931,746.60
HP INC	257,737	38.53	9,930,606.61
IPG PHOTONICS CORP	10,113	115.37	1,166,736.81
JUNIPER NETWORKS INC	77,736	35.66	2,772,065.76
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	41,310	159.08	6,571,594.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	37,167	231.04	8,587,063.68
NETAPP INC	48,562	86.30	4,190,900.60
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	44,798	93.92	4,207,428.16
TE CONNECTIVITY LTD	71,581	131.83	9,436,523.23
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	10,189	467.93	4,767,738.77
TRIMBLE INC	54,603	71.14	3,884,457.42
WESTERN DIGITAL CORP	68,180	50.50	3,443,090.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	12,265	427.37	5,241,693.05

AT&T INC	1,598,397	23.33	37,290,602.01
LIBERTY GLOBAL PLC- C	82,999	26.37	2,188,683.63
LIBERTY GLOBAL PLC-A	34,462	25.85	890,842.70
LUMEN TECHNOLOGIES INC	197,521	10.89	2,151,003.69
T-MOBILE US INC	139,546	125.69	17,539,536.74
VERIZON COMMUNICATIONS INC	925,592	51.00	47,205,192.00
AES CORP	151,592	24.24	3,674,590.08
ALLIANT ENERGY CORP	58,572	60.56	3,547,120.32
AMEREN CORPORATION	59,403	89.55	5,319,538.65
AMERICAN ELECTRIC POWER	113,324	96.44	10,928,966.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40,918	158.15	6,471,181.70
ATMOS ENERGY CORP	30,494	115.67	3,527,240.98
CENTERPOINT ENERGY INC	142,864	29.78	4,254,489.92
CMS ENERGY CORP	65,769	68.05	4,475,580.45
CONSOLIDATED EDISON INC	78,357	91.41	7,162,613.37
CONSTELLATION ENERGY	70,576	52.41	3,698,888.16
DOMINION ENERGY INC	181,464	82.30	14,934,487.20
DTE ENERGY COMPANY	42,200	127.79	5,392,738.00
DUKE ENERGY CORP	172,321	107.47	18,519,337.87
EDISON INTERNATIONAL	82,386	66.96	5,516,566.56
ENTERGY CORP	43,915	112.73	4,950,537.95
ESSENTIAL UTILITIES INC	49,960	48.91	2,443,543.60
EVERGY INC	51,599	65.52	3,380,766.48
EVERSOURCE ENERGY	77,578	85.42	6,626,712.76
EXELON CORP	220,102	44.47	9,787,935.94
FIRSTENERGY CORP	118,816	43.91	5,217,210.56
NEXTERA ENERGY INC	438,941	83.70	36,739,361.70
NISOURCE INC	84,084	30.54	2,567,925.36
NRG ENERGY INC	54,979	36.45	2,003,984.55
P G & E CORP	329,221	11.82	3,891,392.22
PPL CORP	167,745	27.33	4,584,470.85
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	113,304	67.54	7,652,552.16
SEMPRA ENERGY	72,064	158.86	11,448,087.04
SOUTHERN CO/THE	237,245	69.30	16,441,078.50
UGI CORP	42,489	35.42	1,504,960.38
VISTRA CORP	90,388	22.05	1,993,055.40
WEC ENERGY GROUP INC	71,282	96.61	6,886,554.02
XCEL ENERGY INC	119,294	69.88	8,336,264.72
ADVANCED MICRO DEVICES	365,642	120.53	44,070,830.26
ANALOG DEVICES INC	119,767	164.96	19,756,764.32
APPLIED MATERIALS INC	202,400	138.59	28,050,616.00
BROADCOM INC	91,998	626.43	57,630,307.14

	ENPHASE ENERGY INC	27,891	197.84	5,517,955.44	
	ENTEGRIS INC	29,817	136.27	4,063,162.59	
	INTEL CORP	909,986	51.62	46,973,477.32	
	KLA CORP	34,031	365.89	12,451,602.59	
	LAM RESEARCH CORP	31,615	556.22	17,584,895.30	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	184,033	73.76	13,574,274.08	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	125,141	77.68	9,720,952.88	
	MICRON TECHNOLOGY INC	250,040	78.21	19,555,628.40	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9,443	494.62	4,670,696.66	
	NVIDIA CORP	559,192	281.50	157,412,548.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	60,185	191.08	11,500,149.80	
	ON SEMICONDUCTOR	98,097	63.58	6,237,007.26	
	QORVO INC	24,967	130.70	3,263,186.90	
	QUALCOMM INC	250,423	158.46	39,682,028.58	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	38,102	138.43	5,274,459.86	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	11,595	337.74	3,916,095.30	
	TERADYNE INC	36,421	122.69	4,468,492.49	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	206,468	184.21	38,033,470.28	
	アメリカドル 小計	71,327,702		8,851,835,372.82 (1,080,543,543,960)	
カナダドル	CAMECO CORP	94,400	36.34	3,430,496.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	262,700	78.89	20,724,403.00	
	CENOVUS ENERGY INC	294,200	20.15	5,928,130.00	
	ENBRIDGE INC	452,200	56.91	25,734,702.00	
	IMPERIAL OIL LTD	57,000	56.80	3,237,600.00	
	KEYERA CORP	42,500	30.67	1,303,475.00	
	PARKLAND CORP	37,300	34.39	1,282,747.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	122,432	47.06	5,761,649.92	
	SUNCOR ENERGY INC	329,800	41.21	13,591,058.00	
	TC ENERGY CORP	219,400	71.06	15,590,564.00	
	TOURMALINE OIL CORP	68,200	54.86	3,741,452.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	101,940	77.90	7,941,126.00	
	BARRICK GOLD CORP	395,500	30.68	12,133,940.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	35,100	56.93	1,998,243.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	136,400	41.92	5,717,888.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	43,100	198.80	8,568,280.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	142,900	11.91	1,701,939.00	
	KINROSS GOLD CORP	284,300	7.10	2,018,530.00	
	LUNDIN MINING CORP	154,200	13.05	2,012,310.00	
	NUTRIEN LTD	125,959	133.89	16,864,650.51	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	50,100	35.46	1,776,546.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	107,200	50.91	5,457,552.00	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	19,200	109.52	2,102,784.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	101,600	60.55	6,151,880.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	58,400	15.38	898,192.00
CAE INC	74,900	31.94	2,392,306.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	18,100	116.22	2,103,582.00
WSP GLOBAL INC	26,100	166.02	4,333,122.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	38,500	38.74	1,491,490.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	27,000	73.65	1,988,550.00
THOMSON REUTERS CORP	37,732	132.95	5,016,469.40
AIR CANADA	34,500	23.54	812,130.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	158,300	168.14	26,616,562.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	208,000	102.85	21,392,800.00
TFI INTERNATIONAL INC	18,500	138.25	2,557,625.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	62,100	80.01	4,968,621.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	42,800	47.05	2,013,740.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	64,310	71.55	4,601,380.50
QUEBECOR INC -CL B	39,300	28.82	1,132,626.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	102,900	38.47	3,958,563.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	12,900	185.37	2,391,273.00
DOLLARAMA INC	66,900	67.90	4,542,510.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	193,000	53.40	10,306,200.00
EMPIRE CO LTD 'A'	41,700	43.17	1,800,189.00
LOBLAW COMPANIES LTD	37,000	109.52	4,052,240.00
METRO INC/CN	52,700	70.00	3,689,000.00
WESTON (GEORGE) LTD	15,611	153.40	2,394,727.40
SAPUTO INC	61,500	29.83	1,834,545.00
BAUSCH HEALTH COS INC	63,100	29.34	1,851,354.00
CANOPY GROWTH CORP	36,500	9.93	362,445.00
BANK OF MONTREAL	144,200	148.80	21,456,960.00
BANK OF NOVA SCOTIA	271,200	91.18	24,728,016.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	100,400	158.80	15,943,520.00
NATIONAL BANK OF CANADA	76,600	98.28	7,528,248.00
ROYAL BANK OF CANADA	318,300	140.49	44,717,967.00
TORONTO-DOMINION BANK	406,900	100.89	41,052,141.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	315,650	70.58	22,278,577.00
IGM FINANCIAL INC	20,700	45.33	938,331.00
ONEX CORPORATION	16,300	83.55	1,361,865.00
TMX GROUP LTD	12,500	129.07	1,613,375.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5,500	636.43	3,500,365.00
GREAT-WEST LIFECO INC	55,300	35.96	1,988,588.00
IA FINANCIAL CORP INC	26,500	76.30	2,021,950.00
INTACT FINANCIAL CORP	40,500	185.06	7,494,930.00

	MANULIFE FINANCIAL CORP	426,800	26.13	11,152,284.00	
	POWER CORP OF CANADA	125,600	39.09	4,909,704.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	130,900	69.72	9,126,348.00	
	FIRSTSERVICE CORP	7,700	177.93	1,370,061.00	
	BLACKBERRY LTD	121,600	9.56	1,162,496.00	
	CGI INC	49,400	101.54	5,016,076.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,400	2,123.77	9,344,588.00	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	23,200	37.66	873,712.00	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	17,800	92.00	1,637,600.00	
	OPEN TEXT CORP	57,100	53.35	3,046,285.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	25,500	882.59	22,506,045.00	
	BCE INC	15,400	67.66	1,041,964.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	79,200	66.88	5,296,896.00	
	TELUS CORP	115,100	32.12	3,697,012.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	161,800	19.13	3,095,234.00	
	ALTAGAS LTD	55,200	27.68	1,527,936.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	29,450	52.90	1,557,905.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	23,200	37.13	861,416.00	
	EMERA INC	60,500	60.47	3,658,435.00	
	FORTIS INC	101,800	60.34	6,142,612.00	
	HYDRO ONE LTD	69,100	32.47	2,243,677.00	
	NORTHLAND POWER INC	51,900	41.37	2,147,103.00	
	カナダドル 小計	8,833,184		592,314,409.73 (57,638,115,210)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	59,251	29.91	1,772,197.41	
	SANTOS LTD	752,247	7.89	5,935,228.83	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	43,399	27.00	1,171,773.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	217,603	33.20	7,224,419.60	
	BHP GROUP LTD	1,133,248	49.30	55,869,126.40	
	BLUESCOPE STEEL LTD	121,636	20.42	2,483,807.12	
	EVOLUTION MINING LTD	376,840	4.42	1,665,632.80	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	374,633	18.94	7,095,549.02	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	98,150	43.76	4,295,044.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	37,998	48.50	1,842,903.00	
	NEWCREST MINING LTD	200,237	26.00	5,206,162.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	251,805	10.56	2,659,060.80	
	ORICA LTD	81,415	15.71	1,279,029.65	
	RIO TINTO LTD	83,673	116.01	9,706,904.73	
	SOUTH32 LTD	995,810	5.08	5,058,714.80	
	REECE LTD	53,600	19.05	1,021,080.00	
	BRAMBLES LTD	306,222	9.54	2,921,357.88	
	AURIZON HOLDINGS LTD	438,172	3.65	1,599,327.80	

	QANTAS AIRWAYS LTD	240,658	5.05	1,215,322.90	
	TRANSURBAN GROUP	684,708	13.16	9,010,757.28	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	131,838	36.30	4,785,719.40	
	CROWN RESORTS LTD	68,133	12.50	851,662.50	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	12,910	86.14	1,112,067.40	
	IDP EDUCATION LTD	45,653	30.94	1,412,503.82	
	TABCORP HOLDINGS LTD	447,984	5.00	2,239,920.00	
	REA GROUP LTD	11,423	136.42	1,558,325.66	
	SEEK LTD	81,745	29.99	2,451,532.55	
	WESFARMERS LTD	257,053	50.34	12,940,048.02	
	COLES GROUP LTD	296,065	17.85	5,284,760.25	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	284,660	7.09	2,018,239.40	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	277,742	36.42	10,115,363.64	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	161,259	11.66	1,880,279.94	
	COCHLEAR LTD	14,105	221.53	3,124,680.65	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	39,800	63.48	2,526,504.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	106,962	35.22	3,767,201.64	
	CSL LTD	107,103	267.40	28,639,342.20	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	634,390	27.72	17,585,290.80	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	382,012	107.35	41,008,988.20	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	732,826	31.79	23,296,538.54	
	WESTPAC BANKING CORP	822,414	23.89	19,647,470.46	
	ASX LTD	44,474	80.62	3,585,493.88	
	MACQUARIE GROUP LTD	75,976	196.59	14,936,121.84	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	525,614	4.52	2,375,775.28	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	571,288	3.05	1,742,428.40	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	353,556	11.33	4,005,789.48	
	SUNCORP GROUP LTD	302,547	11.14	3,370,373.58	
	LENDLEASE GROUP	163,134	10.84	1,768,372.56	
	COMPUTERSHARE LTD	125,767	24.05	3,024,696.35	
	WISETECH GLOBAL LTD	30,612	51.80	1,585,701.60	
	XERO LTD	27,977	102.76	2,874,916.52	
	TELSTRA CORP LTD	904,630	3.90	3,528,057.00	
	APA GROUP	244,844	10.32	2,526,790.08	
	ORIGIN ENERGY LTD	366,503	6.29	2,305,303.87	
	オーストラリアドル 小計	15,204,304		362,909,658.53 (33,246,153,817)	
イギリスポンド	BP PLC	4,266,473	3.89	16,605,112.91	
	SHELL PLC	1,664,689	20.81	34,642,178.09	
	ANGLO AMERICAN PLC	278,037	39.41	10,957,438.17	
	ANTOFAGASTA PLC	78,909	17.81	1,405,763.83	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	30,712	73.84	2,267,774.08	

GLENCORE PLC	2,148,468	5.00	10,748,785.40
JOHNSON MATTHEY PLC	40,850	18.54	757,563.25
MONDI PLC	99,142	15.11	1,498,531.33
RIO TINTO PLC	240,861	58.57	14,107,228.77
ASHTED GROUP PLC	95,612	52.00	4,971,824.00
BAE SYSTEMS PLC	699,363	7.48	5,236,830.14
BUNZL PLC	71,046	28.91	2,053,939.86
DCC PLC	23,269	57.84	1,345,878.96
FERGUSON PLC	47,507	108.60	5,159,260.20
MELROSE INDUSTRIES PLC	971,774	1.25	1,219,576.37
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,875,280	0.92	1,730,883.44
SMITHS GROUP PLC	91,485	15.18	1,388,742.30
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	16,456	123.25	2,028,202.00
EXPERIAN PLC	197,399	29.88	5,898,282.12
INTERTEK GROUP PLC	32,582	51.42	1,675,366.44
RELX PLC	413,967	23.20	9,604,034.40
RENTOKIL INITIAL PLC	417,058	5.15	2,147,848.70
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	220,084	5.25	1,156,761.50
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	25,023	39.36	984,905.28
BURBERRY GROUP PLC	90,880	16.56	1,504,972.80
PERSIMMON PLC	64,494	21.92	1,413,708.48
TAYLOR WIMPEY PLC	842,559	1.37	1,157,254.78
COMPASS GROUP PLC	381,249	16.66	6,353,514.58
ENTAIN PLC	119,116	16.56	1,973,156.54
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	42,043	51.38	2,160,169.34
WHITBREAD PLC	41,256	27.42	1,131,239.52
AUTO TRADER GROUP PLC	201,068	6.53	1,314,180.44
INFORMA PLC	309,231	5.85	1,810,238.27
PEARSON PLC	156,686	7.67	1,202,094.99
WPP PLC	250,264	10.21	2,556,446.76
JD SPORTS FASHION PLC	497,980	1.47	735,267.47
KINGFISHER PLC	450,309	2.61	1,178,908.96
NEXT PLC	30,253	61.76	1,868,425.28
OCADO GROUP PLC	106,238	11.03	1,171,805.14
SAINSBURY (J) PLC	351,321	2.59	911,677.99
TESCO PLC	1,650,699	2.75	4,540,247.59
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	80,908	16.88	1,366,131.58
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	468,796	32.62	15,292,125.52
COCA-COLA HBC AG-DI	44,409	15.95	708,545.59
DIAGEO PLC	501,172	37.47	18,781,420.70
IMPERIAL BRANDS PLC	207,965	16.17	3,362,794.05
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	152,896	56.35	8,615,689.60

	UNILEVER PLC	554,322	33.70	18,680,651.40	
	SMITH & NEPHEW PLC	197,459	12.29	2,426,771.11	
	ASTRAZENECA PLC	334,295	98.36	32,881,256.20	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	1,097,142	16.25	17,835,140.35	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	33,592	21.22	712,822.24	
	BARCLAYS PLC	3,613,092	1.68	6,082,279.07	
	HSBC HOLDINGS PLC	4,395,175	5.17	22,749,425.80	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	15,172,069	0.49	7,509,415.55	
	NATWEST GROUP PLC	1,181,288	2.24	2,648,447.69	
	STANDARD CHARTERED PLC	546,761	5.02	2,748,020.78	
	3I GROUP PLC	214,678	13.25	2,845,556.89	
	ABRDN PLC	446,113	2.04	912,747.19	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	82,621	10.39	858,845.29	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	70,238	78.24	5,495,421.12	
	M&G PLC	557,560	2.21	1,234,995.40	
	SCHRODERS PLC	29,015	31.50	913,972.50	
	ST JAMES'S PLACE PLC	113,399	14.65	1,661,862.34	
	ADMIRAL GROUP PLC	46,669	25.83	1,205,460.27	
	AVIVA PLC	802,288	4.35	3,495,568.81	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,298,451	2.71	3,527,891.36	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	165,125	6.40	1,057,130.25	
	PRUDENTIAL PLC	592,952	10.82	6,415,740.64	
	AVEVA GROUP PLC	26,671	24.94	665,174.74	
	SAGE GROUP PLC/THE	219,588	6.86	1,507,252.03	
	HALMA PLC	84,949	24.79	2,105,885.71	
	BT GROUP PLC	1,960,942	1.84	3,622,840.34	
	VODAFONE GROUP PLC	5,920,344	1.24	7,390,957.44	
	NATIONAL GRID PLC	788,499	11.19	8,829,611.80	
	SEVERN TRENT PLC	55,574	29.26	1,626,095.24	
	SSE PLC	226,204	16.74	3,787,785.98	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	147,666	10.65	1,573,381.23	
	イギリスポンド 小計	62,062,579		395,711,134.27 (63,685,749,949)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	42,084	16.48	693,544.32	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,369	904.50	1,238,260.50	
	GIVAUDAN-REG	2,106	3,882.00	8,175,492.00	
	HOLCIM LTD	120,471	44.80	5,397,100.80	
	SIKA AG-REG	31,788	304.00	9,663,552.00	
	ABB LTD-REG	366,652	32.09	11,765,862.68	
	GEBERIT AG-REG	7,913	572.60	4,530,983.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	5,116	198.60	1,016,037.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,711	201.60	1,756,137.60	

	VAT GROUP AG	5,942	348.00	2,067,816.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	33,753	43.37	1,463,867.61	
	SGS SA-REG	1,336	2,686.00	3,588,496.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12,470	279.30	3,482,871.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	116,765	114.25	13,340,401.25	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	6,323	252.50	1,596,557.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	11,657	48.34	563,499.38	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	723	2,104.00	1,521,192.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	256	11,160.00	2,856,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	23	112,100.00	2,578,300.00	
	NESTLE SA-REG	629,523	119.92	75,492,398.16	
	ALCON INC	109,598	70.70	7,748,578.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	11,876	359.00	4,263,484.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	2,252	1,404.50	3,162,934.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,377	497.00	684,369.00	
	LONZA GROUP AG-REG	16,635	654.80	10,892,598.00	
	NOVARTIS AG-REG	490,408	80.47	39,463,131.76	
	ROCHE HOLDING AG-BR	7,227	405.00	2,926,935.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	156,909	372.60	58,464,293.40	
	VIFOR PHARMA AG	11,245	166.00	1,866,670.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	585,354	7.55	4,421,764.11	
	JULIUS BAER GROUP LTD	51,473	52.82	2,718,803.86	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	5,019	1,127.50	5,658,922.50	
	UBS GROUP AG-REG	786,948	17.76	13,980,131.22	
	BALOISE HOLDING AG - REG	10,786	161.40	1,740,860.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7,155	591.60	4,232,898.00	
	SWISS RE AG	69,000	86.38	5,960,220.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	33,532	447.70	15,012,276.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	18,333	92.50	1,695,802.50	
	TEMENOS AG - REG	15,481	97.66	1,511,874.46	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	40,153	70.82	2,843,635.46	
	SWISSCOM AG-REG	6,023	561.20	3,380,107.60	
	スイスフラン 小計	3,841,765		345,419,620.47 (45,433,042,680)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	618,868	58.15	35,987,174.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	316,500	130.00	41,145,000.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	428,000	19.52	8,354,560.00	
	MTR CORP	376,500	42.00	15,813,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	257,000	29.80	7,658,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	458,000	46.45	21,274,100.00	
	SANDS CHINA LTD	503,200	18.10	9,107,920.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	471,200	14.06	6,625,072.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	424,400	20.90	8,869,960.00	
	WH GROUP LTD	1,590,000	4.81	7,647,900.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	808,000	28.65	23,149,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	179,100	149.80	26,829,180.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	270,300	384.00	103,795,200.00	
	AIA GROUP LTD	2,711,600	82.80	224,520,480.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	417,368	52.85	22,057,898.80	
	ESR CAYMAN LTD	496,800	24.45	12,146,760.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	494,000	16.00	7,904,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	319,641	32.85	10,500,206.85	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	362,250	32.15	11,646,337.50	
	SINO LAND CO	673,400	10.56	7,111,104.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	302,000	95.00	28,690,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	85,000	47.50	4,037,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	305,600	20.50	6,264,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	364,000	39.25	14,287,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	891,000	10.90	9,711,900.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	160,500	53.00	8,506,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	350,500	76.15	26,690,575.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	501,500	7.87	3,946,805.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,431,348	9.73	23,657,016.04	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	291,000	51.20	14,899,200.00	
	香港ドル 小計	17,858,575		752,834,949.39 (11,744,225,210)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	323,200	6.49	2,097,568.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	390,400	4.12	1,608,448.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	282,840	5.40	1,527,336.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,234,500	0.82	1,018,462.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	404,300	4.87	1,968,941.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	408,300	35.64	14,551,812.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	750,700	12.30	9,233,610.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	268,800	32.03	8,609,664.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	180,500	9.82	1,772,510.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	520,300	3.91	2,034,373.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	118,100	7.63	901,103.00	
	UOL GROUP LTD	104,000	7.10	738,400.00	
	VENTURE CORP LTD	76,900	17.28	1,328,832.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,845,760	2.62	4,835,891.20	
	シンガポールドル 小計	6,908,600		52,226,950.70 (4,698,336,484)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	264,685	7.74	2,048,661.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	140,716	24.52	3,450,356.32	

	RYMAN HEALTHCARE LTD	99,094	9.82	973,103.08	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	384,103	4.71	1,809,125.13	
	MERCURY NZ LTD	123,073	5.73	705,208.29	
	MERIDIAN ENERGY LTD	310,651	5.16	1,602,959.16	
	ニュージーランドドル 小計	1,322,322		10,589,413.88 (899,147,132)	
スウェーデンク ローネ	LUNDIN ENERGY AB	49,269	390.60	19,244,471.40	
	BOLIDEN AB	58,210	483.30	28,132,893.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	135,378	181.55	24,577,875.90	
	ALFA LAVAL AB	65,282	317.20	20,707,450.40	
	ASSA ABLOY AB-B	225,870	256.40	57,913,068.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	150,482	513.40	77,257,458.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	85,546	450.70	38,555,582.20	
	EPIROC AB-A	141,767	196.00	27,786,332.00	
	EPIROC AB-B	85,210	164.60	14,025,566.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	100,182	100.25	10,043,245.50	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	35,887	284.10	10,195,496.70	
	LIFCO AB-B SHS	51,400	224.00	11,513,600.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	310,082	96.48	29,916,711.36	
	SANDVIK AB	257,846	212.80	54,869,628.80	
	SKANSKA AB-B SHS	80,533	217.00	17,475,661.00	
	SKF AB-B SHARES	87,271	160.75	14,028,813.25	
	VOLVO AB-A SHS	60,358	186.10	11,232,623.80	
	VOLVO AB-B SHS	311,072	181.68	56,515,560.96	
	SECURITAS AB-B SHS	63,836	108.95	6,954,932.20	
	ELECTROLUX AB-B	54,636	145.40	7,944,074.40	
	EVOLUTION AB	39,281	1,045.00	41,048,645.00	
	EMBRACER GROUP AB	129,100	79.04	10,204,064.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	155,079	137.76	21,363,683.04	
	SWEDISH MATCH AB	370,792	72.40	26,845,340.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	133,294	220.50	29,391,327.00	
	GETINGE AB-B SHS	49,890	342.70	17,097,303.00	
	NORDEA BANK ABP	713,739	102.78	73,358,094.42	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	351,124	101.95	35,797,091.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	333,250	88.22	29,399,315.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	198,763	153.84	30,577,699.92	
	EQT AB	68,671	340.50	23,382,475.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	33,271	269.40	8,963,207.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	34,500	265.70	9,166,650.00	
	INVESTOR AB-A SHS	103,900	216.70	22,515,130.00	
	INVESTOR AB-B SHS	415,982	203.10	84,485,944.20	
	KINNEVIK AB - B	54,482	236.65	12,893,165.30	

	LUNDBERGS AB-B SHS	15,125	463.20	7,005,900.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	24,558	590.60	14,503,954.80	
	SAGAX AB-B	34,700	261.40	9,070,580.00	
	SINCH AB	111,000	80.16	8,897,760.00	
	ERICSSON LM-B SHS	661,362	86.44	57,168,131.28	
	HEXAGON AB-B SHS	444,476	131.65	58,515,265.40	
	TELE2 AB-B SHS	99,863	130.70	13,052,094.10	
	TELIA CO AB	635,848	36.80	23,402,385.64	
	スウェーデンクローネ 小計	7,622,167		1,206,996,253.27 (15,678,881,329)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	28,408	316.00	8,976,928.00	
	EQUINOR ASA	218,747	319.90	69,977,165.30	
	NORSK HYDRO ASA	311,715	91.66	28,571,796.90	
	YARA INTERNATIONAL ASA	40,074	448.00	17,953,152.00	
	ADEVINTA ASA	55,857	83.04	4,638,365.28	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	21,375	192.00	4,104,000.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	18,279	218.00	3,984,822.00	
	MOWI ASA	94,231	236.00	22,238,516.00	
	ORKLA ASA	157,053	77.48	12,168,466.44	
	DNB BANK ASA	200,624	205.30	41,188,107.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	50,151	227.50	11,409,352.50	
	TELENOR ASA	149,654	128.35	19,208,090.90	
	ノルウェークローネ 小計	1,346,168		244,418,762.52 (3,441,416,176)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	23,029	484.00	11,146,036.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	48,791	440.60	21,497,314.60	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1,690	2,383.00	4,027,270.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	223,096	191.90	42,812,122.40	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	707	20,760.00	14,677,320.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,243	21,340.00	26,525,620.00	
	DSV A/S	45,868	1,306.00	59,903,608.00	
	PANDORA A/S	20,620	628.80	12,965,856.00	
	CARLSBERG AS-B	22,302	790.40	17,627,500.80	
	AMBU A/S-B	38,506	96.02	3,697,346.12	
	COLOPLAST-B	25,912	959.60	24,865,155.20	
	DEMANT A/S	21,128	280.10	5,917,952.80	
	GN STORE NORD A/S	31,620	314.80	9,953,976.00	
	GENMAB A/S	14,891	2,367.00	35,246,997.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	377,031	730.00	275,232,630.00	
	DANSKE BANK A/S	149,249	113.30	16,909,911.70	
	TRYG A/S	80,244	161.60	12,967,430.40	
	ORSTED A/S	43,570	761.40	33,174,198.00	

デンマーククローネ 小計		1,169,497		629,148,245.02 (11,362,417,305)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	169,185	38.20	6,462,867.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,590	741.00	4,142,190.00	
	BANK HAPOLIM BM	251,114	32.64	8,196,360.96	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	327,151	36.30	11,875,581.30	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	264,705	20.87	5,524,393.35	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	36,998	124.20	4,595,151.60	
	AZRIELI GROUP LTD	9,206	281.00	2,586,886.00	
	NICE LTD	13,762	701.10	9,648,538.20	
イスラエルシェケル 小計		1,077,711		53,031,968.41 (2,012,038,184)	
ユーロ	ENI SPA	563,185	13.31	7,498,245.09	
	GALP ENERGIA SGPS SA	112,235	11.36	1,275,550.77	
	NESTE OYJ	91,192	35.26	3,215,429.92	
	OMV AG	29,624	40.75	1,207,178.00	
	REPSOL SA	317,562	11.99	3,807,568.38	
	TENARIS SA	107,421	13.90	1,493,689.00	
	TOTALENERGIES SE	560,524	46.68	26,168,062.94	
	AIR LIQUIDE SA	105,818	157.44	16,659,985.92	
	AKZO NOBEL N.V.	41,507	76.30	3,166,984.10	
	ARCELORMITTAL	140,743	30.25	4,258,179.46	
	ARKEMA	14,240	112.00	1,594,880.00	
	BASF SE	205,311	52.30	10,737,765.30	
	COVESTRO AG	44,321	47.48	2,104,361.08	
	CRH PLC	174,986	38.42	6,722,962.12	
	EVONIK INDUSTRIES AG	42,199	25.39	1,071,432.61	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	15,893	33.66	534,958.38	
	HEIDELBERGCEMENT AG	32,708	53.12	1,737,448.96	
	KONINKLIJKE DSM NV	38,714	161.15	6,238,761.10	
	LANXESS AG	18,398	42.20	776,395.60	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	52,141	40.47	2,110,146.27	
	SOLVAY SA	16,005	92.00	1,472,460.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	126,844	18.07	2,292,071.08	
	SYMRISE AG	28,472	106.65	3,036,538.80	
	UMICORE	41,597	38.61	1,606,060.17	
	UPM-KYMMENE OYJ	116,354	31.13	3,622,100.02	
	VOESTALPINE AG	22,917	28.28	648,092.76	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	49,107	24.58	1,207,050.06	
	AIRBUS SE	131,730	107.40	14,147,802.00	
	ALSTOM	65,106	21.78	1,418,008.68	
	BOUYGUES SA	46,414	32.46	1,506,598.44	

BRENTAG SE	36,173	74.64	2,699,952.72
CNH INDUSTRIAL NV	236,988	15.12	3,584,443.50
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	112,332	55.42	6,225,439.44
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	92,511	25.71	2,378,457.81
DASSAULT AVIATION SA	4,650	138.30	643,095.00
EIFFAGE	19,782	91.96	1,819,152.72
FERROVIAL SA	112,588	25.06	2,821,455.28
GEA GROUP AG	32,762	39.26	1,286,236.12
IMCD NV	12,487	153.05	1,911,135.35
KINGSPAN GROUP PLC	34,132	90.86	3,101,233.52
KION GROUP AG	16,163	62.04	1,002,752.52
KNORR-BREMSE AG	18,716	71.18	1,332,204.88
KONE OYJ-B	73,235	48.43	3,546,771.05
LEGRAND SA	60,865	86.16	5,244,128.40
MTU AERO ENGINES AG	12,232	212.00	2,593,184.00
PRYSMIAN SPA	57,118	30.56	1,745,526.08
RATIONAL AG	1,276	670.80	855,940.80
SAFRAN SA	75,005	104.56	7,842,522.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	120,634	150.80	18,191,607.20
SIEMENS AG-REG	171,011	130.12	22,251,951.32
SIEMENS ENERGY AG	85,204	21.23	1,808,880.92
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	63,080	16.84	1,062,267.20
THALES SA	23,736	118.00	2,800,848.00
VINCI SA	115,894	91.53	10,607,777.82
WARTSILA OYJ ABP	111,799	9.86	1,102,785.33
BUREAU VERITAS SA	65,465	26.61	1,742,023.65
RANDSTAD NV	27,042	57.74	1,561,405.08
TELEPERFORMANCE	13,599	343.10	4,665,816.90
WOLTERS KLUWER	60,636	94.98	5,759,207.28
ADP	7,502	134.20	1,006,768.40
AENA SME SA	17,626	145.05	2,556,651.30
ATLANTIA SPA	118,623	18.36	2,177,918.28
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	120,311	7.14	859,020.54
DEUTSCHE POST AG-REG	221,975	44.58	9,896,755.37
GETLINK SE	108,240	16.08	1,741,040.40
INPOST SA	33,800	5.23	176,909.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	73,396	78.47	5,759,384.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	11,827	68.35	808,375.45
CONTINENTAL AG	26,825	65.34	1,752,745.50
FAURECIA	26,480	23.78	629,694.40
FERRARI NV	28,644	193.50	5,542,614.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	190,979	63.12	12,054,594.48

MICHELIN (CGDE)	39,282	119.55	4,696,163.10
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	34,870	83.16	2,899,789.20
RENAULT SA	45,587	22.86	1,042,346.75
STELLANTIS NV	446,590	14.41	6,436,255.08
VALEO	48,595	15.74	764,885.30
VOLKSWAGEN AG	7,018	221.00	1,550,978.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	42,655	151.98	6,482,706.90
ADIDAS AG	42,706	210.35	8,983,207.10
ESSILORLUXOTTICA	64,224	167.36	10,748,528.64
HERMES INTERNATIONAL	6,869	1,204.00	8,270,276.00
KERING	16,803	577.20	9,698,691.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	62,053	624.70	38,764,509.10
MONCLER SPA	45,881	49.26	2,260,098.06
PUMA SE	25,641	76.34	1,957,433.94
SEB SA	5,031	123.20	619,819.20
ACCOR SA	40,565	28.31	1,148,395.15
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	36,684	105.60	3,873,830.40
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,570	36.55	642,183.50
SODEXO SA	17,963	72.98	1,310,939.74
BOLLORE SE	192,893	4.59	885,378.87
PUBLICIS GROUPE	50,088	55.22	2,765,859.36
SCOUT24 SE	19,461	51.38	999,906.18
UBISOFT ENTERTAINMENT	20,939	39.76	832,534.64
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	157,337	23.09	3,633,698.01
VIVENDI SE	184,108	11.78	2,169,712.78
DELIVERY HERO SE	35,184	38.78	1,364,435.52
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	240,572	20.65	4,967,811.80
JUST EAT TAKEAWAY	38,653	31.15	1,204,040.95
PROSUS NV	209,319	49.39	10,339,312.00
ZALANDO SE	48,312	47.88	2,313,178.56
CARREFOUR SA	134,497	18.78	2,526,526.14
COLRUYT SA	9,744	36.89	359,456.16
HELLOFRESH SE	34,388	40.61	1,396,496.68
JERONIMO MARTINS	58,770	20.65	1,213,600.50
KESKO OYJ-B SHS	59,164	25.43	1,504,540.52
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	235,970	28.49	6,722,785.30
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	195,177	53.28	10,399,030.56
DANONE	143,311	51.51	7,381,949.61
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	114,974	9.91	1,139,622.28
HEINEKEN HOLDING NV	24,952	70.70	1,764,106.40
HEINEKEN NV	59,488	87.60	5,211,148.80
JDE PEET'S NV	24,300	26.12	634,837.50

KERRY GROUP PLC-A	35,002	102.00	3,570,204.00
PERNOD RICARD SA	45,443	186.40	8,470,575.20
REMY COINTREAU	4,720	174.90	825,528.00
BEIERSDORF AG	22,611	92.16	2,083,829.76
HENKEL AG & CO KGAA	22,589	61.25	1,383,576.25
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	40,132	61.70	2,476,144.40
L'OREAL	56,147	349.90	19,645,835.30
AMPLIFON SPA	28,180	36.53	1,029,415.40
BIOMERIEUX	9,711	96.78	939,830.58
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	8,610	142.60	1,227,786.00
DIASORIN SPA	6,146	129.75	797,443.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	47,268	58.58	2,768,959.44
FRESENIUS SE & CO KGAA	91,347	32.24	2,945,484.01
KONINKLIJKE PHILIPS NV	201,442	27.02	5,442,962.84
ORPEA	11,395	35.49	404,408.55
SARTORIUS AG-VORZUG	6,294	386.90	2,435,148.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	61,632	54.00	3,328,128.00
ARGENX SE	10,319	288.70	2,979,095.30
BAYER AG-REG	219,986	59.53	13,095,766.58
EUROFINS SCIENTIFIC	29,861	88.05	2,629,261.05
GRIFOLS SA	63,628	15.42	981,143.76
IPSEN	9,843	111.90	1,101,431.70
MERCK KGAA	29,329	181.55	5,324,679.95
ORION OYJ-CLASS B	26,484	40.42	1,070,483.28
QIAGEN N.V.	55,231	43.67	2,411,937.77
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	23,003	45.42	1,044,796.26
SANOFI	254,506	93.19	23,717,414.14
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	6,259	352.10	2,203,793.90
UCB SA	29,134	107.80	3,140,645.20
ABN AMRO BANK NV-CVA	99,792	11.42	1,139,624.64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,465,666	5.12	7,504,209.92
BANCO SANTANDER SA	3,878,233	3.06	11,882,905.91
BNP PARIBAS	251,584	51.10	12,855,942.40
CAIXABANK SA	989,139	3.02	2,987,199.78
COMMERZBANK AG	206,046	7.14	1,471,580.53
CREDIT AGRICOLE SA	292,185	10.67	3,118,782.69
ERSTE GROUP BANK AG	82,077	32.48	2,665,860.96
FINECOBANK SPA	133,964	14.05	1,882,194.20
ING GROEP NV	878,984	9.43	8,289,698.10
INTESA SANPAOLO	3,730,392	2.03	7,576,426.15
KBC GROUP NV	53,757	65.20	3,504,956.40
MEDIOBANCA SPA	133,581	9.08	1,213,716.96

RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	38,023	12.35	469,584.05
SOCIETE GENERALE SA	177,526	24.09	4,276,601.34
UNICREDIT SPA	488,940	9.48	4,639,551.66
AMUNDI SA	14,529	61.05	886,995.45
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	470,963	11.54	5,434,913.02
DEUTSCHE BOERSE AG	42,520	158.85	6,754,302.00
EURAZEO SE	7,132	71.70	511,364.40
EURONEXT NV	18,671	81.40	1,519,819.40
EXOR NV	24,087	67.40	1,623,463.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	26,391	93.38	2,464,391.58
SOFINA	3,472	328.40	1,140,204.80
WENDEL	4,862	90.65	440,740.30
AEGON NV	420,133	4.61	1,938,913.79
AGEAS	41,152	46.01	1,893,403.52
ALLIANZ SE-REG	91,257	212.65	19,405,801.05
ASSICURAZIONI GENERALI	238,085	19.06	4,539,090.52
AXA SA	434,048	25.67	11,142,012.16
CNP ASSURANCES	31,208	21.82	680,958.56
HANNOVER RUECK SE	13,366	150.60	2,012,919.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	30,681	237.15	7,275,999.15
NN GROUP NV	63,116	44.31	2,796,669.96
POSTE ITALIANE SPA	111,107	10.55	1,172,178.85
SAMPO OYJ-A SHS	113,909	43.97	5,008,578.73
AROUNDTOWN SA	217,874	5.30	1,154,732.20
LEG IMMOBILIEN SE	16,515	103.90	1,715,908.50
VONOVIA SE	167,735	42.80	7,179,058.00
ADYEN NV	4,461	1,822.80	8,131,510.80
AMADEUS IT GROUP SA	101,510	56.78	5,763,737.80
BECHTLE AG	16,599	51.52	855,180.48
CAPGEMINI SE	35,395	189.70	6,714,431.50
DASSAULT SYSTEMES SE	145,167	45.06	6,541,950.85
EDENRED	57,660	44.73	2,579,131.80
NEMETSCHEK SE	12,512	87.54	1,095,300.48
NEXI SPA	117,100	10.85	1,270,535.00
SAP SE	233,835	100.42	23,481,710.70
WORLDLINE SA	56,144	40.33	2,264,568.24
NOKIA OYJ	1,215,625	4.88	5,932,857.81
CELLNEX TELECOM SA	115,938	42.64	4,943,596.32
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	723,408	16.74	12,112,743.55
ELISA OYJ	29,011	53.48	1,551,508.28
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	71,656	9.84	705,668.28
KONINKLIJKE KPN NV	790,408	3.09	2,443,941.53

ORANGE	436,030	10.71	4,671,625.42	
PROXIMUS	45,806	17.36	795,421.19	
TELECOM ITALIA SPA	1,943,722	0.32	634,430.86	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	185,416	2.47	458,162.93	
TELEFONICA SA	1,166,389	4.20	4,902,332.96	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	18,896	31.29	591,255.84	
E.ON SE	509,624	10.36	5,282,762.38	
EDF	102,694	8.59	882,552.23	
EDP RENOVAVEIS SA	62,564	22.28	1,393,925.92	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	597,312	4.27	2,555,898.04	
ELIA GROUP SA/NV	5,662	130.40	738,324.80	
ENAGAS SA	58,025	20.03	1,162,240.75	
ENDESA SA	68,075	18.45	1,255,983.75	
ENEL SPA	1,820,333	5.77	10,503,321.41	
ENGIE	393,926	11.80	4,651,478.20	
FORTUM OYJ	109,087	16.70	1,822,298.33	
IBERDROLA SA	1,309,446	9.54	12,497,352.62	
NATURGY ENERGY GROUP SA	42,147	25.51	1,075,169.97	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	106,278	17.55	1,865,178.90	
RWE AG	147,036	37.55	5,521,201.80	
SNAM SPA	453,261	5.00	2,266,305.00	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	316,658	7.16	2,267,904.59	
UNIPER SE	24,220	23.95	580,069.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	142,863	27.97	3,995,878.11	
VERBUND AG	14,435	90.00	1,299,150.00	
ASM INTERNATIONAL NV	10,304	332.60	3,427,110.40	
ASML HOLDING NV	92,485	615.70	56,943,014.50	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	292,160	30.57	8,931,331.20	
STMICROELECTRONICS NV	150,733	39.89	6,013,493.03	
ユーロ 小計	40,855,769		1,003,388,958.32 (134,805,306,550)	
合 計	239,430,343		1,465,188,373,986 (1,465,188,373,986)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	33,543	6,435,895.41	
		AMERICAN TOWER CORP	101,873	23,990,072.77	

		AVALONBAY COMMUNITIES INC	31,150	7,575,680.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	32,691	4,122,988.92	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	22,261	3,646,574.41	
		CROWN CASTLE INTL CORP	96,661	16,945,639.91	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	64,257	8,844,976.05	
		DUKE REALTY CORP	88,130	4,943,211.70	
		EQUINIX INC	20,143	14,334,363.09	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	40,102	2,915,014.38	
		EQUITY RESIDENTIAL	79,621	7,014,610.10	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,244	4,787,123.52	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	30,623	5,967,197.78	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	122,587	4,138,537.12	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	153,054	2,862,109.80	
		INVITATION HOMES INC	131,641	5,277,487.69	
		IRON MOUNTAIN INC	62,756	3,294,062.44	
		KIMCO REALTY CORP	135,187	3,256,654.83	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	126,065	2,571,726.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,401	5,417,485.20	
		PROLOGIS INC	165,162	25,747,104.18	
		PUBLIC STORAGE	35,185	13,128,227.20	
		REALTY INCOME CORP	126,078	8,419,488.84	
		REGENCY CENTERS CORP	34,913	2,360,118.80	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	24,254	7,892,494.14	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	74,084	9,640,550.92	
		SUN COMMUNITIES INC	26,313	4,517,678.97	
		UDR INC	72,294	4,088,948.64	
		VENTAS INC	91,502	5,613,647.70	
		VICI PROPERTIES INC	136,092	3,693,536.88	
		VORNADO REALTY TRUST	33,946	1,541,487.86	
		WELLTOWER INC	97,262	9,206,820.92	
		WEYERHAEUSER CO	169,516	6,453,474.12	
		WP CAREY INC	41,405	3,321,095.05	
アメリカドル合計			2,540,996	243,966,085.34	
				(29,780,940,037)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,300	1,265,190.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	30,800	784,168.00	
カナダドル合計			54,100	2,049,358.00	
				(199,423,026)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	256,609	2,768,811.11	
		GOODMAN GROUP	377,593	8,582,688.89	
		GPT GROUP	401,511	1,983,464.34	
		MIRVAC GROUP	900,300	2,232,744.00	

		SCENTRE GROUP	1,107,864	3,378,985.20	
		STOCKLAND	543,065	2,248,289.10	
		VICINITY CENTRES	995,999	1,842,598.15	
オーストラリアドル合計			4,582,941	23,037,580.79 (2,110,472,776)	
イギリス ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	174,337	894,348.81	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	155,633	1,191,526.24	
		SEGRO PLC	260,851	3,367,586.41	
イギリスポンド合計			590,821	5,453,461.46 (877,680,087)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	462,600	30,786,030.00	
香港ドル合計			462,600	30,786,030.00 (480,262,068)	
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	742,800	2,161,548.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,054,771	2,320,496.20	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	383,600	728,840.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	704,700	1,303,695.00	
シンガポールドル合計			2,885,871	6,514,579.20 (586,051,544)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	13,302	918,104.04	
		GECINA SA	9,117	954,549.90	
		KLEPIERRE	53,185	1,208,895.05	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	27,221	1,666,197.41	
ユーロ合計			102,825	4,747,746.40 (637,859,728)	
合計				34,672,689,266 (34,672,689,266)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 608銘柄	97.32%	—	72.04%
	投資証券 34銘柄	—	2.68%	1.99%
カナダドル	株式 86銘柄	99.66%	—	3.84%
	投資証券 2銘柄	—	0.34%	0.01%
オーストラリアドル	株式 53銘柄	94.03%	—	2.22%
	投資証券 7銘柄	—	5.97%	0.14%
イギリスポンド	株式 78銘柄	98.64%	—	4.25%
	投資証券 3銘柄	—	1.36%	0.06%

スイスフラン	株式	41銘柄	100.00%	—	3.03%
香港ドル	株式	30銘柄	96.07%	—	0.78%
	投資証券	1銘柄	—	3.93%	0.03%
シンガポールドル	株式	14銘柄	88.91%	—	0.31%
	投資証券	4銘柄	—	11.09%	0.04%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.00%	—	0.06%
スウェーデンクローネ	株式	44銘柄	100.00%	—	1.05%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.00%	—	0.23%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.00%	—	0.76%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%	—	0.13%
ユーロ	株式	227銘柄	99.53%	—	8.99%
	投資証券	4銘柄	—	0.47%	0.04%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

国内債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 4年 3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,001,836,668
国債証券	190,405,501,050
地方債証券	14,226,321,300
特殊債券	9,960,747,709
社債券	13,066,105,000
未収入金	1,255,632,000
未収利息	180,811,837
前払金	2,140,000
前払費用	10,545,962
差入委託証拠金	1,260,000
流動資産合計	230,110,901,526
資産合計	230,110,901,526
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,462,200
未払解約金	1,281,067,329
未払利息	62
流動負債合計	1,283,529,591
負債合計	1,283,529,591
純資産の部	
元本等	

[令和 4年 3月25日現在]	
元本	238,082,798,205
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△9,255,426,270
元本等合計	228,827,371,935
純資産合計	228,827,371,935
負債純資産合計	230,110,901,526

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（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 3月25日現在]
1. 期首	令和 3年 3月26日
期首元本額	153,713,789,372円
期中追加設定元本額	247,643,156,668円
期中一部解約元本額	163,274,147,835円
元本の内訳※	
ファンド・マネジャー（国内債券）	39,220,690円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式抑制型）	11,558,041,964円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（株式重視型）	11,960,158,413円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,778,110,252円
三菱ＵＦＪ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	8,747,203,642円
三菱ＵＦＪ バランス・イノベーション（債券重視型）	7,064,084,125円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	28,948,603,853円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	10,558,769,918円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	27,911,301,518円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	1,848,409,515円
MUKAM 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	47,844,329,651円

	[令和 4年 3月25日現在]
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファン ド（適格機関投資家限定）	78,853,622,506円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格 機関投資家転売制限付）	970,942,158円
合計	238,082,798,205円
2. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	9,255,426,270円
3. 受益権の総数	238,082,798,205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 3月26日 至 令和 4年 3月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額は、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 3月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

区分	[令和 4年 3月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 4年 3月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△4,888,374,050
地方債証券	△136,983,950
特殊債券	△110,013,641
社債券	△108,939,900
合計	△5,244,311,541

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

[令和 4年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	301,420,000	—	298,960,000	△2,460,000
合計		301,420,000	—	298,960,000	△2,460,000

（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 3月25日現在]
1口当たり純資産額	0.9611円
(1万口当たり純資産額)	(9,611円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第４２３回利付国債（２年）	1,630,000,000	1,631,141,000	
	第４２４回利付国債（２年）	400,000,000	400,304,000	
	第４２５回利付国債（２年）	2,280,000,000	2,281,869,600	
	第４２６回利付国債（２年）	1,110,000,000	1,110,976,800	
	第４２７回利付国債（２年）	950,000,000	950,826,500	
	第４２８回利付国債（２年）	1,280,000,000	1,281,088,000	
	第４３０回利付国債（２年）	1,200,000,000	1,201,044,000	
	第４３１回利付国債（２年）	1,950,000,000	1,951,638,000	
	第４３２回利付国債（２年）	1,090,000,000	1,090,861,100	
	第１３６回利付国債（５年）	860,000,000	861,745,800	
	第１３７回利付国債（５年）	1,450,000,000	1,453,219,000	
	第１３８回利付国債（５年）	3,170,000,000	3,177,386,100	
	第１３９回利付国債（５年）	1,020,000,000	1,022,621,400	
	第１４０回利付国債（５年）	2,940,000,000	2,948,526,000	
	第１４１回利付国債（５年）	2,050,000,000	2,056,355,000	
	第１４２回利付国債（５年）	2,023,000,000	2,029,615,210	
	第１４３回利付国債（５年）	2,740,000,000	2,749,370,800	
	第１４４回利付国債（５年）	2,120,000,000	2,127,186,800	
	第１４５回利付国債（５年）	3,200,000,000	3,210,560,000	
	第１４６回利付国債（５年）	3,010,000,000	3,020,083,500	
	第１４７回利付国債（５年）	1,650,000,000	1,649,010,000	
	第１４８回利付国債（５年）	620,000,000	619,473,000	
	第１４９回利付国債（５年）	2,560,000,000	2,556,544,000	
	第１５０回利付国債（５年）	2,110,000,000	2,106,012,100	

第1回利付国債（40年）	530,000,000	717,010,500	
第2回利付国債（40年）	590,000,000	771,566,600	
第3回利付国債（40年）	270,000,000	354,790,800	
第4回利付国債（40年）	630,000,000	832,589,100	
第5回利付国債（40年）	410,000,000	523,266,600	
第6回利付国債（40年）	351,000,000	441,371,970	
第7回利付国債（40年）	570,000,000	689,221,200	
第8回利付国債（40年）	530,000,000	598,910,600	
第9回利付国債（40年）	870,000,000	732,966,300	
第10回利付国債（40年）	770,000,000	759,889,900	
第11回利付国債（40年）	750,000,000	716,947,500	
第12回利付国債（40年）	591,000,000	509,164,230	
第13回利付国債（40年）	650,000,000	557,472,500	
第14回利付国債（40年）	960,000,000	880,454,400	
第329回利付国債（10年）	400,000,000	404,256,000	
第330回利付国債（10年）	200,000,000	202,520,000	
第331回利付国債（10年）	300,000,000	302,892,000	
第332回利付国債（10年）	100,000,000	101,100,000	
第333回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,417,444,000	
第335回利付国債（10年）	370,000,000	374,821,100	
第336回利付国債（10年）	600,000,000	608,526,000	
第338回利付国債（10年）	400,000,000	404,944,000	
第339回利付国債（10年）	1,230,000,000	1,246,088,400	
第340回利付国債（10年）	750,000,000	760,312,500	
第341回利付国債（10年）	300,000,000	303,243,000	
第342回利付国債（10年）	110,000,000	110,348,700	
第343回利付国債（10年）	1,840,000,000	1,845,814,400	
第344回利付国債（10年）	2,110,000,000	2,116,119,000	
第345回利付国債（10年）	2,200,000,000	2,205,698,000	
第346回利付国債（10年）	1,750,000,000	1,753,902,500	
第347回利付国債（10年）	1,450,000,000	1,452,639,000	
第348回利付国債（10年）	2,360,000,000	2,363,209,600	
第349回利付国債（10年）	1,920,000,000	1,922,188,800	
第350回利付国債（10年）	2,440,000,000	2,441,439,600	
第351回利付国債（10年）	2,070,000,000	2,070,621,000	
第352回利付国債（10年）	2,450,000,000	2,449,191,500	
第353回利付国債（10年）	1,193,000,000	1,192,200,690	
第354回利付国債（10年）	2,090,000,000	2,087,094,900	
第355回利付国債（10年）	1,220,000,000	1,216,937,800	
第356回利付国債（10年）	1,780,000,000	1,774,054,800	
第357回利付国債（10年）	2,160,000,000	2,150,906,400	
第358回利付国債（10年）	1,940,000,000	1,930,067,200	

第359回利付国債（10年）	2,400,000,000	2,385,384,000	
第360回利付国債（10年）	2,320,000,000	2,303,528,000	
第361回利付国債（10年）	2,010,000,000	1,993,598,400	
第362回利付国債（10年）	2,110,000,000	2,090,461,400	
第363回利付国債（10年）	1,890,000,000	1,870,325,100	
第364回利付国債（10年）	2,060,000,000	2,036,083,400	
第365回利付国債（10年）	1,580,000,000	1,559,697,000	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	59,007,000	
第7回利付国債（30年）	50,000,000	60,231,000	
第10回利付国債（30年）	50,000,000	54,280,000	
第12回利付国債（30年）	100,000,000	119,846,000	
第14回利付国債（30年）	190,000,000	235,182,000	
第15回利付国債（30年）	100,000,000	125,288,000	
第16回利付国債（30年）	100,000,000	125,563,000	
第17回利付国債（30年）	250,000,000	311,705,000	
第18回利付国債（30年）	100,000,000	123,670,000	
第19回利付国債（30年）	100,000,000	123,951,000	
第20回利付国債（30年）	100,000,000	126,782,000	
第21回利付国債（30年）	100,000,000	124,488,000	
第22回利付国債（30年）	280,000,000	356,658,400	
第23回利付国債（30年）	400,000,000	510,688,000	
第24回利付国債（30年）	100,000,000	127,959,000	
第25回利付国債（30年）	410,000,000	514,078,500	
第26回利付国債（30年）	300,000,000	381,018,000	
第27回利付国債（30年）	100,000,000	128,924,000	
第28回利付国債（30年）	550,000,000	711,700,000	
第29回利付国債（30年）	370,000,000	474,517,600	
第30回利付国債（30年）	610,000,000	775,157,500	
第31回利付国債（30年）	100,000,000	125,713,000	
第32回利付国債（30年）	330,000,000	421,033,800	
第33回利付国債（30年）	960,000,000	1,178,697,600	
第34回利付国債（30年）	650,000,000	822,984,500	
第35回利付国債（30年）	500,000,000	616,190,000	
第36回利付国債（30年）	650,000,000	803,023,000	
第37回利付国債（30年）	620,000,000	755,984,600	
第38回利付国債（30年）	690,000,000	829,593,900	
第39回利付国債（30年）	460,000,000	562,543,200	
第40回利付国債（30年）	471,000,000	567,220,590	
第41回利付国債（30年）	300,000,000	355,578,000	
第42回利付国債（30年）	620,000,000	735,289,000	
第43回利付国債（30年）	470,000,000	557,730,200	
第44回利付国債（30年）	590,000,000	700,524,700	

第４５回利付国債（３０年）	400,000,000	458,704,000	
第４６回利付国債（３０年）	670,000,000	768,490,000	
第４７回利付国債（３０年）	650,000,000	759,297,500	
第４８回利付国債（３０年）	716,000,000	805,700,480	
第４９回利付国債（３０年）	540,000,000	607,651,200	
第５０回利付国債（３０年）	540,000,000	537,294,600	
第５１回利付国債（３０年）	720,000,000	636,595,200	
第５２回利付国債（３０年）	600,000,000	555,750,000	
第５３回利付国債（３０年）	750,000,000	709,507,500	
第５４回利付国債（３０年）	430,000,000	425,128,100	
第５５回利付国債（３０年）	470,000,000	464,153,200	
第５６回利付国債（３０年）	750,000,000	739,042,500	
第５７回利付国債（３０年）	300,000,000	294,963,000	
第５８回利付国債（３０年）	710,000,000	697,248,400	
第５９回利付国債（３０年）	470,000,000	449,573,800	
第６０回利付国債（３０年）	660,000,000	660,706,200	
第６１回利付国債（３０年）	338,000,000	321,698,260	
第６２回利付国債（３０年）	370,000,000	333,884,300	
第６３回利付国債（３０年）	350,000,000	306,365,500	
第６４回利付国債（３０年）	550,000,000	480,408,500	
第６５回利付国債（３０年）	690,000,000	601,417,800	
第６６回利付国債（３０年）	300,000,000	261,504,000	
第６７回利付国債（３０年）	970,000,000	890,460,000	
第６８回利付国債（３０年）	300,000,000	275,226,000	
第６９回利付国債（３０年）	400,000,000	377,000,000	
第７０回利付国債（３０年）	650,000,000	611,682,500	
第７１回利付国債（３０年）	460,000,000	432,699,000	
第７２回利付国債（３０年）	690,000,000	648,027,300	
第７３回利付国債（３０年）	470,000,000	441,221,900	
第６３回利付国債（２０年）	100,000,000	102,296,000	
第６４回利付国債（２０年）	100,000,000	102,892,000	
第６５回利付国債（２０年）	270,000,000	279,050,400	
第６６回利付国債（２０年）	430,000,000	443,669,700	
第６８回利付国債（２０年）	200,000,000	208,826,000	
第７０回利付国債（２０年）	50,000,000	52,711,000	
第７２回利付国債（２０年）	100,000,000	105,277,000	
第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	106,301,000	
第７７回利付国債（２０年）	150,000,000	159,004,500	
第７８回利付国債（２０年）	100,000,000	106,154,000	
第８０回利付国債（２０年）	100,000,000	106,800,000	
第８１回利付国債（２０年）	100,000,000	106,945,000	
第８３回利付国債（２０年）	200,000,000	215,590,000	

第84回利付国債（20年）	200,000,000	214,844,000	
第86回利付国債（20年）	140,000,000	152,686,800	
第89回利付国債（20年）	200,000,000	218,380,000	
第90回利付国債（20年）	300,000,000	329,064,000	
第92回利付国債（20年）	300,000,000	329,106,000	
第93回利付国債（20年）	50,000,000	54,827,500	
第94回利付国債（20年）	60,000,000	66,091,200	
第95回利付国債（20年）	400,000,000	446,596,000	
第96回利付国債（20年）	100,000,000	110,607,000	
第97回利付国債（20年）	100,000,000	111,601,000	
第98回利付国債（20年）	200,000,000	222,110,000	
第99回利付国債（20年）	300,000,000	334,668,000	
第100回利付国債（20年）	50,000,000	56,289,500	
第101回利付国債（20年）	200,000,000	227,538,000	
第102回利付国債（20年）	200,000,000	228,622,000	
第103回利付国債（20年）	200,000,000	227,382,000	
第105回利付国債（20年）	90,000,000	101,592,000	
第106回利付国債（20年）	140,000,000	158,933,600	
第107回利付国債（20年）	100,000,000	113,335,000	
第108回利付国債（20年）	300,000,000	335,994,000	
第109回利付国債（20年）	300,000,000	337,068,000	
第110回利付国債（20年）	100,000,000	113,741,000	
第111回利付国債（20年）	40,000,000	45,947,200	
第112回利付国債（20年）	500,000,000	570,755,000	
第113回利付国債（20年）	620,000,000	710,241,000	
第114回利付国債（20年）	100,000,000	114,947,000	
第115回利付国債（20年）	100,000,000	115,712,000	
第116回利付国債（20年）	150,000,000	174,172,500	
第117回利付国債（20年）	700,000,000	807,289,000	
第118回利付国債（20年）	350,000,000	402,146,500	
第119回利付国債（20年）	100,000,000	113,275,000	
第120回利付国債（20年）	250,000,000	279,130,000	
第121回利付国債（20年）	230,000,000	263,159,100	
第122回利付国債（20年）	160,000,000	181,729,600	
第123回利付国債（20年）	180,000,000	209,709,000	
第124回利付国債（20年）	400,000,000	462,580,000	
第125回利付国債（20年）	510,000,000	600,489,300	
第126回利付国債（20年）	110,000,000	127,574,700	
第127回利付国債（20年）	40,000,000	46,038,000	
第128回利付国債（20年）	190,000,000	219,271,400	
第129回利付国債（20年）	490,000,000	561,050,000	
第130回利付国債（20年）	180,000,000	206,607,600	

第131回利付国債（20年）	540,000,000	614,800,800	
第132回利付国債（20年）	290,000,000	330,890,000	
第133回利付国債（20年）	702,000,000	807,672,060	
第134回利付国債（20年）	530,000,000	611,164,200	
第135回利付国債（20年）	100,000,000	114,338,000	
第136回利付国債（20年）	470,000,000	532,806,100	
第137回利付国債（20年）	600,000,000	687,120,000	
第138回利付国債（20年）	70,000,000	78,766,800	
第139回利付国債（20年）	580,000,000	658,427,600	
第140回利付国債（20年）	730,000,000	837,258,900	
第141回利付国債（20年）	440,000,000	505,357,600	
第142回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,193,728,800	
第143回利付国債（20年）	450,000,000	512,716,500	
第144回利付国債（20年）	580,000,000	654,663,400	
第145回利付国債（20年）	1,134,000,000	1,306,470,060	
第146回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,257,282,300	
第147回利付国債（20年）	1,210,000,000	1,383,550,300	
第148回利付国債（20年）	950,000,000	1,076,207,500	
第149回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,462,266,600	
第150回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,279,330,800	
第151回利付国債（20年）	980,000,000	1,076,275,200	
第152回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,174,881,400	
第153回利付国債（20年）	1,080,000,000	1,199,869,200	
第154回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,339,706,400	
第155回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,136,129,200	
第156回利付国債（20年）	1,102,000,000	1,091,156,320	
第157回利付国債（20年）	830,000,000	797,447,400	
第158回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,090,730,300	
第159回利付国債（20年）	810,000,000	820,546,200	
第160回利付国債（20年）	880,000,000	902,633,600	
第161回利付国債（20年）	830,000,000	838,183,800	
第162回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,239,655,500	
第163回利付国債（20年）	920,000,000	925,989,200	
第164回利付国債（20年）	874,000,000	864,403,480	
第165回利付国債（20年）	790,000,000	780,046,000	
第166回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,067,346,000	
第167回利付国債（20年）	710,000,000	698,135,900	
第168回利付国債（20年）	660,000,000	636,715,200	
第169回利付国債（20年）	980,000,000	927,570,000	
第170回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,217,205,300	
第171回利付国債（20年）	710,000,000	667,833,100	
第172回利付国債（20年）	840,000,000	802,317,600	

	第173回利付国債（20年）	1,130,000,000	1,076,923,900	
	第174回利付国債（20年）	540,000,000	513,486,000	
	第175回利付国債（20年）	980,000,000	946,748,600	
	第176回利付国債（20年）	800,000,000	771,256,000	
	第177回利付国債（20年）	890,000,000	840,471,500	
	第178回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,172,139,400	
	第179回利付国債（20年）	950,000,000	911,525,000	
国債証券 合計		183,995,000,000	190,405,501,050	
地方債証券	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,809,000	
	第7回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,290,000	
	第8回東京都公募公債（30年）	80,000,000	99,510,400	
	第14回東京都公募公債（20年）	200,000,000	225,200,000	
	第31回東京都公募公債（5年）	100,000,000	99,919,000	
	第721回東京都公募公債	100,000,000	101,021,000	
	第725回東京都公募公債	250,000,000	252,385,000	
	第732回東京都公募公債	100,000,000	101,362,000	
	第792回東京都公募公債	100,000,000	98,863,000	
	平成30年度第19回北海道公募公債（5年）	300,000,000	299,871,000	
	第14回1号宮城県公募公債（5年）	200,000,000	200,046,000	
	第1回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	125,894,000	
	第12回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	114,397,000	
	第26回神奈川県公募公債（20年）	20,000,000	22,432,800	
	第86回神奈川県公募公債（5年）	300,000,000	299,106,000	
	第211回神奈川県公募公債	200,000,000	202,122,000	
	第8回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	228,762,000	
	第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	114,158,000	
	第153回大阪府公募公債（5年）	500,000,000	499,890,000	
	第171回大阪府公募公債（5年）	200,000,000	199,656,000	
	第176回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,752,000	
	第378回大阪府公募公債	200,000,000	202,252,000	
	第383回大阪府公募公債	300,000,000	304,092,000	
	第388回大阪府公募公債	200,000,000	202,476,000	
	第391回大阪府公募公債	300,000,000	303,819,000	
	第401回大阪府公募公債	200,000,000	202,920,000	
	第451回大阪府公募公債	152,000,000	149,662,240	
	第466回大阪府公募公債	137,000,000	135,391,620	
	第467回大阪府公募公債	200,000,000	197,456,000	
	第471回大阪府公募公債	200,000,000	195,730,000	
	平成30年度第12回京都府公募公債（5年）	100,000,000	99,958,000	
	第2回兵庫県公募公債（30年）	100,000,000	127,681,000	
	第9回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	230,230,000	
	第11回静岡県公募公債（20年）	200,000,000	226,226,000	

平成26年度第3回静岡県公募公債	500,000,000	506,975,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,360,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債（5年）	10,000,000	10,002,400	
令和2年度第7回静岡県公募公債（5年）	200,000,000	199,740,000	
令和2年度第12回静岡県公募公債（5年）	320,000,000	319,222,400	
平成20年度第2回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	114,034,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	200,000,000	229,286,000	
平成23年度第13回愛知県公募公債	200,000,000	213,146,000	
平成26年度第10回愛知県公募公債	300,000,000	304,089,000	
平成27年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,548,000	
平成26年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,213,000	
平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	100,088,000	
第9回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	230,234,000	
平成26年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,810,000	
平成30年度第8回埼玉県公募公債	300,000,000	298,791,000	
令和2年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	98,652,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,177,000	
平成30年度第3回茨城県公募公債（5年）	600,000,000	600,156,000	
第126回共同発行市場公募地方債	320,000,000	323,801,600	
第136回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,987,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,530,000	
第138回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,810,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,226,000	
平成28年度第2回島根県公募公債（20年）	100,000,000	99,200,000	
令和3年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	98,354,000	
平成27年度第1回新潟市公募公債	10,000,000	10,145,400	
平成26年度第5回大阪市公募公債	200,000,000	202,742,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	125,446,000	
第3回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	106,384,000	
第490回名古屋市公募公債	120,000,000	121,568,400	
第7回京都市公募公債（20年）	200,000,000	228,030,000	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	112,477,000	
平成26年度第4回神戸市公募公債	300,000,000	303,918,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	101,557,000	
平成27年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	304,446,000	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	115,028,000	
平成26年度第5回札幌市公募公債	100,000,000	105,384,000	
第9回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	115,117,000	
第50回川崎市公募公債（5年）	15,000,000	14,999,550	
平成26年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	110,960,000	
2021年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	98,368,000	
平成30年度第3回千葉市公募公債	10,000,000	10,039,200	

	令和３年度第１回和歌山県公募公債	100,000,000	98,353,000	
	平成２５年度第１回徳島県公募公債	103,000,000	104,074,290	
	令和２年度第１回山梨県公募公債	300,000,000	296,214,000	
	平成２５年度第１回岡山県公募公債	100,000,000	101,325,000	
	第１３２回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	100,973,000	
地方債証券 合計		13,747,000,000	14,226,321,300	
特殊債券	第３回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	101,415,000	
	第１６回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	300,000,000	299,982,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,736,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	109,389,000	
	第２７回道路債券（財投機関債）	150,000,000	157,098,000	
	第３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	113,799,000	
	第４２回道路債券（財投機関債）	110,000,000	117,106,000	
	第５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	57,369,500	
	第７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,418,000	
	第１４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,323,000	
	第１５０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	107,445,000	
	第１６５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,232,000	
	第１８８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,150,000	
	第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	210,531,970	
	第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	344,300,000	348,211,248	
	第１９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	126,000,000	127,535,940	
	第２２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,313,000	
	第２３１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,272,000	
	第３０３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	106,364,640	
	第３５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,903,000	
	第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	114,240,000	
	第１１回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	113,096,000	
	第２４回公営企業債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	112,567,000	
	第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）（財投機関債）	100,000,000	113,595,000	
	第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	229,000,000	230,367,130	

F 5 4 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,076,000	
第 6 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,388,000	
第 6 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,350,000	
第 7 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	13,000,000	13,159,250	
F 8 9 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	107,739,000	
第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,117,000	
F 1 0 1 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,305,000	
F 1 2 2 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	213,160,000	
F 1 4 9 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,987,000	
第 1 7 回政府保証民間都市開発債券	200,000,000	200,704,000	
第 1 1 回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	109,872,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	49,653,000	49,438,002	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,506,000	38,646,346	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,862,000	20,999,897	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,478,000	22,555,980	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,290,000	64,290,758	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,251,000	40,683,268	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	92,600,000	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,800,000	110,426,928	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,016,000	149,923,341	
第 8 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,964,000	173,520,249	
第 8 4 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,387,000	
第 9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,948,000	105,964,946	
第 1 0 2 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,466,000	
第 1 0 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,581,000	65,095,499	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	227,583,000	226,686,322	
第 1 2 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,284,000	76,950,905	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,320,000	157,694,636	
第 1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,482,000	161,541,229	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,722,000	82,200,851	
第 1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,926,000	83,657,436	
第 1 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,783,000	85,633,125	
第 1 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,730,000	269,309,965	
第 1 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,932,000	179,719,706	
第 1 6 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,670,000	94,563,098	
第 1 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,075,000	96,114,928	
第 1 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,163,000	96,482,449	
第 1 7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,421,000	97,881,962	
第 1 7 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,828,000	98,954,505	

	第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,915,000	
	第１７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,859,000	
	第２５６回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,978,000	
	い第８１７号商工債券	110,000,000	110,130,900	
	い第８３２号商工債券	100,000,000	99,847,000	
	い第８５２号商工債券	200,000,000	199,130,000	
	い第８２５号農林債券	100,000,000	99,979,000	
	第３７４回信金中金債	100,000,000	99,655,000	
	第１１号商工債券（１０年）	100,000,000	101,350,000	
	第２４８号商工債券（３年）	100,000,000	99,970,000	
	第３４回国際協力機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,619,000	
	第８３回東日本高速道路	200,000,000	199,324,000	
	第８４回中日本高速道路	100,000,000	99,950,000	
	第２５回西日本高速道路	100,000,000	101,227,000	
	第２６回西日本高速道路	100,000,000	101,649,000	
	第３０回西日本高速道路	130,000,000	130,241,800	
	第６１回西日本高速道路	400,000,000	398,480,000	
	第７２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,737,000	
特殊債券 合計		9,698,568,000	9,960,747,709	
社債券	第１９回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	102,016,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,617,000	
	第３５回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	98,924,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	99,935,000	
	第４回フランス預金供託公庫	100,000,000	101,132,000	
	第１回サンタンデル銀行（２０１９）	100,000,000	99,733,000	
	第１２回新関西国際空港	100,000,000	105,814,000	
	第２１回新関西国際空港	100,000,000	98,902,000	
	第２０回成田国際空港	100,000,000	99,824,000	
	第２４回成田国際空港	100,000,000	100,283,000	
	第２９回成田国際空港	100,000,000	100,577,000	
	第１回国際石油開発帝石	400,000,000	398,328,000	
	第２回国際石油開発帝石	100,000,000	99,217,000	
	第１６回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,348,000	
	第５回サントリー食品インターナショナル	100,000,000	99,589,000	
	第３回 キューピー	100,000,000	99,670,000	
	第１３回日本たばこ産業	100,000,000	99,594,000	
	第９回ヒューリック	100,000,000	98,805,000	
	第１４回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	99,850,000	
	第９回クラレ	100,000,000	100,000,000	
	第１６回旭化成	100,000,000	99,678,000	
	第４２回王子ホールディングス	100,000,000	99,402,000	

第4回電通グループ	300,000,000	299,661,000	
第19回オリエンタルランド	100,000,000	99,696,000	
第4回新日本製鐵	100,000,000	99,796,000	
第7回ジェイテクト	100,000,000	98,890,000	
第36回三菱重工業（グリーン）	300,000,000	298,857,000	
第18回JA三井リース	100,000,000	99,331,000	
第19回JA三井リース	300,000,000	296,949,000	
第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）	400,000,000	398,256,000	
第1回明治安田生命2018基金	200,000,000	199,874,000	
第1回明治安田生命2019基金	100,000,000	99,798,000	
第63回三井物産	100,000,000	110,247,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	100,784,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	99,415,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	299,661,000	
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	700,000,000	697,424,000	
第34回東京センチュリー	100,000,000	98,231,000	
第65回ホンダファイナンス	100,000,000	99,810,000	
第70回ホンダファイナンス	100,000,000	99,703,000	
第72回ホンダファイナンス	100,000,000	99,687,000	
第41回リコーリース	100,000,000	99,293,000	
第79回アコム	100,000,000	99,973,000	
第80回アコム	100,000,000	99,687,000	
第61回日立キャピタル	200,000,000	199,944,000	
第87回日立キャピタル	100,000,000	99,814,000	
第201回オリックス	100,000,000	99,069,000	
第16回三井住友ファイナンス&リース	200,000,000	200,242,000	
第30回三井住友ファイナンス&リース	200,000,000	199,664,000	
第1回三菱HCキャピタル	200,000,000	199,146,000	
第137回三菱地所	100,000,000	99,944,000	
第78回東京急行電鉄	200,000,000	213,776,000	
第57回東日本旅客鉄道	100,000,000	113,645,000	
第147回東日本旅客鉄道	100,000,000	99,252,000	
第163回東日本旅客鉄道	200,000,000	198,672,000	
第174回東日本旅客鉄道	300,000,000	298,863,000	
第42回東海旅客鉄道	100,000,000	113,721,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	111,787,000	
第73回東海旅客鉄道	100,000,000	104,903,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	100,000,000	99,374,000	
第64回名古屋鉄道	100,000,000	99,206,000	
第9回九州旅客鉄道	100,000,000	99,719,000	
第9回関西高速鉄道	200,000,000	201,952,000	
第503回中部電力	10,000,000	10,116,000	

第５００回関西電力	100,000,000	100,748,000	
第５０６回関西電力	200,000,000	200,224,000	
第５０８回関西電力	200,000,000	200,846,000	
第５１０回関西電力	100,000,000	100,564,000	
第５１５回関西電力	200,000,000	200,176,000	
第５３０回関西電力	200,000,000	198,876,000	
第３２２回北陸電力	100,000,000	100,101,000	
第５２５回東北電力	100,000,000	99,124,000	
第３０７回四国電力	200,000,000	196,586,000	
第４３７回九州電力	100,000,000	101,593,000	
第４４９回九州電力	300,000,000	300,969,000	
第４７６回九州電力	100,000,000	99,617,000	
第４８４回九州電力	100,000,000	99,038,000	
第４９３回九州電力	400,000,000	397,032,000	
第３２５回北海道電力	100,000,000	106,116,000	
第３５７回北海道電力	100,000,000	99,963,000	
第１３回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,742,000	
第１４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,223,000	
第１８回東京電力パワーグリッド	300,000,000	302,838,000	
第３１回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,300,000	
第３４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,052,000	
第３８回東京電力パワーグリッド	200,000,000	201,080,000	
第４４回東京電力パワーグリッド	100,000,000	99,755,000	
第１３回広島ガス	100,000,000	99,472,000	
社債券 合計	13,010,000,000	13,066,105,000	
合計	220,450,568,000	227,658,675,059	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 4年 3月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	376,259,287

[令和 4年 3月25日現在]

コール・ローン	2,253,597,516
国債証券	275,528,375,909
派生商品評価勘定	165,956
未収入金	403,488,408
未収利息	1,833,252,912
前払費用	96,701,034
流動資産合計	280,491,841,022
資産合計	280,491,841,022
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,227,167,447
未払金	353,899,860
未払解約金	514,454,549
未払利息	140
流動負債合計	15,095,521,996
負債合計	15,095,521,996
純資産の部	
元本等	
元本	205,868,338,141
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	59,527,980,885
元本等合計	265,396,319,026
純資産合計	265,396,319,026
負債純資産合計	280,491,841,022

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(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 3月25日現在]
1. 期首	令和 3年 3月26日
期首元本額	189,589,551,791円
期中追加設定元本額	39,185,732,446円
期中一部解約元本額	22,906,946,096円

	[令和 4年 3月25日現在]
元本の内訳※	
eMAXIS 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	181,113,603円
ラップ向けインデックスf 先進国債券（為替ヘッジあり）	734,883円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	4,168,121,012円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	4,322,449,818円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	1,313,603,073円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	3,181,937,045円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	2,525,439,986円
eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）	70,587,577円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）	116,637,757,989円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	10,230,200,924円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	10,563,873,252円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	3,891,957,980円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	1,386,856,070円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	9,717,490,198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）	664,417,640円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	10,588,210,670円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）	8,061,347,461円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	1,299,676,485円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	352,774,436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）	3,712,874円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	2,228,340,024円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）	312,015,642円
MUKAM バランスファンド2020-04（適格機関投資家限定）	2,277,992,239円
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	2,213,256,791円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）	311,241,135円
MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	2,206,893,460円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）	311,484,137円

	[令和 4年 3月25日現在]
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）	312,660,303円
MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）	2,165,159,543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）	318,320,078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）	319,596,394円
MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）	2,116,614,767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）	314,518,867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）	314,267,273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）	320,515,630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）	326,476,715円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）	336,722,167円
合計	205,868,338,141円
2. 受益権の総数	205,868,338,141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 3月26日 至 令和 4年 3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

区分	自 令和 3年 3月26日 至 令和 4年 3月25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 3月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 3月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△13,307,552,777
合計	△13,307,552,777

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[令和 4年 3月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	イギリスポンド	22,363,880	—	22,529,836	165,956
	売建				
	アメリカドル	130,875,738,840	—	138,369,978,012	△7,494,239,172
	カナダドル	5,622,327,911	—	6,064,759,368	△442,431,457
	オーストラリアドル	4,375,326,222	—	4,831,136,946	△455,810,724
	イギリスポンド	15,140,331,876	—	15,798,172,041	△657,840,165
	シンガポールドル	1,151,180,268	—	1,219,425,036	△68,244,768
	マレーシアリンギット	1,504,380,780	—	1,585,962,180	△81,581,400
	スウェーデンクローネ	745,212,600	—	801,483,000	△56,270,400
	ノルウェークローネ	717,728,350	—	785,971,465	△68,243,115
	デンマーククローネ	1,222,734,240	—	1,274,313,600	△51,579,360
	メキシコペソ	2,084,323,696	—	2,262,151,864	△177,828,168
	イスラエルシェケル	1,246,653,420	—	1,338,242,556	△91,589,136
	ポーランドズロチ	1,198,617,224	—	1,231,876,604	△33,259,380
	中国元	3,123,434,724	—	3,279,023,388	△155,588,664
	ユーロ	103,184,805,533	—	107,577,467,071	△4,392,661,538
合計		272,215,159,564	—	286,442,492,967	△14,227,001,491

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[令和 4年 3月25日現在]
1口当たり純資産額	1.2892円

	[令和 4年 3月25日現在]
(1万口当たり純資産額)	(12,892円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ ドル	国債証券	0.125 T-NOTE 230430	4,300,000.00	4,227,269.52	
		0.125 T-NOTE 230515	9,500,000.00	9,331,894.52	
		0.125 T-NOTE 230815	9,500,000.00	9,272,148.43	
		0.125 T-NOTE 240115	9,300,000.00	8,959,968.75	
		0.125 T-NOTE 240215	8,800,000.00	8,465,875.00	
		0.25 T-NOTE 231115	6,500,000.00	6,306,523.43	
		0.25 T-NOTE 240615	6,500,000.00	6,223,750.00	
		0.25 T-NOTE 250531	3,700,000.00	3,459,789.06	
		0.25 T-NOTE 250930	7,900,000.00	7,327,867.18	
		0.375 T-NOTE 240415	11,500,000.00	11,091,210.93	
		0.375 T-NOTE 240815	9,000,000.00	8,602,031.25	
		0.375 T-NOTE 240915	14,100,000.00	13,445,121.08	
		0.375 T-NOTE 251231	9,000,000.00	8,343,984.37	
		0.375 T-NOTE 260131	9,600,000.00	8,879,250.00	
		0.5 T-NOTE 270630	8,000,000.00	7,260,312.49	
		0.5 T-NOTE 270831	8,550,000.00	7,735,746.09	
		0.625 T-NOTE 241015	9,500,000.00	9,102,558.58	
		0.625 T-NOTE 260731	11,200,000.00	10,365,250.00	
		0.625 T-NOTE 270331	3,750,000.00	3,442,089.83	
		0.625 T-NOTE 271231	13,680,000.00	12,372,384.36	
		0.625 T-NOTE 300515	10,220,000.00	8,907,368.75	
		0.625 T-NOTE 300815	12,900,000.00	11,197,804.68	
		0.75 T-NOTE 241115	5,600,000.00	5,372,281.24	
		0.75 T-NOTE 260331	9,300,000.00	8,704,218.75	
		0.75 T-NOTE 260531	10,400,000.00	9,710,187.50	
		0.875 T-NOTE 260630	10,900,000.00	10,213,640.62	
		0.875 T-NOTE 301115	13,150,000.00	11,633,640.62	
		1 T-NOTE 241215	7,500,000.00	7,235,742.18	

1.125 T-BOND 400515	8,150,000.00	6,395,203.12	
1.125 T-NOTE 250115	8,300,000.00	8,024,089.83	
1.125 T-NOTE 280831	10,000,000.00	9,233,203.12	
1.125 T-NOTE 310215	13,490,000.00	12,183,156.25	
1.25 T-BOND 500515	6,500,000.00	4,795,273.43	
1.25 T-NOTE 280331	12,590,000.00	11,776,076.15	
1.25 T-NOTE 280630	13,200,000.00	12,306,937.50	
1.25 T-NOTE 310815	8,860,000.00	8,039,065.61	
1.375 T-BOND 500815	10,240,000.00	7,794,400.00	
1.375 T-NOTE 230630	4,100,000.00	4,080,781.25	
1.375 T-NOTE 230831	7,700,000.00	7,642,851.56	
1.375 T-NOTE 230930	7,000,000.00	6,941,484.37	
1.375 T-NOTE 260831	3,400,000.00	3,251,250.00	
1.375 T-NOTE 281031	3,270,000.00	3,062,814.82	
1.375 T-NOTE 311115	11,030,000.00	10,100,205.44	
1.5 T-NOTE 241031	6,000,000.00	5,875,781.25	
1.5 T-NOTE 250215	4,300,000.00	4,197,707.02	
1.5 T-NOTE 260815	8,800,000.00	8,467,250.00	
1.5 T-NOTE 270131	6,700,000.00	6,421,531.25	
1.5 T-NOTE 281130	7,700,000.00	7,265,972.65	
1.5 T-NOTE 300215	7,800,000.00	7,314,937.50	
1.625 T-NOTE 230531	4,900,000.00	4,894,257.81	
1.625 T-NOTE 231031	6,700,000.00	6,656,554.68	
1.625 T-NOTE 260215	9,400,000.00	9,121,671.87	
1.625 T-NOTE 260515	9,200,000.00	8,913,218.75	
1.625 T-NOTE 260930	6,950,000.00	6,718,152.34	
1.625 T-NOTE 261031	7,400,000.00	7,149,671.87	
1.625 T-NOTE 261130	7,700,000.00	7,441,929.68	
1.625 T-NOTE 290815	7,200,000.00	6,836,062.50	
1.625 T-NOTE 310515	12,730,000.00	11,983,107.02	
1.75 T-BOND 410815	2,850,000.00	2,461,242.18	
1.75 T-NOTE 230515	4,000,000.00	4,002,031.24	
1.75 T-NOTE 240630	9,850,000.00	9,736,878.90	
1.75 T-NOTE 240731	6,800,000.00	6,717,656.25	
1.75 T-NOTE 261231	6,800,000.00	6,601,843.75	
1.75 T-NOTE 290131	9,100,000.00	8,727,824.21	
1.875 T-BOND 410215	7,120,000.00	6,315,384.37	
1.875 T-BOND 511115	3,500,000.00	3,027,773.43	
2 T-BOND 500215	5,950,000.00	5,298,056.63	
2 T-BOND 510815	5,400,000.00	4,807,265.62	
2 T-NOTE 240430	5,700,000.00	5,675,507.81	
2 T-NOTE 240531	11,260,000.00	11,202,820.31	

2 T-NOTE 250215	4,800,000.00	4,752,375.00
2 T-NOTE 250815	12,150,000.00	11,986,734.37
2 T-NOTE 261115	11,100,000.00	10,897,945.31
2.125 T-NOTE 231130	7,700,000.00	7,706,015.62
2.125 T-NOTE 240229	8,700,000.00	8,689,804.68
2.125 T-NOTE 241130	4,000,000.00	3,977,187.50
2.125 T-NOTE 250515	1,000,000.00	992,460.93
2.25 T-BOND 410515	3,350,000.00	3,153,187.50
2.25 T-BOND 460815	5,330,000.00	4,951,903.12
2.25 T-NOTE 231231	8,800,000.00	8,824,062.50
2.25 T-NOTE 240430	8,100,000.00	8,098,734.37
2.25 T-NOTE 241031	4,900,000.00	4,889,281.25
2.25 T-NOTE 241115	7,900,000.00	7,885,804.68
2.25 T-NOTE 241231	5,100,000.00	5,086,652.34
2.25 T-NOTE 251115	9,500,000.00	9,445,820.31
2.25 T-NOTE 260331	7,250,000.00	7,196,191.40
2.25 T-NOTE 270215	9,200,000.00	9,131,718.75
2.25 T-NOTE 270815	9,500,000.00	9,437,656.25
2.25 T-NOTE 271115	9,900,000.00	9,818,402.33
2.375 T-BOND 491115	5,430,000.00	5,253,100.78
2.375 T-BOND 510515	5,410,000.00	5,238,401.53
2.375 T-NOTE 240229	10,400,000.00	10,439,812.50
2.375 T-NOTE 240815	9,200,000.00	9,216,531.25
2.375 T-NOTE 270515	9,800,000.00	9,800,765.62
2.375 T-NOTE 290515	6,100,000.00	6,091,421.87
2.5 T-BOND 450215	4,180,000.00	4,058,192.18
2.5 T-BOND 460215	4,600,000.00	4,478,171.87
2.5 T-BOND 460515	4,600,000.00	4,480,687.50
2.5 T-NOTE 230815	9,050,000.00	9,127,773.43
2.5 T-NOTE 240515	10,200,000.00	10,254,984.37
2.5 T-NOTE 250131	6,000,000.00	6,024,609.37
2.625 T-NOTE 230630	5,600,000.00	5,659,937.50
2.625 T-NOTE 250331	4,500,000.00	4,535,332.02
2.625 T-NOTE 260131	5,400,000.00	5,437,968.75
2.625 T-NOTE 290215	8,800,000.00	8,923,750.00
2.75 T-BOND 420815	2,020,000.00	2,047,143.75
2.75 T-BOND 421115	3,800,000.00	3,846,312.50
2.75 T-BOND 470815	4,950,000.00	5,096,566.40
2.75 T-BOND 471115	4,700,000.00	4,838,062.50
2.75 T-NOTE 230531	3,000,000.00	3,035,859.37
2.75 T-NOTE 231115	8,800,000.00	8,896,250.00
2.75 T-NOTE 240215	6,800,000.00	6,874,375.00
2.75 T-NOTE 250630	7,900,000.00	7,987,949.21

2.75 T-NOTE 250831	7,500,000.00	7,583,203.12	
2.75 T-NOTE 280215	13,650,000.00	13,909,136.71	
2.875 T-BOND 430515	4,800,000.00	4,954,875.00	
2.875 T-BOND 450815	3,300,000.00	3,422,460.93	
2.875 T-BOND 461115	3,220,000.00	3,367,918.75	
2.875 T-BOND 490515	6,300,000.00	6,715,406.25	
2.875 T-NOTE 230930	6,000,000.00	6,081,562.50	
2.875 T-NOTE 231031	8,500,000.00	8,616,875.00	
2.875 T-NOTE 250430	4,900,000.00	4,974,648.43	
2.875 T-NOTE 250731	4,800,000.00	4,873,500.00	
2.875 T-NOTE 251130	5,400,000.00	5,487,328.12	
2.875 T-NOTE 280515	12,100,000.00	12,413,371.08	
2.875 T-NOTE 280815	10,850,000.00	11,144,136.71	
3 T-BOND 420515	3,040,000.00	3,207,912.50	
3 T-BOND 441115	4,250,000.00	4,486,406.25	
3 T-BOND 450515	3,400,000.00	3,594,171.87	
3 T-BOND 451115	2,910,000.00	3,088,010.15	
3 T-BOND 470215	4,460,000.00	4,771,154.68	
3 T-BOND 480215	5,430,000.00	5,872,884.37	
3 T-BOND 480815	5,600,000.00	6,065,500.00	
3 T-BOND 490215	6,180,000.00	6,729,923.43	
3 T-NOTE 250930	7,500,000.00	7,648,242.18	
3.125 T-BOND 411115	3,250,000.00	3,495,781.25	
3.125 T-BOND 420215	3,350,000.00	3,604,390.62	
3.125 T-BOND 430215	3,230,000.00	3,465,689.06	
3.125 T-BOND 440815	4,690,000.00	5,050,543.75	
3.125 T-BOND 480515	5,390,000.00	5,971,109.37	
3.125 T-NOTE 281115	10,000,000.00	10,434,375.00	
3.375 T-BOND 440515	3,850,000.00	4,302,675.78	
3.375 T-BOND 481115	6,000,000.00	6,975,937.50	
3.5 T-BOND 390215	1,700,000.00	1,940,789.06	
3.625 T-BOND 430815	3,200,000.00	3,700,000.00	
3.625 T-BOND 440215	4,200,000.00	4,863,796.87	
3.75 T-BOND 410815	2,850,000.00	3,341,847.65	
3.75 T-BOND 431115	2,510,000.00	2,955,525.00	
3.875 T-BOND 400815	4,280,000.00	5,098,550.00	
4.25 T-BOND 390515	2,100,000.00	2,621,718.75	
4.25 T-BOND 401115	4,860,000.00	6,055,256.25	
4.375 T-BOND 380215	1,390,000.00	1,750,965.62	
4.375 T-BOND 391115	2,180,000.00	2,763,490.62	
4.375 T-BOND 400515	2,350,000.00	2,983,214.84	
4.375 T-BOND 410515	4,380,000.00	5,557,125.00	

		4.5 T-BOND 360215	950,000.00	1,197,742.18	
		4.5 T-BOND 380515	1,230,000.00	1,573,631.25	
		4.5 T-BOND 390815	1,900,000.00	2,443,578.12	
		4.625 T-BOND 400215	2,230,000.00	2,914,679.68	
		4.75 T-BOND 410215	2,960,000.00	3,926,856.25	
		5 T-BOND 370515	1,150,000.00	1,534,621.09	
		5.375 T-BOND 310215	3,120,000.00	3,885,862.50	
		6 T-BOND 260215	3,600,000.00	4,087,406.25	
		6.125 T-BOND 271115	6,300,000.00	7,534,898.43	
		6.25 T-BOND 230815	6,500,000.00	6,891,523.43	
		6.25 T-BOND 300515	1,660,000.00	2,141,010.93	
アメリカドル合計			1,104,460,000.00	1,089,287,910.16 (132,969,375,193)	
カナダドル	国債証券	0.75 CAN GOVT 241001	3,950,000.00	3,814,621.65	
		1 CAN GOVT 270601	1,500,000.00	1,407,408.00	
		1.25 CAN GOVT 250301	3,050,000.00	2,968,992.00	
		1.25 CAN GOVT 300601	7,320,000.00	6,729,466.32	
		1.5 CAN GOVT 230601	3,250,000.00	3,233,737.00	
		1.5 CAN GOVT 260601	3,650,000.00	3,543,843.40	
		1.5 CAN GOVT 310601	3,500,000.00	3,248,819.00	
		1.5 CAN GOVT 311201	700,000.00	646,947.00	
		1.75 CAN GOVT 230301	4,000,000.00	4,001,092.00	
		2 CAN GOVT 230901	4,500,000.00	4,499,383.50	
		2 CAN GOVT 280601	1,500,000.00	1,475,973.00	
		2 CAN GOVT 511201	4,400,000.00	3,974,863.20	
		2.25 CAN GOVT 250601	4,200,000.00	4,207,736.40	
		2.25 CAN GOVT 290601	2,100,000.00	2,093,910.00	
		2.5 CAN GOVT 240601	3,200,000.00	3,224,659.20	
		2.75 CAN GOVT 481201	950,000.00	998,473.75	
		2.75 CANADA GOVER 641201	1,810,000.00	1,916,978.24	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,640,000.00	1,926,772.04	
		4 CAN GOVT 410601	790,000.00	967,608.59	
		5 CAN GOVT 370601	720,000.00	945,208.08	
5.75 CAN GOVT 290601	1,450,000.00	1,779,489.30			
5.75 CAN GOVT 330601	1,560,000.00	2,058,576.00			
カナダドル合計			59,740,000.00	59,664,557.67 (5,805,958,106)	
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 241121	2,200,000.00	2,099,145.46	
		0.5 AUST GOVT 260921	2,000,000.00	1,835,451.64	
		1 AUST GOVT 301221	4,100,000.00	3,552,611.37	
		1.25 AUST GOVT 320521	1,660,000.00	1,438,724.24	
		1.5 AUST GOVT 310621	2,400,000.00	2,159,057.35	
		1.75 AUST GOVT 510621	1,750,000.00	1,275,147.54	

		2.25 AUST GOVT 280521	4,300,000.00	4,220,133.21	
		2.5 AUST GOVT 300521	3,520,000.00	3,469,942.60	
		2.75 AUST GOVT 291121	2,080,000.00	2,092,696.11	
		2.75 AUST GOVT 350621	1,500,000.00	1,479,120.21	
		2.75 AUST GOVT 410521	1,440,000.00	1,366,892.74	
		3 AUST GOVT 470321	1,480,000.00	1,434,435.19	
		3.25 AUST GOVT 250421	4,500,000.00	4,639,748.40	
		3.25 AUST GOVT 290421	2,600,000.00	2,703,296.96	
		3.25 AUST GOVT 390621	900,000.00	926,230.41	
		3.75 AUST GOVT 370421	1,600,000.00	1,756,931.20	
		4.25 AUST GOVT 260421	2,850,000.00	3,054,444.46	
		4.5 AUST GOVT 330421	3,800,000.00	4,420,323.40	
		4.75 AUST GOVT 270421	2,800,000.00	3,101,494.48	
		5.5 AUST GOVT 230421	2,600,000.00	2,728,124.10	
オーストラリアドル合計			50,080,000.00	49,753,951.07 (4,557,959,457)	
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	1,650,000.00	1,574,688.39	
		0.25 GILT 250131	2,700,000.00	2,610,172.08	
		0.25 GILT 310731	2,950,000.00	2,602,991.50	
		0.375 GILT 301022	1,670,000.00	1,515,758.80	
		0.5 GILT 290131	650,000.00	607,097.80	
		0.625 GILT 250607	2,750,000.00	2,688,778.40	
		0.625 GILT 501022	1,030,000.00	760,391.32	
		0.875 GILT 291022	1,700,000.00	1,624,768.54	
		1 GILT 240422	3,400,000.00	3,376,854.16	
		1.125 GILT 731022	410,000.00	344,141.70	
		1.25 GILT 270722	1,800,000.00	1,785,690.00	
		1.25 GILT 411022	2,490,000.00	2,236,841.70	
		1.25 GILT 510731	170,000.00	147,795.28	
		1.5 GILT 260722	3,070,000.00	3,085,518.23	
		1.5 GILT 470722	1,850,000.00	1,714,876.00	
		1.5 GILT 530731	490,000.00	454,671.70	
		1.625 GILT 281022	900,000.00	910,525.32	
		1.625 GILT 711022	1,350,000.00	1,350,499.50	
		1.75 GILT 370907	2,400,000.00	2,368,800.00	
		1.75 GILT 490122	1,490,000.00	1,462,926.70	
		1.75 GILT 570722	2,350,000.00	2,342,950.00	
		2.5 GILT 650722	2,100,000.00	2,629,683.00	
		2.75 GILT 240907	2,350,000.00	2,427,331.92	
		3.25 GILT 440122	2,370,000.00	2,957,663.30	
		3.5 GILT 450122	2,580,000.00	3,360,501.60	
		3.5 GILT 680722	1,900,000.00	3,007,700.00	

		3.75 GILT 520722	1,830,000.00	2,649,254.40	
		4 GILT 600122	1,710,000.00	2,789,403.30	
		4.25 GILT 271207	2,860,000.00	3,296,150.00	
		4.25 GILT 320607	2,880,000.00	3,584,016.00	
		4.25 GILT 360307	2,560,000.00	3,332,761.60	
		4.25 GILT 390907	1,700,000.00	2,313,530.00	
		4.25 GILT 401207	1,740,000.00	2,399,181.60	
		4.25 GILT 461207	2,140,000.00	3,143,617.20	
		4.25 GILT 491207	1,640,000.00	2,494,915.60	
		4.25 GILT 551207	1,920,000.00	3,119,040.00	
		4.5 GILT 340907	2,230,000.00	2,910,975.10	
		4.5 GILT 421207	2,040,000.00	2,965,609.20	
		4.75 GILT 301207	1,950,000.00	2,463,357.78	
		4.75 GILT 381207	1,500,000.00	2,132,280.00	
		5 GILT 250307	2,930,000.00	3,231,906.61	
		6 GILT 281207	1,170,000.00	1,507,135.50	
イギリスポンド合計			81,370,000.00	94,282,750.83 (15,173,865,918)	
シンガ ポールド ル	国債証券	1.875 SINGAPORGOV 500301	600,000.00	519,600.00	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	3,000,000.00	3,008,400.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	850,000.00	827,254.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	250,000.00	255,750.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	1,400,000.00	1,421,038.22	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	1,220,000.00	1,259,528.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,100,000.00	1,131,900.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	950,000.00	988,950.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	1,200,000.00	1,252,800.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	500,000.00	513,650.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	600,000.00	660,300.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	1,120,000.00	1,188,880.00	
シンガポールドル合計			12,790,000.00	13,028,050.22 (1,172,003,397)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	3.48 MALAYSIAGOVT 230315	4,000,000.00	4,061,263.20	
		3.502MALAYSIAGOVT 270531	7,500,000.00	7,528,693.50	
		3.757 MALAYSIAGOV 400522	1,000,000.00	924,844.43	
		3.8 MALAYSIAGOVT 230817	4,000,000.00	4,083,890.00	
		3.828 MALAYSIAGOV 340705	4,000,000.00	3,858,232.68	
		3.844 MALAYSIAGOV 330415	4,000,000.00	3,920,125.04	
		3.885 MALAYSIAGOV 290815	8,600,000.00	8,662,976.08	
		3.906 MALAYSIAGOV 260715	4,000,000.00	4,089,853.60	
		3.955 MALAYSIAGOV 250915	3,000,000.00	3,084,615.00	
		4.181 MALAYSIAGOV 240715	3,000,000.00	3,094,991.10	

		4.762 MALAYSIAGOV 370407	4,500,000.00	4,774,572.90	
		4.921 MALAYSIAGOV 480706	2,790,000.00	2,974,957.47	
		4.935 MALAYSIAGOV 430930	2,500,000.00	2,677,528.25	
マレーシアリングット合計			52,890,000.00	53,736,543.25 (1,553,265,529)	
スウェーデンクローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	7,300,000.00	6,681,671.75	
		0.75 SWD GOVT 280512	6,300,000.00	6,179,506.20	
		0.75 SWD GOVT 291112	7,700,000.00	7,508,675.02	
		1 SWD GOVT 261112	10,150,000.00	10,131,577.75	
		1.5 SWD GOVT 231113	11,800,000.00	11,991,820.80	
		2.5 SWD GOVT 250512	7,200,000.00	7,560,935.28	
		3.5 SWD GOVT 390330	6,700,000.00	9,008,719.50	
スウェーデンクローネ合計			57,150,000.00	59,062,906.30 (767,227,152)	
ノルウェークローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	3,800,000.00	3,392,085.20	
		1.375 NORWE GOVT 300819	4,900,000.00	4,469,588.90	
		1.5 NORWE GOVT 260219	2,850,000.00	2,751,247.50	
		1.75 NORWE GOVT 250313	8,300,000.00	8,153,953.20	
		1.75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	4,106,956.90	
		1.75 NORWE GOVT 290906	6,200,000.00	5,869,826.44	
		2 NORWE GOVT 230524	7,250,000.00	7,287,526.00	
		2 NORWE GOVT 280426	5,050,000.00	4,903,045.00	
		2.125 NORWE GOVT 320518	1,800,000.00	1,734,120.00	
		3 NORWE GOVT 240314	11,450,000.00	11,643,505.00	
ノルウェークローネ合計			55,850,000.00	54,311,854.14 (764,710,906)	
デンマーククローネ	国債証券	0 DMK GOVT 311115	3,700,000.00	3,441,562.40	
		0.25 DMK GOVT 521115	5,250,000.00	4,378,053.75	
		0.5 DMK GOVT 271115	10,200,000.00	10,188,394.84	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,700,000.00	10,605,198.00	
		1.5 DMK GOVT 231115	8,100,000.00	8,333,288.10	
		1.75 DMK GOVT 251115	10,200,000.00	10,744,598.40	
		4.5 DMK GOVT 391115	12,970,000.00	20,646,662.84	
デンマーククローネ合計			61,120,000.00	68,337,758.33 (1,234,179,915)	
メキシコペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	44,750,000.00	46,254,866.42	
		10 MEXICAN BONOS 361120	9,000,000.00	10,161,543.60	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	46,350,000.00	41,984,380.63	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	20,000,000.00	19,735,800.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	35,750,000.00	34,142,653.54	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	33,000,000.00	31,554,105.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	10,800,000.00	10,211,184.00	

		7.75 MEXICAN BONO 421113	24,100,000.00	22,276,353.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	41,500,000.00	41,173,837.80	
		8 MEXICAN BONOS 240905	15,000,000.00	14,818,650.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	22,000,000.00	20,787,717.94	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	33,400,000.00	33,388,271.25	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	27,700,000.00	27,818,824.69	
メキシコペソ合計			363,350,000.00	354,308,187.87 (2,153,662,319)	
イスラエル シェケル	国債証券	1.5 ISRAEL FIXED 231130	4,000,000.00	4,040,400.00	
		1.75 ISRAEL FIXED 250831	3,800,000.00	3,849,590.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	5,300,000.00	5,449,990.00	
		4.25 ISRAEL FIXED 230331	4,500,000.00	4,654,575.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	6,310,000.00	8,844,096.00	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6,000,000.00	7,301,700.00	
イスラエルシェケル合計			29,910,000.00	34,140,351.00 (1,295,288,330)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.75 POLAND 250425	6,000,000.00	5,182,500.00	
		1.25 POLAND 301025	4,700,000.00	3,434,290.00	
		2.25 POLAND 241025	4,000,000.00	3,683,900.00	
		2.5 POLAND 240425	3,000,000.00	2,820,240.00	
		2.5 POLAND 260725	5,000,000.00	4,392,250.00	
		2.5 POLAND 270725	5,600,000.00	4,819,920.00	
		2.75 POLAND 280425	3,700,000.00	3,172,472.50	
		2.75 POLAND 291025	5,000,000.00	4,208,250.00	
		3.25 POLAND 250725	3,550,000.00	3,292,713.75	
		4 POLAND 231025	4,150,000.00	4,051,811.00	
		5.75 POLAND 290425	1,400,000.00	1,423,380.00	
ポーランドズロチ合計			46,100,000.00	40,481,727.25 (1,139,487,754)	
中国元	国債証券	2.75 CHINA GOVT 320217	4,000,000.00	3,980,594.80	
		2.85 CHINA GOVT 270604	7,000,000.00	7,062,660.50	
		2.88 CHINA GOVT 231105	9,000,000.00	9,084,402.00	
		2.89 CHINA GOVT 311118	5,000,000.00	5,032,303.00	
		2.94 CHINA GOVT 241017	10,000,000.00	10,133,341.00	
		3.01 CHINA GOVT 280513	6,000,000.00	6,071,550.60	
		3.02 CHINA GOVT 251022	7,000,000.00	7,116,973.50	
		3.02 CHINA GOVT 310527	5,000,000.00	5,050,237.50	
		3.03 CHINA GOVT 260311	10,000,000.00	10,168,999.00	
		3.12 CHINA GOVT 261205	8,000,000.00	8,175,412.80	
		3.13 CHINA GOVT 291121	4,000,000.00	4,071,485.20	
		3.25 CHINA GOVT 260606	8,000,000.00	8,205,560.00	
		3.25 CHINA GOVT 281122	11,000,000.00	11,306,549.10	

		3.27 CHINA GOVT 301119	6,000,000.00	6,186,060.00	
		3.29 CHINA GOVT 231018	11,000,000.00	11,183,151.10	
		3.39 CHINA GOVT 500316	8,000,000.00	7,873,642.40	
		3.54 CHINA GOVT 280816	4,000,000.00	4,196,933.60	
		3.57 CHINA GOVT 240622	11,000,000.00	11,316,193.90	
		3.61 CHINA GOVT 250607	9,000,000.00	9,349,331.40	
		3.72 CHINA GOVT 510412	4,000,000.00	4,217,902.00	
		3.81 CHINA GOVT 500914	4,000,000.00	4,247,872.80	
		3.86 CHINA GOVT 490722	4,000,000.00	4,268,068.80	
		4.08 CHINA GOVT 230822	9,000,000.00	9,282,032.10	
中国元合計			164,000,000.00	167,581,257.10 (3,212,884,619)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	2,300,000.00	2,312,873.10	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	750,000.00	695,219.41	
		0 BUND 260815	4,700,000.00	4,667,104.70	
		0 BUND 290815	3,950,000.00	3,847,489.60	
		0 BUND 300815	6,000,000.00	5,797,674.00	
		0 BUND 310215	3,450,000.00	3,319,027.65	
		0 BUND 310815	1,700,000.00	1,625,579.10	
		0 BUND 350515	4,240,000.00	3,916,610.96	
		0 BUND 500815	3,710,000.00	3,111,577.00	
		0 BUND 500815	140,000.00	118,343.40	
		0 BUND 520815	1,000,000.00	820,813.00	
		0 ITALY GOVT 240115	5,200,000.00	5,183,453.60	
		0 NETH GOVT 270115	900,000.00	885,014.80	
		0 NETH GOVT 300715	3,950,000.00	3,760,589.60	
		0 NETH GOVT 380115	700,000.00	608,731.06	
		0 NETH GOVT 520115	1,310,000.00	1,029,149.10	
		0 O.A.T 240225	1,800,000.00	1,805,644.80	
		0 O.A.T 240325	5,000,000.00	5,010,910.00	
		0 O.A.T 250225	650,000.00	647,189.92	
		0 O.A.T 270225	5,200,000.00	5,081,965.20	
		0 O.A.T 291125	300,000.00	284,244.00	
		0 O.A.T 311125	6,000,000.00	5,496,925.97	
		0 OBL 240405	2,100,000.00	2,109,359.70	
		0 OBL 241018	7,500,000.00	7,518,885.00	
		0 OBL 261009	3,700,000.00	3,665,834.20	
		0.1 BEL GOVT 300622	1,770,000.00	1,680,219.24	
		0.125 FINNISH GOV 360415	500,000.00	439,143.00	
		0.125 FINNISH GOV 520415	390,000.00	296,812.23	
		0.25 AUSTRIA GOVT 361020	480,000.00	424,570.08	
		0.25 BUND 270215	7,200,000.00	7,213,680.00	

0.25 BUND 280815	3,820,000.00	3,804,509.90	
0.25 BUND 290215	3,820,000.00	3,798,993.82	
0.25 FINNISH GOVT 400915	420,000.00	360,322.20	
0.25 NETH GOVT 250715	2,250,000.00	2,259,945.00	
0.25 NETH GOVT 290715	1,240,000.00	1,215,483.96	
0.25 O.A.T 261125	5,250,000.00	5,212,026.75	
0.35 ITALY GOVT 250201	2,400,000.00	2,383,368.00	
0.35 SPAIN GOVT 230730	3,700,000.00	3,727,809.20	
0.4 BEL GOVT 400622	1,000,000.00	846,877.00	
0.4 IRISH GOVT 350515	800,000.00	722,165.86	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	1,240,000.00	1,245,562.64	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	3,400,000.00	3,366,690.20	
0.5 BEL GOVT 241022	1,800,000.00	1,824,154.20	
0.5 BUND 250215	4,150,000.00	4,216,217.40	
0.5 BUND 260215	6,130,000.00	6,222,734.64	
0.5 BUND 270815	5,090,000.00	5,152,983.66	
0.5 BUND 280215	3,600,000.00	3,643,718.40	
0.5 FINNISH GOVT 260415	700,000.00	706,230.00	
0.5 FINNISH GOVT 270915	800,000.00	801,738.40	
0.5 FINNISH GOVT 280915	700,000.00	695,960.30	
0.5 FINNISH GOVT 290915	800,000.00	789,869.60	
0.5 NETH GOVT 260715	2,200,000.00	2,224,565.20	
0.5 NETH GOVT 400115	1,270,000.00	1,202,273.44	
0.5 O.A.T 250525	4,500,000.00	4,548,825.00	
0.5 O.A.T 260525	6,500,000.00	6,542,783.00	
0.5 O.A.T 290525	7,660,000.00	7,580,680.70	
0.5 O.A.T 720525	1,370,000.00	857,781.11	
0.5 SPAIN GOVT 300430	3,150,000.00	3,011,508.13	
0.5 SPAIN GOVT 311031	3,850,000.00	3,564,183.70	
0.6 ITALY GOVT 310801	2,580,000.00	2,282,393.69	
0.65 BEL GOVT 710622	400,000.00	263,369.32	
0.65 ITALY GOVT 231015	3,400,000.00	3,437,315.00	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	1,900,000.00	1,932,892.80	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,450,000.00	1,470,111.50	
0.75 FINNISH GOVT 310415	1,010,000.00	1,006,888.19	
0.75 NETH GOVT 270715	2,100,000.00	2,140,905.90	
0.75 NETH GOVT 280715	2,500,000.00	2,545,625.00	
0.75 O.A.T 280525	5,920,000.00	5,991,336.00	
0.75 O.A.T 281125	5,670,000.00	5,727,289.68	
0.75 O.A.T 520525	3,740,000.00	3,109,462.18	
0.8 BEL GOVT 250622	3,100,000.00	3,165,038.00	
0.8 BEL GOVT 270622	2,800,000.00	2,853,810.40	

0.8 BEL GOVT 280622	2,100,000.00	2,135,130.90
0.85 ITALY GOVT 270115	3,800,000.00	3,751,588.00
0.875 FINNISH GOV 250915	900,000.00	921,906.90
0.9 BEL GOVT 290622	2,300,000.00	2,343,424.00
0.9 IRISH GOVT 280515	1,600,000.00	1,626,360.00
0.95 ITALY GOVT 300801	3,900,000.00	3,640,200.21
1 BEL GOVT 260622	1,300,000.00	1,336,875.80
1 BEL GOVT 310622	2,900,000.00	2,945,101.67
1 BUND 240815	5,400,000.00	5,547,004.20
1 IRISH GOVT 260515	1,100,000.00	1,128,710.00
1 O.A.T 251125	6,000,000.00	6,161,952.00
1 O.A.T 270525	4,800,000.00	4,931,232.00
1 SPAIN GOVT 501031	1,160,000.00	918,394.04
1.1 IRISH GOVT 290515	1,170,000.00	1,199,677.05
1.125 FINNISH GOV 340415	730,000.00	741,953.75
1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1,300,000.00	1,348,175.40
1.2 SPAIN GOVT 401031	1,960,000.00	1,772,744.53
1.25 BEL GOVT 330422	1,320,000.00	1,364,733.48
1.25 BUND 480815	3,430,000.00	3,978,662.80
1.25 O.A.T 340525	4,520,000.00	4,609,251.92
1.25 O.A.T 360525	3,760,000.00	3,808,090.40
1.25 SPAIN GOVT 301031	3,970,000.00	4,004,100.31
1.3 IRISH GOVT 330515	1,100,000.00	1,119,288.50
1.3 SPAIN GOVT 261031	3,500,000.00	3,612,227.50
1.35 IRISH GOVT 310318	1,250,000.00	1,305,212.50
1.375 FINNISH GOV 470415	780,000.00	847,345.98
1.4 SPAIN GOVT 280430	3,800,000.00	3,927,813.00
1.4 SPAIN GOVT 280730	3,150,000.00	3,253,149.90
1.45 BEL GOVT 370622	550,000.00	565,345.00
1.45 ITALY GOVT 241115	2,600,000.00	2,658,674.20
1.45 ITALY GOVT 250515	2,600,000.00	2,660,229.00
1.45 ITALY GOVT 360301	1,870,000.00	1,711,496.93
1.45 SPAIN GOVT 271031	4,050,000.00	4,194,836.10
1.45 SPAIN GOVT 290430	3,240,000.00	3,348,857.52
1.45 SPAIN GOVT 711031	690,000.00	504,781.92
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	1,370,000.00	1,488,248.81
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	650,000.00	664,274.00
1.5 BUND 240515	4,850,000.00	5,025,220.80
1.5 IRISH GOVT 500515	820,000.00	818,265.70
1.5 ITALY GOVT 250601	2,980,000.00	3,054,887.40
1.5 ITALY GOVT 450430	370,000.00	311,734.50
1.5 O.A.T 310525	8,360,000.00	8,858,306.16
1.5 O.A.T 500525	4,100,000.00	4,189,330.80

1.5 SPAIN GOVT 270430	3,100,000.00	3,217,192.40	
1.6 BEL GOVT 470622	1,750,000.00	1,790,836.25	
1.6 ITALY GOVT 260601	6,000,000.00	6,154,392.00	
1.6 SPAIN GOVT 250430	2,900,000.00	3,018,682.50	
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1,500,000.00	1,566,664.50	
1.65 ITALY GOVT 301201	2,130,000.00	2,093,728.23	
1.65 ITALY GOVT 320301	3,190,000.00	3,103,860.43	
1.7 BEL GOVT 500622	450,000.00	469,622.70	
1.7 IRISH GOVT 370515	1,230,000.00	1,304,071.83	
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1,900,000.00	1,959,916.50	
1.75 BUND 240215	1,950,000.00	2,024,505.60	
1.75 NETH GOVT 230715	4,700,000.00	4,838,043.70	
1.75 O.A.T 241125	7,200,000.00	7,530,055.20	
1.75 O.A.T 390625	4,210,000.00	4,584,807.88	
1.75 O.A.T 660525	1,600,000.00	1,714,857.60	
1.8 ITALY GOVT 410301	1,050,000.00	957,291.67	
1.85 ITALY GOVT 240515	4,400,000.00	4,538,811.20	
1.85 ITALY GOVT 250701	3,800,000.00	3,934,078.06	
1.9 BEL GOVT 380622	1,050,000.00	1,153,693.80	
1.95 SPAIN GOVT 260430	3,000,000.00	3,168,552.00	
1.95 SPAIN GOVT 300730	3,250,000.00	3,465,006.02	
2 FINNISH GOVT 240415	2,050,000.00	2,139,380.00	
2 IRISH GOVT 450218	1,070,000.00	1,201,840.05	
2 ITALY GOVT 251201	3,700,000.00	3,857,856.80	
2 ITALY GOVT 280201	900,000.00	934,111.80	
2 NETH GOVT 240715	1,700,000.00	1,781,246.40	
2 O.A.T 480525	3,350,000.00	3,808,082.35	
2.05 ITALY GOVT 270801	3,750,000.00	3,905,085.00	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	880,000.00	1,068,244.32	
2.15 BEL GOVT 660622	890,000.00	1,044,468.40	
2.15 SPAIN GOVT 251031	3,550,000.00	3,766,571.30	
2.2 ITALY GOVT 270601	3,300,000.00	3,465,118.80	
2.25 BEL GOVT 230622	2,150,000.00	2,221,432.24	
2.25 BEL GOVT 570622	1,150,000.00	1,361,209.00	
2.25 ITALY GOVT 360901	2,060,000.00	2,078,375.20	
2.25 O.A.T 240525	11,700,000.00	12,289,984.20	
2.35 SPAIN GOVT 330730	4,030,000.00	4,420,563.42	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	1,100,000.00	1,281,786.00	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,740,000.00	1,964,280.08	
2.45 ITALY GOVT 330901	2,400,000.00	2,495,400.00	
2.45 ITALY GOVT 500901	2,850,000.00	2,802,857.80	
2.5 BUND 440704	3,110,000.00	4,375,194.65	

2.5 BUND 460815	3,510,000.00	5,068,908.92
2.5 ITALY GOVT 241201	2,500,000.00	2,629,242.50
2.5 ITALY GOVT 251115	2,250,000.00	2,386,350.00
2.5 NETH GOVT 330115	1,930,000.00	2,282,611.00
2.5 O.A.T 300525	8,750,000.00	9,996,358.75
2.6 BEL GOVT 240622	1,600,000.00	1,696,190.40
2.625 FINNISH GOV 420704	570,000.00	734,571.54
2.7 ITALY GOVT 470301	2,830,000.00	2,967,463.28
2.7 SPAIN GOVT 481031	2,140,000.00	2,489,294.43
2.75 FINNISH GOVT 280704	590,000.00	671,371.62
2.75 NETH GOVT 470115	2,290,000.00	3,316,632.19
2.75 O.A.T 271025	5,480,000.00	6,168,178.40
2.75 SPAIN GOVT 241031	3,600,000.00	3,846,830.40
2.8 ITALY GOVT 281201	4,860,000.00	5,273,858.16
2.8 ITALY GOVT 670301	2,220,000.00	2,211,294.07
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,450,000.00	2,950,192.00
2.95 ITALY GOVT 380901	2,510,000.00	2,744,165.43
3 BEL GOVT 340622	990,000.00	1,209,043.44
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	1,070,000.00	1,519,637.54
3.25 BUND 420704	2,160,000.00	3,268,397.08
3.25 ITALY GOVT 460901	2,710,000.00	3,112,359.12
3.25 O.A.T 450525	3,630,000.00	5,003,773.50
3.35 ITALY GOVT 350301	1,950,000.00	2,214,074.85
3.45 ITALY GOVT 480301	2,680,000.00	3,181,484.28
3.45 SPAIN GOVT 660730	2,090,000.00	2,726,361.11
3.5 ITALY GOVT 300301	5,350,000.00	6,081,569.70
3.5 O.A.T 260425	5,300,000.00	5,988,735.00
3.75 BEL GOVT 450622	1,380,000.00	2,012,786.58
3.75 ITALY GOVT 240901	3,400,000.00	3,671,813.00
3.75 NETH GOVT 420115	2,160,000.00	3,314,174.40
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	430,000.00	771,362.38
3.8 SPAIN GOVT 240430	5,900,000.00	6,367,368.50
3.9 IRISH GOVT 230320	2,200,000.00	2,293,968.16
4 BEL GOVT 320328	1,160,000.00	1,506,649.76
4 BUND 370104	3,210,000.00	4,785,053.91
4 FINNISH GOVT 250704	750,000.00	846,031.50
4 ITALY GOVT 370201	3,210,000.00	3,939,356.94
4 NETH GOVT 370115	2,000,000.00	2,880,536.00
4 O.A.T 381025	3,520,000.00	5,029,759.68
4 O.A.T 550425	2,580,000.00	4,307,019.73
4 O.A.T 600425	1,900,000.00	3,287,459.80
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	2,100,000.00	3,018,311.10
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,950,000.00	3,977,644.30

4.25 BEL GOVT 410328	2,010,000.00	2,980,279.26	
4.25 BUND 390704	1,990,000.00	3,187,659.61	
4.4 SPAIN GOVT 231031	3,100,000.00	3,327,201.48	
4.5 BEL GOVT 260328	1,200,000.00	1,404,428.40	
4.5 ITALY GOVT 230501	5,100,000.00	5,372,967.30	
4.5 ITALY GOVT 240301	2,900,000.00	3,138,960.00	
4.5 O.A.T 410425	4,890,000.00	7,552,117.95	
4.65 SPAIN GOVT 250730	3,650,000.00	4,160,927.00	
4.7 SPAIN GOVT 410730	2,500,000.00	3,720,512.50	
4.75 BUND 280704	2,100,000.00	2,684,646.30	
4.75 BUND 340704	3,320,000.00	5,003,183.56	
4.75 BUND 400704	2,300,000.00	3,955,549.88	
4.75 ITALY GOVT 230801	4,300,000.00	4,589,405.91	
4.75 ITALY GOVT 280901	4,800,000.00	5,776,785.60	
4.75 ITALY GOVT 440901	2,470,000.00	3,469,758.68	
4.75 O.A.T 350425	3,760,000.00	5,460,542.72	
4.8 SPAIN GOVT 240131	2,400,000.00	2,618,033.28	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,400,000.00	1,661,079.14	
4.9 SPAIN GOVT 400730	2,770,000.00	4,180,267.94	
5 BEL GOVT 350328	2,150,000.00	3,157,307.25	
5 ITALY GOVT 250301	3,850,000.00	4,341,652.70	
5 ITALY GOVT 340801	1,750,000.00	2,315,346.25	
5 ITALY GOVT 390801	3,620,000.00	5,019,802.23	
5 ITALY GOVT 400901	3,570,000.00	5,004,173.60	
5.15 SPAIN GOVT 281031	2,000,000.00	2,541,168.00	
5.15 SPAIN GOVT 441031	2,100,000.00	3,409,331.94	
5.25 ITALY GOVT 291101	6,480,000.00	8,216,309.52	
5.4 IRISH GOVT 250313	1,600,000.00	1,845,894.40	
5.5 BEL GOVT 280328	1,690,000.00	2,199,399.80	
5.5 BUND 310104	3,810,000.00	5,491,981.65	
5.5 NETH GOVT 280115	1,800,000.00	2,326,041.00	
5.5 O.A.T 290425	5,090,000.00	6,826,786.38	
5.625 BUND 280104	2,700,000.00	3,531,026.25	
5.75 ITALY GOVT 330201	2,600,000.00	3,558,613.76	
5.75 O.A.T 321025	4,650,000.00	6,919,014.00	
5.75 SPAIN GOVT 320730	3,780,000.00	5,400,436.86	
5.9 SPAIN GOVT 260730	3,200,000.00	3,932,009.60	
6 ITALY GOVT 310501	5,240,000.00	7,078,632.16	
6 O.A.T 251025	5,000,000.00	6,046,810.00	
6 SPAIN GOVT 290131	3,300,000.00	4,429,190.70	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,400,000.00	1,839,210.80	
6.25 BUND 300104	2,000,000.00	2,909,130.00	

	6.5 BUND 270704	2,070,000.00	2,748,436.29	
	6.5 ITALY GOVT 271101	4,070,000.00	5,225,717.20	
	7.25 ITALY GOVT 261101	3,000,000.00	3,839,142.00	
	9 ITALY GOVT 231101	2,550,000.00	2,914,018.62	
ユーロ合計		695,550,000.00	772,076,719.87 (103,728,507,314)	
合計			275,528,375,909 (275,528,375,909)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 166銘柄	100.00%	48.26%
カナダドル	国債証券 22銘柄	100.00%	2.11%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	100.00%	1.65%
イギリスポンド	国債証券 42銘柄	100.00%	5.51%
シンガポールドル	国債証券 12銘柄	100.00%	0.43%
マレーシアリングット	国債証券 13銘柄	100.00%	0.56%
スウェーデンクローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.28%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.00%	0.28%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.45%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.00%	0.78%
イスラエルシェケル	国債証券 6銘柄	100.00%	0.47%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.00%	0.41%
中国元	国債証券 23銘柄	100.00%	1.17%
ユーロ	国債証券 246銘柄	100.00%	37.65%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

２【ファンドの現況】

【三菱ＵＦＪ ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）】

【純資産額計算書】

令和 4年 3月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	16,801,227,643
II 負債総額	24,915,008
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,776,312,635
IV 発行済口数	14,346,511,837口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1694
(10,000口当たり)	(11,694)

(参考)

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 3月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,571,483,898,733
II 負債総額	2,175,847,423
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,569,308,051,310
IV 発行済口数	325,694,388,153口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	4.8183
(10,000口当たり)	(48,183)

国内債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 3月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	232,567,989,877
II 負債総額	2,226,532,453
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	230,341,457,424
IV 発行済口数	238,916,310,262口

V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9641
（10,000口当たり）	（9,641）

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

I 資産総額	330,519,713,466
II 負債総額	37,117,643,238
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	293,402,070,228
IV 発行済口数	228,713,040,689口
V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2828
（10,000口当たり）	（12,828）

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、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額等

2022年3月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤投資行動のモニタリング1

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

⑥投資行動のモニタリング2

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

⑦ファンドに関係する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2022年 3月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	902	19,898,902
追加型公社債投資信託	16	1,365,892
単位型株式投資信託	91	421,250
単位型公社債投資信託	52	183,921
合 計	1,061	21,869,965

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			利益準備金	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		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			利益準備金	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		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			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金			
						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
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円 (2022年3月31日現在)	銀行業務を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社滋賀銀行	33,076 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社紀陽銀行	80,096 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495 百万円 (2021年12月10日現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065 百万円	銀行業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2022年3月末現在）

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

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 6月24日	有価証券届出書
2021年 6月24日	有価証券報告書
2021年12月24日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年12月24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4月27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」に掲げられている三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）の令和3年3月26日から令和4年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）の令和4年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。